

## 【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27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】	D C 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27年3月12日から平成28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な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い合わせることにより知ることができます。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27年3月12日から平成28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、販売会社に取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとしします。

委託会社の各営業日の午後3時までに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

単字型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)
単字型投信	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 ( )
		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				
一般	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株				
中小型株	年2回	日本		
債券	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )
一般	年6回 (隔月)	欧州		
公債	年12回 (毎月)	アジア		
社債	日々	オセアニア		
その他債券	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
クレジット属性 ( )		アフリカ		
不動産投信		中近東 (中東)		
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))		エマージング		
資産複合 ( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、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年に近づくにしながら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。

## 〈2014年12月時点の基本配分比率〉

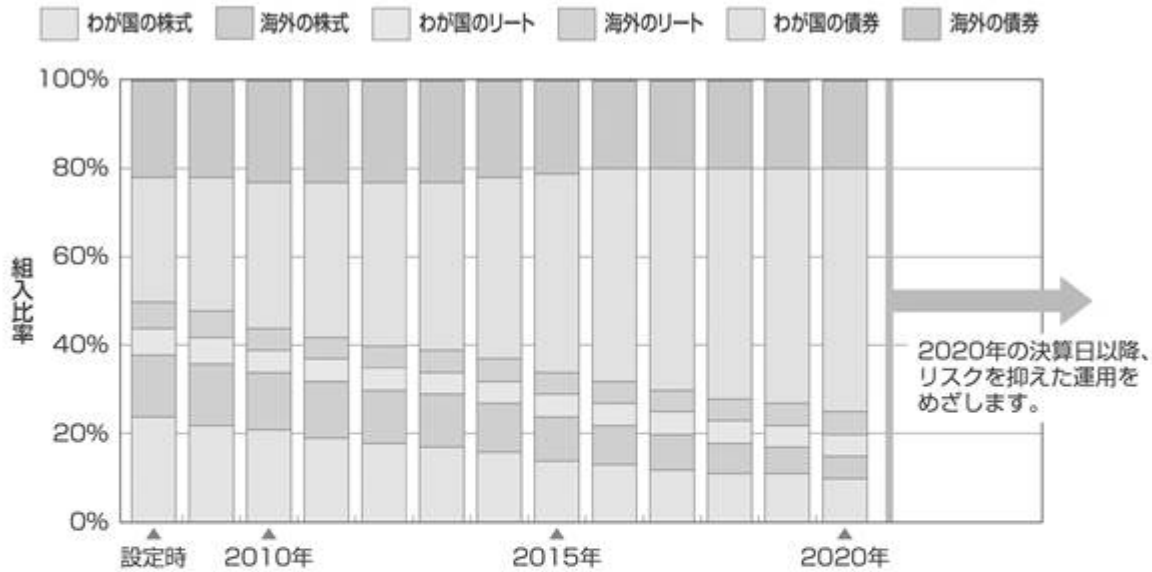
	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	16%	11%	5%	5%	41%	22%

## 〈当初設定時の基本配分比率〉

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 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) 2014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。2013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ダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・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]

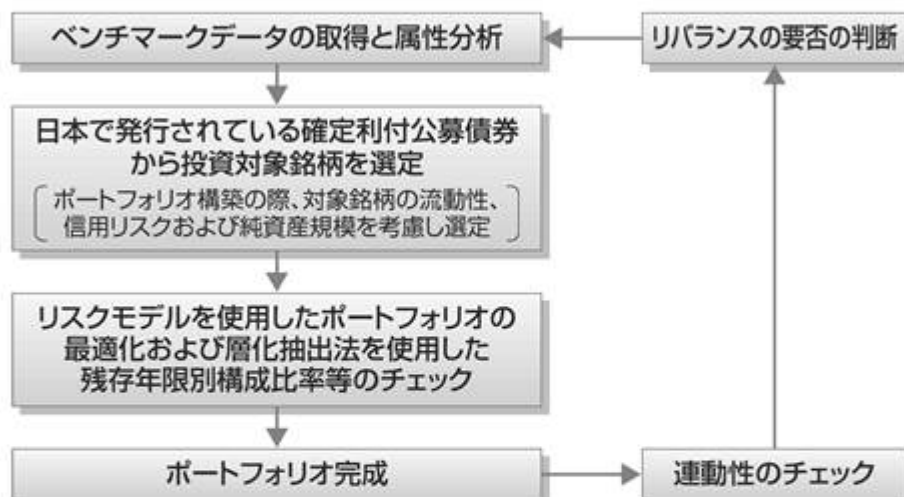
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

S&P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's® およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

## 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。

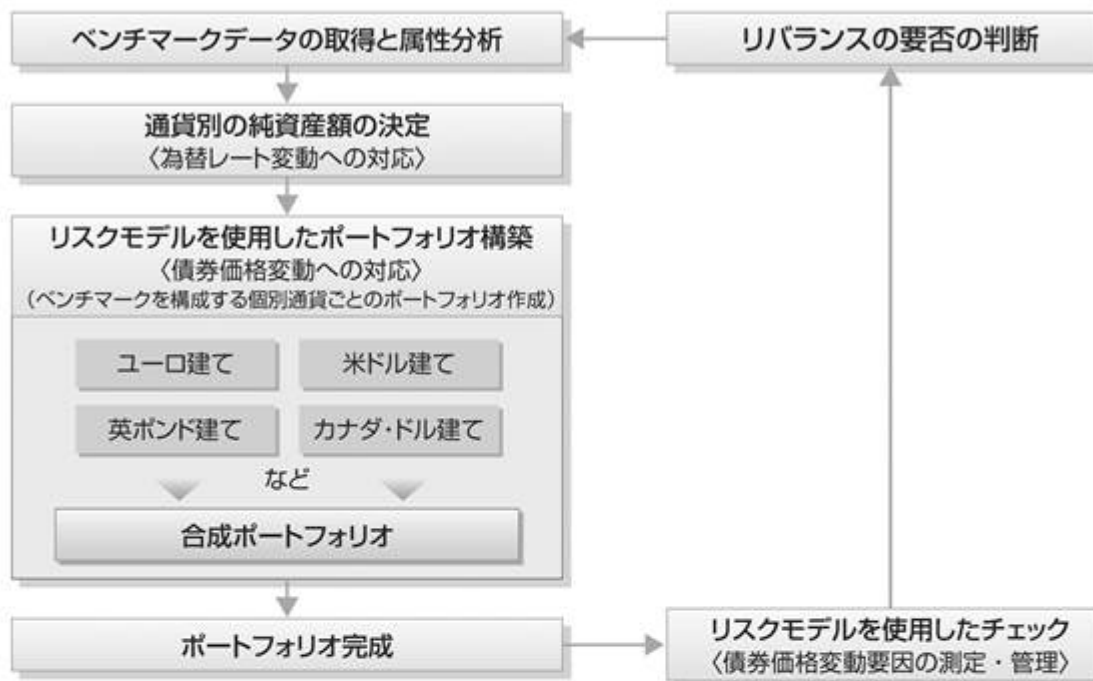
## NOMURA－BPI総合指数とは

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、Citigroup Index LLC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。

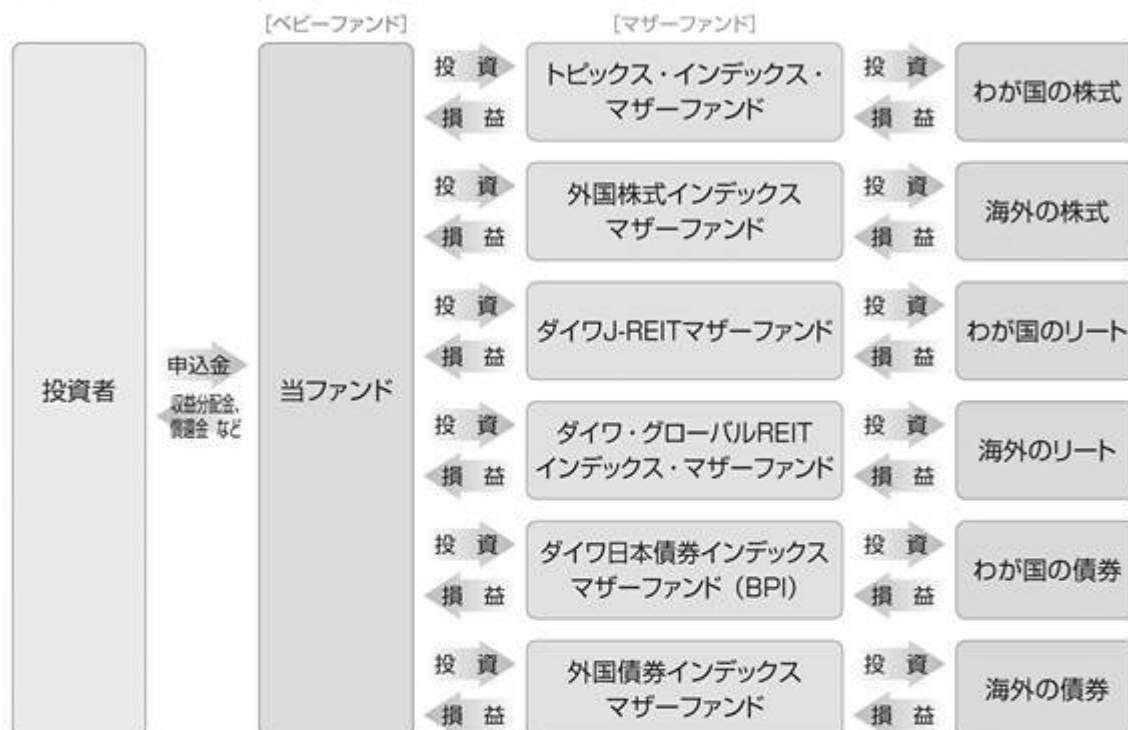


## ファンドの仕組み

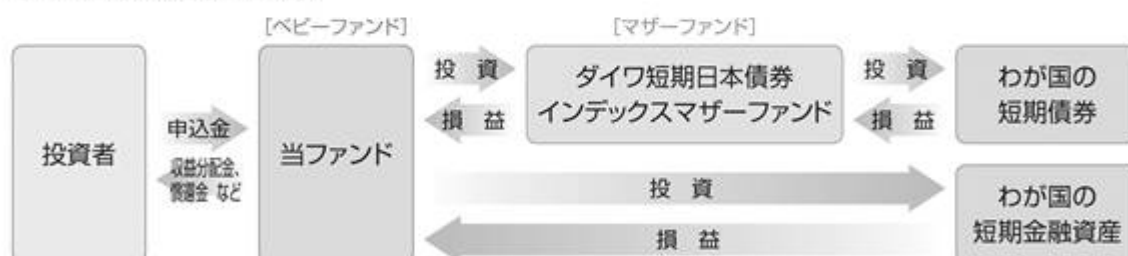
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

〈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ないません。

- 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～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	<p>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。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
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	<p>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。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3）

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

損益 投資

投資対象	内外の株式・債券・リート（REIT）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ないます。）
------	---

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

< 委託会社の概況（平成26年12月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

#### 主要投資対象

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 - R E I Tマザーファンドの受益証券
4. 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（B P I）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（R E I T）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年に近づくにしながら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 - R E I T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R E I T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（B P I）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。）

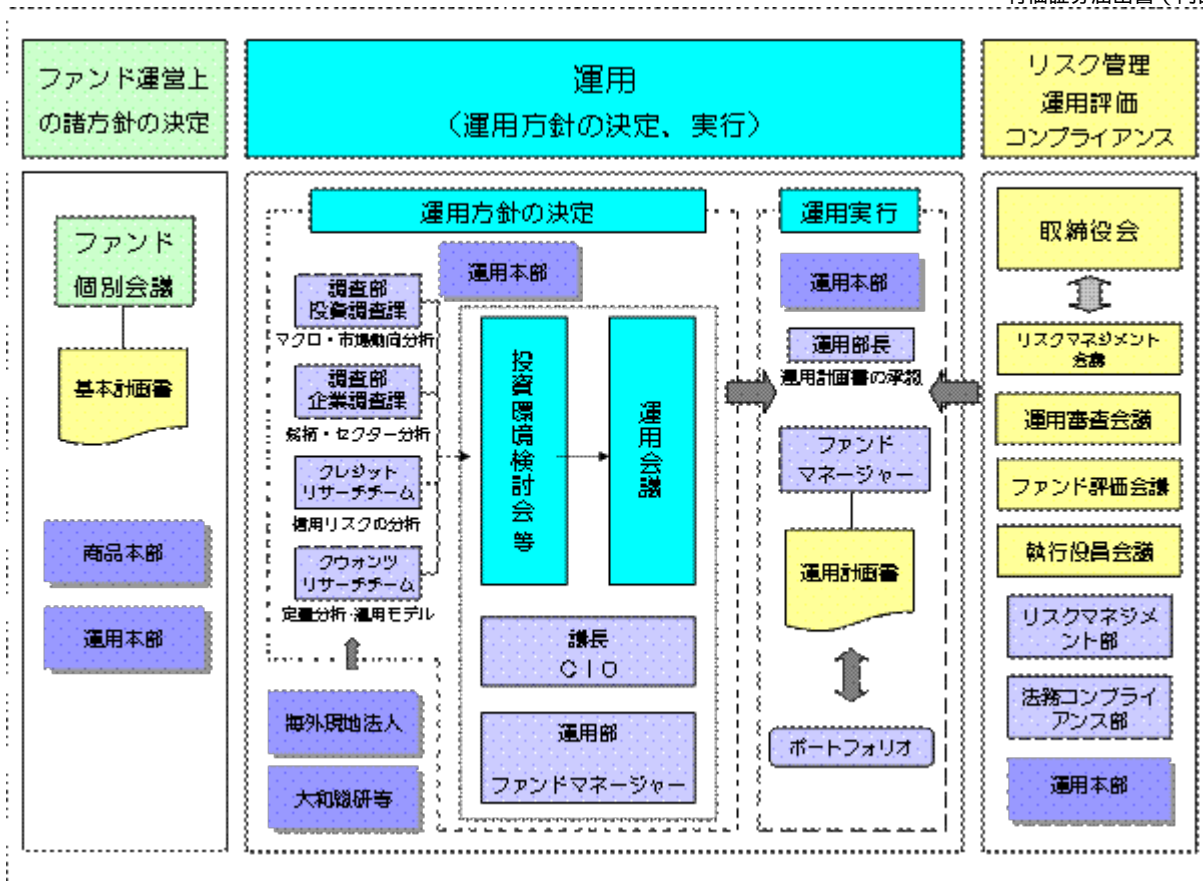
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。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。

イ．ファンド評価会議

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。

ロ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ハ．リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ニ．執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

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27年1月1日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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ないません。

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

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. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは

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。

（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いません。
- 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いません。
- ニ．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 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）とは

S & P 先進国 R E I T 指数は、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・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 R E I T 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 R E I T 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。

S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（「当インデックス」）は S&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's®および S&P®は Standard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®は Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが SPDJI に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

## 5 . 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 - B P I 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

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

### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

#### イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(注) NOMURA - B P I 総合指数とは

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

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

## 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。

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

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

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

## (3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 先物取引等

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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ます。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

## 21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

## (3) 主な投資制限

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

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、Citigroup Index LLC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 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 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 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）

## 〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



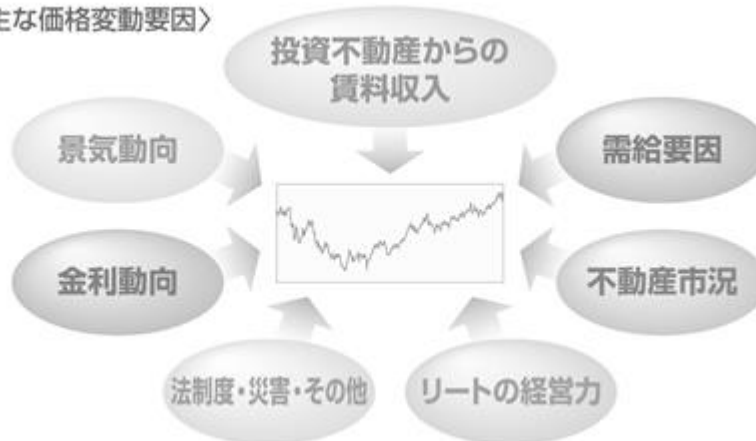
※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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．リーートの価格や配当は、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リーートの収益は、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。

二．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付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合

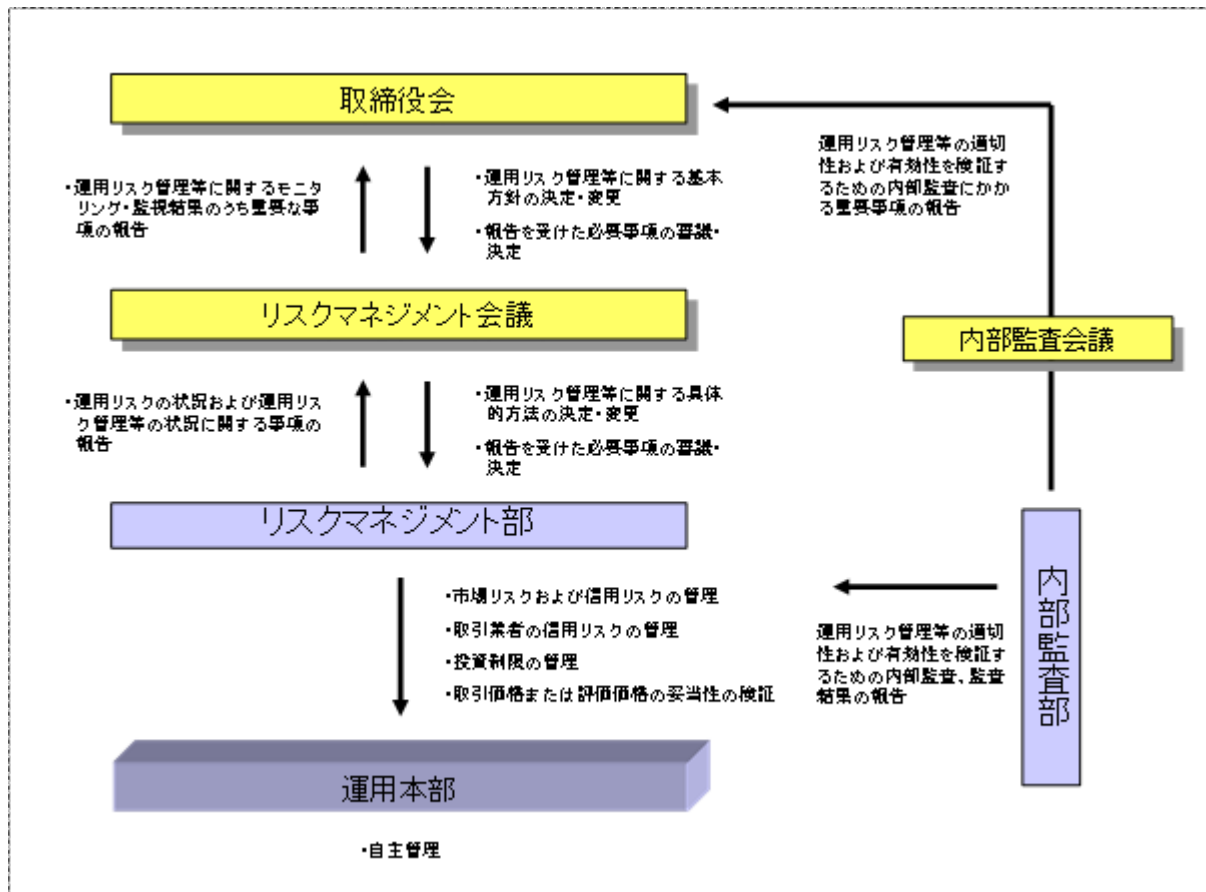
には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者のご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

### (3) その他の留意点

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

### (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。

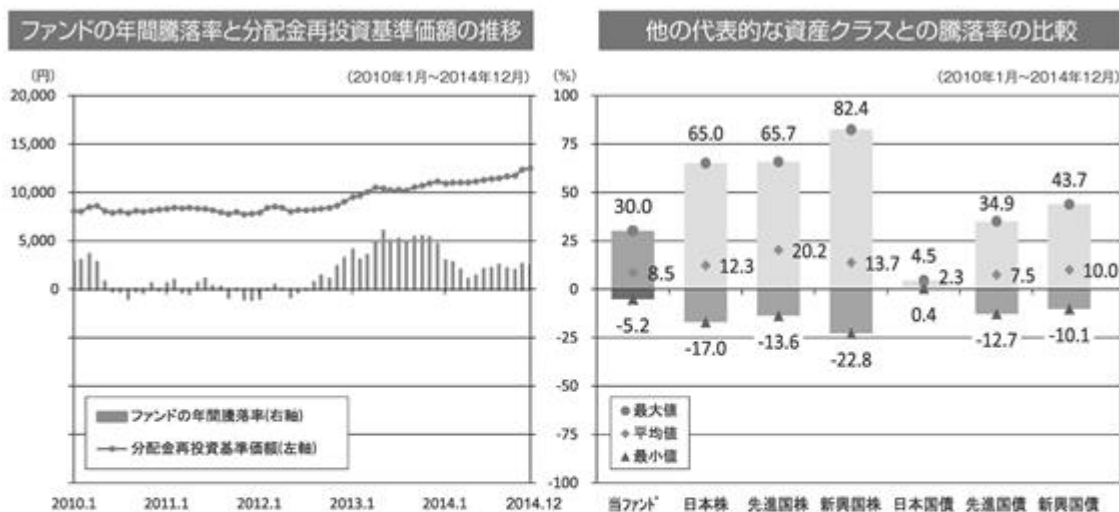


#### 流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

## 参 考 情 報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、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たものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

## ※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）  
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）  
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）  
 日本国債：NOMURA-BPI国債  
 先進国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

## ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有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。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債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国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 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0.702%（税抜0.65%）
第14計算期間以降	年率0.27%（税抜0.25%）

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% （税抜）	年率0.3% （税抜）	年率0.05% （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% （税抜）	年率0.11% （税抜）	年率0.03% （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。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (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。

#### 八．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12月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成26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	122,082,371	99.81
内 日本	122,082,371	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	233,462	0.19
純資産総額	122,315,833	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26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	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資 信託受 益証券	41,016,943	1.2137 49,782,316	1.2176 49,942,229	40.83
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	9,072,041	2.9260 26,545,518	2.9482 26,746,191	21.87
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	23,438,260	0.8038 18,841,881	0.8227 19,282,656	15.76
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	6,699,427	1.9291 12,924,252	2.0305 13,603,186	11.12
5 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	2,903,795	2.0760 6,028,279	2.1620 6,278,004	5.13
6 ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	2,568,904	2.3318 5,990,427	2.4252 6,230,105	5.09

(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
親投資信託受益証券	99.81%
合計	99.81%

(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。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年12月18日)	6,547,046	6,547,046	0.7390	0.7390
第2計算期間末 (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 (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 (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 (平成24年12月18日)	54,675,911	54,675,911	0.8815	0.8815
第6計算期間末 (平成25年12月18日)	79,552,652	79,552,652	1.0892	1.0892
平成25年12月末日	81,742,998	-	1.1136	-
平成26年1月末日	82,207,036	-	1.0926	-
2月末日	85,375,139	-	1.1008	-
3月末日	84,641,465	-	1.1033	-
4月末日	87,060,130	-	1.1034	-
5月末日	85,992,761	-	1.1142	-



6月末日	91,177,711	-	1.1289	-
7月末日	96,264,124	-	1.1392	-
8月末日	103,348,234	-	1.1468	-
9月末日	107,535,435	-	1.1658	-
10月末日	110,195,901	-	1.1743	-
11月末日	116,742,243	-	1.2348	-
第7計算期間末 (平成26年12月18日)	119,842,748	119,842,748	1.2294	1.2294
12月末日	122,315,833	-	1.2493	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	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
第7計算期間	12.9

## (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

第7計算期間	34,165,971	9,720,098
--------	------------	-----------

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

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26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	126,183,238,990	99.18
内 日本	126,183,238,990	99.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,037,576,660	0.82
純資産総額	127,220,815,650	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)	928,950,000	0.73
内 日本	928,950,000	0.73

(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26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	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	845,800	6,494.00 5,492,625,200	7,558.00 6,392,556,400	5.02
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,850,500	628.45 3,048,326,670	664.50 3,223,157,250	2.53
3	ソフトバンク	日本	株式	情報・通 信業	320,400	8,686.17 2,783,049,790	7,210.00 2,310,084,000	1.82

4	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	456,400	4,463.00 2,036,913,200	4,375.00 1,996,750,000	1.57
5	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	550,700	3,756.00 2,068,429,200	3,526.00 1,941,768,200	1.53
6	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,331,000	200.44 1,669,929,388	202.50 1,687,027,500	1.33
7	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	205,100	6,663.09 1,366,600,444	7,637.00 1,566,348,700	1.23
8	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	236,800	6,836.00 1,618,764,800	6,211.00 1,470,764,800	1.16
9	キヤノン	日本	株式	電気機 器	354,900	3,591.00 1,274,445,900	3,840.50 1,362,993,450	1.07
10	日立	日本	株式	電気機 器	1,470,000	830.90 1,221,423,000	900.70 1,324,029,000	1.04
11	ファナック	日本	株式	電気機 器	63,800	19,320.00 1,232,616,000	19,945.00 1,272,491,000	1.00
12	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	378,000	3,614.50 1,366,281,000	3,328.00 1,257,984,000	0.99
13	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	730,800	1,600.50 1,169,645,400	1,686.50 1,232,494,200	0.97
14	武田薬品	日本	株式	医薬品	239,600	4,893.50 1,172,482,600	4,996.50 1,197,161,400	0.94
15	三菱地所	日本	株式	不動産 業	450,000	2,387.52 1,074,388,160	2,555.50 1,149,975,000	0.90
16	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	252,200	4,115.00 1,037,803,000	4,358.50 1,099,213,700	0.86
17	パナソニック	日本	株式	電気機 器	747,200	1,317.39 984,358,351	1,427.00 1,066,254,400	0.84
18	三井不動産	日本	株式	不動産 業	320,000	3,350.50 1,072,160,000	3,255.00 1,041,600,000	0.82
19	三菱商事	日本	株式	卸売業	461,300	2,312.50 1,066,756,250	2,217.00 1,022,702,100	0.80
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	111,700	8,109.00 905,775,300	9,123.00 1,019,039,100	0.80
21	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	54,800	14,535.00 796,518,000	18,140.00 994,072,000	0.78
22	東京海上HD	日本	株式	保険業	248,400	3,370.27 837,177,219	3,933.50 977,081,400	0.77
23	ソニー	日本	株式	電気機 器	394,800	1,937.64 764,980,552	2,472.50 976,143,000	0.77

24	日産自動車	日本	株式	輸送用 機器	859,200	1,076.50 924,928,800	1,057.00 908,174,400	0.71
25	信越化学	日本	株式	化学	115,000	7,150.00 822,250,000	7,866.00 904,590,000	0.71
26	富士重工業	日本	株式	輸送用 機器	208,900	3,371.00 704,201,900	4,300.00 898,270,000	0.71
27	三菱電機	日本	株式	電気機 器	612,000	1,430.50 875,466,000	1,446.00 884,952,000	0.70
28	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	497,600	1,909.50 950,167,200	1,768.00 879,756,800	0.69
29	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商 品先物 取引業	1,235,900	689.00 851,535,100	690.20 853,018,180	0.67
30	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	150,900	4,879.00 736,241,100	5,652.00 852,886,800	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	99.18%
合計	99.18%

(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	0.09%
鉱業	0.44%
建設業	2.70%
食料品	3.92%
繊維製品	0.79%
パルプ・紙	0.23%
化学	6.00%
医薬品	4.43%
石油・石炭製品	0.49%
ゴム製品	0.91%
ガラス・土石製品	0.94%
鉄鋼	1.57%
非鉄金属	0.97%
金属製品	0.65%

機械	5.26%
電気機器	12.96%
輸送用機器	11.88%
精密機器	1.45%
その他製品	1.37%
電気・ガス業	2.07%
陸運業	4.01%
海運業	0.33%
空運業	0.61%
倉庫・運輸関連業	0.22%
情報・通信業	6.66%
卸売業	4.08%
小売業	4.11%
銀行業	8.97%
証券、商品先物取引業	1.41%
保険業	2.42%
その他金融業	1.23%
不動産業	3.04%
サービス業	2.94%
合計	99.18%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2015年3月	買建	66	917,027,467	928,950,000	0.73%

(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。

#### 外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（平成26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	79,887,619,837	96.33
内 香港	1,011,348,931	1.22
内 シンガポール	501,063,859	0.60
内 イスラエル	200,839,122	0.24
内 ノルウェー	222,463,302	0.27
内 スウェーデン	1,043,357,989	1.26
内 デンマーク	511,353,016	0.62
内 イギリス	6,963,960,791	8.40
内 アイルランド	109,346,478	0.13
内 オランダ	917,973,204	1.11
内 ベルギー	439,446,358	0.53
内 フランス	3,170,680,058	3.82
内 ドイツ	3,107,843,002	3.75
内 スイス	3,142,869,287	3.79
内 ポルトガル	48,940,462	0.06
内 スペイン	1,181,019,348	1.42
内 イタリア	770,427,280	0.93
内 フィンランド	321,317,855	0.39
内 オーストリア	71,447,080	0.09
内 カナダ	3,531,181,846	4.26
内 アメリカ	50,260,080,307	60.61
内 オーストラリア	2,319,861,709	2.80
内 ニュージーランド	40,798,553	0.05
投資証券	1,819,360,000	2.19
内 香港	38,061,345	0.05
内 シンガポール	25,264,957	0.03
内 イギリス	116,327,246	0.14
内 オランダ	11,940,994	0.01
内 フランス	116,142,181	0.14
内 アメリカ	1,320,341,345	1.59
内 オーストラリア	191,281,932	0.23
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,221,278,371	1.47
純資産総額	82,928,258,208	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)	1,194,355,153	1.44
内 アメリカ	1,194,355,153	1.44

(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26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	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	130,300	14,337.01 1,868,112,598	13,731.85 1,789,260,120	2.16
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	92,655	10,914.59 1,011,291,985	11,219.58 1,039,550,972	1.25
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	171,000	5,763.49 985,557,731	5,720.09 978,136,673	1.18
4	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	61,500	13,049.53 802,546,556	12,697.53 780,898,187	0.94
5	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	107,972	6,567.56 709,113,020	6,715.84 725,122,730	0.87
6	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	217,900	3,193.36 695,835,214	3,098.13 675,083,617	0.81
7	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	生活必需品	59,237	10,901.33 645,762,470	11,167.75 661,544,125	0.80
8	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	71,650	8,836.59 633,141,674	8,921.85 639,250,553	0.77
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	81,720	7,252.28 592,656,975	7,589.82 620,240,744	0.75
10	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	51,300	11,388.30 584,219,790	11,321.31 580,783,203	0.70
11	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	41,118	13,124.27 539,644,083	13,660.72 561,701,732	0.68

12	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	138,463	3,755.13 519,946,911	3,784.06 523,952,923	0.63
13	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	15,750	35,248.92 555,170,490	32,886.00 517,954,500	0.62
14	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	90,254	6,098.62 550,425,256	5,732.15 517,349,692	0.62
15	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	230,201	2,054.17 472,872,449	2,183.16 502,565,730	0.61
16	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	425,300	1,191.38 506,694,382	1,159.39 493,092,382	0.59
17	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,200	4,490.48 481,380,260	4,482.04 480,475,653	0.58
18	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	112,195	4,265.05 478,518,295	4,111.96 461,341,408	0.56
19	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	24,900	17,924.57 446,322,030	18,329.62 456,407,725	0.55
20	COCA-COLA CO	アメリカ	株式	生活必需品	86,400	5,404.25 466,927,762	5,166.77 446,409,187	0.54
21	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	66,123	6,506.08 430,201,759	6,597.70 436,259,816	0.53
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	62,421	7,281.22 454,501,034	6,959.35 434,409,680	0.52
23	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	77,283	5,112.52 395,111,308	5,498.28 424,923,998	0.51
24	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	43,100	9,366.73 403,706,279	9,646.41 415,760,314	0.50
25	WALT DISNEY CO	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	35,600	11,152.08 397,014,066	11,512.52 409,845,890	0.49
26	GOOGLE INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	6,300	65,317.60 411,500,921	63,931.28 402,767,073	0.49
27	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,200	66,191.59 410,387,883	64,772.72 401,590,867	0.48
28	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	20,600	19,549.59 402,721,626	19,349.48 398,599,298	0.48
29	GILEAD SCIENCES INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	33,000	12,093.57 399,088,008	11,729.51 387,073,995	0.47



30	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	32,800	12,067.05 395,799,404	11,660.80 382,474,289	0.46
----	-------------	------	----	-------	--------	--------------------------	--------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.33%
投資証券	2.19%
合計	98.53%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	8.39%
素材	5.05%
資本財・サービス	10.08%
一般消費財・サービス	11.21%
生活必需品	10.06%
ヘルスケア	13.03%
金融	18.49%
情報技術	13.36%
電気通信サービス	3.11%
公益事業	3.47%
その他	0.09%
合計	96.33%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 2015年3月	買建	19	1,139,740,517	1,194,355,153	1.44%

(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。

## ダイワJ - REITマザーファンド

### (1) 投資状況（平成26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	176,454,206,300	99.19
内 日本	176,454,206,300	99.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,436,061,409	0.81
純資産総額	177,890,267,709	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26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	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	23,760	549,216.18 13,049,376,634	604,000.00 14,351,040,000	8.07
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	21,059	535,272.30 11,272,299,533	580,000.00 12,214,220,000	6.87
3	日本リテールファンド	日本	投資証券	40,893	209,946.83 8,585,356,057	254,000.00 10,386,822,000	5.84
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	44,293	164,632.21 7,292,054,832	188,900.00 8,366,947,700	4.70
5	日本プロロジスリート	日本	投資証券	29,123	255,467.96 7,439,993,541	260,600.00 7,589,453,800	4.27
6	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	21,875	250,020.75 5,469,204,059	321,000.00 7,021,875,000	3.95
7	オリックス不動産投資	日本	投資証券	35,688	132,301.86 4,721,588,899	168,800.00 6,024,134,400	3.39

8	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	13,882	377,126.08 5,235,264,353	418,000.00 5,802,676,000	3.26
9	GLP投資法人	日本	投資証券	40,229	127,075.66 5,112,126,862	133,600.00 5,374,594,400	3.02
10	森トラスト総合リート	日本	投資証券	22,212	192,082.71 4,266,541,341	241,000.00 5,353,092,000	3.01
11	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	7,421	564,492.96 4,189,102,266	673,000.00 4,994,333,000	2.81
12	API投資法人	日本	投資証券	4,609	922,751.10 4,252,959,865	1,046,000.00 4,821,014,000	2.71
13	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	8,346	524,859.51 4,380,477,509	550,000.00 4,590,300,000	2.58
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	6,776	572,810.19 3,881,361,855	677,000.00 4,587,352,000	2.58
15	森ヒルズリート	日本	投資証券	26,419	145,870.29 3,853,747,442	172,400.00 4,554,635,600	2.56
16	NMF投資法人	日本	投資証券	28,021	137,283.29 3,846,815,243	155,600.00 4,360,067,600	2.45
17	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	13,966	241,488.51 3,372,628,618	269,500.00 3,763,837,000	2.12
18	野村不動産オフィスF	日本	投資証券	6,269	486,126.88 3,047,529,449	595,000.00 3,730,055,000	2.10
19	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	7,764	379,134.02 2,943,596,573	474,500.00 3,684,018,000	2.07
20	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	6,291	454,627.02 2,860,058,634	580,000.00 3,648,780,000	2.05
21	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	46,969	62,892.87 2,954,015,581	77,000.00 3,616,613,000	2.03
22	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	20,407	138,021.51 2,816,605,095	160,500.00 3,275,323,500	1.84
23	産業ファンド	日本	投資証券	5,570	474,196.23 2,641,273,045	555,000.00 3,091,350,000	1.74
24	大和ハウスリート	日本	投資証券	4,938	475,081.95 2,345,954,726	600,000.00 2,962,800,000	1.67
25	イオンリート投資	日本	投資証券	15,986	144,976.16 2,317,588,937	170,400.00 2,724,014,400	1.53
26	東急リアル・エステート	日本	投資証券	16,450	148,051.70 2,435,450,538	163,600.00 2,691,220,000	1.51
27	福岡リート投資法人	日本	投資証券	11,611	200,053.52 2,322,821,506	222,900.00 2,588,091,900	1.45

28	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	24,821	77,086.57 1,913,365,767	98,900.00 2,454,796,900	1.38
29	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	13,142	172,233.53 2,263,493,172	182,100.00 2,393,158,200	1.35
30	積水ハウス・SIレジデンシャル投資法人	日本	投資証券	17,132	109,046.46 1,868,184,058	136,200.00 2,333,378,400	1.31

(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	99.19%
合計	99.19%

(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。

#### 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26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	2,198,822,033	98.73
内 ガーンジィ	1,483,335	0.07
内 マン島	1,662,472	0.07
内 香港	38,343,708	1.72
内 シンガポール	72,228,147	3.24
内 イスラエル	704,841	0.03
内 イギリス	138,850,709	6.23
内 アイルランド	4,534,974	0.20

内 オランダ	23,148,502	1.04
内 ベルギー	10,968,093	0.49
内 フランス	95,866,872	4.30
内 ドイツ	2,854,079	0.13
内 スペイン	5,135,567	0.23
内 イタリア	1,916,524	0.09
内 カナダ	49,581,674	2.23
内 アメリカ	1,565,257,537	70.28
内 オーストラリア	179,649,788	8.07
内 ニューージーランド	6,635,211	0.30
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	28,222,034	1.27
純資産総額	2,227,044,067	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26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	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	5,747	21,817.38 125,384,971	22,483.78 129,214,287	5.80
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	2,700	22,606.37 61,037,238	22,826.14 61,630,585	2.77
3	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	6,600	8,547.11 56,411,493	8,889.35 58,669,756	2.63
4	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	1,800	31,123.77 56,022,893	31,550.06 56,790,112	2.55
5	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	6,000	8,901.41 53,408,713	9,236.54 55,419,246	2.49
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	2,400	19,414.45 46,594,745	20,184.89 48,443,741	2.18
7	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	9,146	5,100.83 46,652,353	5,245.13 47,971,964	2.15
8	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	5,379	8,632.94 46,437,240	8,770.01 47,173,897	2.12

9	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	3,164	13,454.22 42,569,441	14,357.50 45,427,146	2.04
10	HCP INC	アメリカ	投資証券	8,400	5,402.08 45,378,516	5,374.11 45,142,600	2.03
11	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	2,800	15,659.20 43,846,084	15,761.91 44,133,355	1.98
12	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	13,900	2,805.80 39,001,180	2,910.07 40,450,070	1.82
13	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	11,477	3,233.15 37,106,920	3,454.96 39,652,610	1.78
14	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	97,011	340.69 33,056,023	356.97 34,630,482	1.55
15	WESTFIELD CORP	オーストラリア	投資証券	35,000	816.92 28,594,683	919.89 32,196,381	1.45
16	LINK REIT	香港	投資証券	42,000	766.99 32,214,249	753.69 31,654,980	1.42
17	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	14,300	2,220.23 31,751,369	2,163.93 30,944,301	1.39
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	1,167	24,443.44 28,525,562	25,496.32 29,754,211	1.34
19	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	18,750	1,436.57 26,936,072	1,461.63 27,405,740	1.23
20	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	1,800	14,049.62 25,289,341	14,655.26 26,379,474	1.18
21	MACERICH CO	アメリカ	投資証券	2,600	9,557.80 24,850,298	10,126.20 26,328,120	1.18
22	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	4,117	5,608.46 23,090,366	5,975.66 24,601,807	1.10
23	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	7,500	3,068.47 23,014,080	3,122.24 23,416,838	1.05
24	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	2,500	8,445.25 21,113,248	8,100.96 20,252,400	0.91
25	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	1,200	15,992.16 19,190,596	16,537.04 19,844,459	0.89
26	UDR INC	アメリカ	投資証券	4,700	3,715.35 17,462,511	3,806.96 17,892,754	0.80
27	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	43,000	404.53 17,395,580	412.87 17,753,612	0.80
28	AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	アメリカ	投資証券	16,608	1,127.98 18,734,468	1,022.26 16,977,761	0.76

29	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	28,000	535.95 15,008,849	591.36 16,558,139	0.74
30	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	14,400	1,163.70 16,759,412	1,139.01 16,401,783	0.74

(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	98.73%
合計	98.73%

(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。

#### 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26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	10,369,352,910	70.16
内 日本	10,369,352,910	70.16
地方債証券	1,572,996,288	10.64
内 日本	1,572,996,288	10.64
特殊債券	1,402,359,500	9.49
内 日本	1,402,359,500	9.49
社債券	1,340,959,306	9.07
内 日本	1,340,959,306	9.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	93,614,324	0.63
純資産総額	14,779,282,328	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26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	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	333 10年国債	日本	国債証券	172,000,000	101.97 175,395,240	103.05 177,252,880	0.600000 2024/03/20	1.20
2	334 10年国債	日本	国債証券	165,000,000	101.88 168,110,250	102.94 169,860,900	0.600000 2024/06/20	1.15
3	116 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.60 150,905,500	100.81 151,215,000	0.200000 2018/12/20	1.02
4	332 10年国債	日本	国債証券	145,000,000	102.10 148,047,140	103.15 149,574,750	0.600000 2023/12/20	1.01
5	325 10年国債	日本	国債証券	142,000,000	104.12 147,858,920	104.95 149,029,000	0.800000 2022/09/20	1.01
6	335 10年国債	日本	国債証券	146,000,000	100.75 147,097,400	101.88 148,752,100	0.500000 2024/09/20	1.01
7	19 - 1 広島県公債	日本	地方債証券	110,800,000	104.27 115,535,370	104.07 115,319,088	1.780000 2017/05/25	0.78
8	307 10年国債	日本	国債証券	108,000,000	106.37 114,890,000	106.64 115,180,920	1.300000 2020/03/20	0.78
9	117 5年国債	日本	国債証券	112,000,000	100.57 112,644,000	100.84 112,940,800	0.200000 2019/03/20	0.76
10	21 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.09 107,097,200	107.24 107,247,100	1.570000 2019/11/25	0.73
11	5 日本政策投資CO	日本	特殊債券	100,000,000	106.92 106,927,000	107.04 107,044,900	1.745000 2019/03/20	0.72
12	308 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	106.58 106,588,000	106.97 106,971,000	1.300000 2020/06/20	0.72
13	21 - 2 埼玉県公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.50 106,508,700	106.62 106,626,700	1.570000 2019/05/27	0.72
14	15 NTTドコモ	日本	社債券	100,000,000	106.49 106,498,000	106.46 106,467,300	1.960000 2018/06/20	0.72
15	305 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	106.05 106,052,000	106.30 106,307,000	1.300000 2019/12/20	0.72



16	70 東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	105.66 105,665,100	106.10 106,109,500	1.193000 2020/09/29	0.72
17	76 共同発行地方	日本	地方債 証券	100,000,000	105.90 105,909,200	106.06 106,069,800	1.400000 2019/07/25	0.72
18	2 政保地方公営機	日本	特殊債 券	100,000,000	106.01 106,016,100	106.02 106,022,400	1.600000 2018/11/16	0.72
19	20 - 6 北海道公債	日本	地方債 証券	100,000,000	106.00 106,005,400	106.00 106,009,100	1.720000 2018/08/29	0.72
20	33 中日本高速道	日本	社債券	100,000,000	105.38 105,388,200	105.96 105,963,400	1.084000 2021/09/17	0.72
21	324 10年国債	日本	国債証 券	101,000,000	104.15 105,191,500	104.90 105,955,060	0.800000 2022/06/20	0.72
22	319 10年国債	日本	国債証 券	99,000,000	106.29 105,227,100	106.97 105,909,210	1.100000 2021/12/20	0.72
23	30 国際協力銀行	日本	特殊債 券	100,000,000	105.88 105,885,500	105.79 105,795,000	1.870000 2018/03/20	0.72
24	28 公営企業	日本	特殊債 券	100,000,000	105.22 105,222,200	105.08 105,088,200	1.890000 2017/10/25	0.71
25	122 政保道路機構	日本	特殊債 券	100,000,000	104.43 104,433,000	104.88 104,884,700	0.900000 2020/11/30	0.71
26	378 東北電力	日本	社債券	100,000,000	105.13 105,132,600	104.83 104,831,800	3.850000 2016/04/25	0.71
27	4 成田国際空港	日本	社債券	100,000,000	104.77 104,772,700	104.71 104,717,200	1.700000 2017/12/20	0.71
28	19 - 2 静岡県公債	日本	地方債 証券	100,000,000	104.82 104,822,200	104.64 104,640,900	1.930000 2017/06/28	0.71
29	56 政保道路機構	日本	特殊債 券	100,000,000	104.54 104,549,400	104.46 104,468,000	1.400000 2018/04/20	0.71
30	653 東京都公債	日本	地方債 証券	100,000,000	104.52 104,524,700	104.41 104,416,400	1.540000 2017/12/20	0.71

(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
国債証券	70.16%
地方債証券	10.64%
特殊債券	9.49%
社債券	9.07%
合計	99.37%

(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。

#### 外国債券インデックスマザーファンド

#### (1) 投資状況（平成26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	168,520,564,587	98.09
内 ユーロ	72,057,941,400	41.94
内 シンガポール	644,898,666	0.38
内 マレーシア	850,426,837	0.49
内 ノルウェー	471,492,142	0.27
内 スウェーデン	834,772,879	0.49
内 デンマーク	1,264,801,485	0.74
内 イギリス	14,256,353,017	8.30
内 スイス	482,129,023	0.28
内 ポーランド	1,065,745,287	0.62
内 カナダ	3,859,882,784	2.25
内 アメリカ	67,302,198,002	39.17
内 メキシコ	1,704,306,473	0.99
内 南アフリカ	894,250,554	0.52
内 オーストラリア	2,831,366,038	1.65
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,288,952,897	1.91
純資産総額	171,809,517,484	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)		1,038,251,849	0.60
	内 日本	1,038,251,849	0.60

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

(注2) 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26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	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,694,000	101.85 821,963,118	101.50 819,066,125	2.375000 2024/08/15	0.48
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,275,000	105.33 796,807,924	104.87 793,328,248	2.750000 2024/02/15	0.46
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	4,377,000	118.77 761,803,821	119.25 764,876,154	3.250000 2021/10/25	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,410,000	99.51 769,008,690	98.91 764,333,701	0.625000 2017/08/31	0.44
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,630,000	110.52 750,115,732	109.36 742,270,001	3.625000 2020/02/15	0.43
6	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証 券	4,052,000	114.10 677,503,071	113.61 674,617,300	4.250000 2019/02/01	0.39
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,660,000	99.27 677,379,877	98.74 673,756,794	0.500000 2017/07/31	0.39
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,412,000	103.09 672,595,845	102.65 669,744,784	2.500000 2024/05/15	0.39
9	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証 券	3,118,000	142.22 649,824,417	143.93 657,669,591	6.000000 2031/05/01	0.38
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,590,000	117.15 616,322,123	117.37 617,468,974	3.500000 2020/04/25	0.36
11	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,507,000	164.05 602,705,683	166.65 612,261,127	5.750000 2032/10/25	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,058,000	100.19 610,906,507	99.96 609,522,392	0.375000 2016/03/31	0.35

13	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,222,000	100.69 606,768,673	100.91 608,094,417	1.250000 2018/07/22	0.35
14	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	3,598,000	115.25 607,693,592	114.81 605,368,416	4.250000 2019/09/01	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,774,000	105.42 606,703,863	104.90 603,740,009	2.750000 2023/11/15	0.35
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,123,000	129.94 594,663,159	130.99 599,468,425	4.250000 2023/10/25	0.35
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	153.20 588,896,205	155.28 596,868,130	5.500000 2029/04/25	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,635,000	106.10 592,860,891	105.44 589,150,796	3.250000 2017/03/31	0.34
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	124.84 575,530,926	126.39 582,699,707	3.500000 2026/04/25	0.34
20	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,722,000	143.73 573,344,836	144.87 577,876,134	6.500000 2027/11/01	0.34
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,230,000	121.14 573,408,602	121.40 574,639,245	3.750000 2021/04/25	0.33
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	105.08 571,199,973	104.10 565,851,343	2.625000 2020/11/15	0.33
23	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,922,000	102.15 558,251,445	102.41 559,672,350	1.750000 2019/07/22	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,468,000	103.46 557,253,562	102.86 554,059,560	2.500000 2023/08/15	0.32
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	97.62 551,363,302	97.03 548,053,710	1.750000 2023/05/15	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,502,000	101.10 548,713,112	100.67 546,357,725	1.000000 2016/08/31	0.32
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,365,000	153.00 530,278,854	156.69 543,067,180	4.500000 2041/04/25	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,076,000	110.97 545,293,671	109.84 539,726,541	3.625000 2021/02/15	0.31
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,522,000	104.55 539,602,222	104.33 538,477,094	3.250000 2016/04/25	0.31
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,075,000	117.90 531,278,791	117.91 531,341,877	4.250000 2019/04/25	0.31

(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
国債証券	98.09%
合計	98.09%

(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

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2015年1月	買建	810,000	149,713,813	151,470,000	0.09%
		米ドル買/円売 2015年1月	買建	2,865,000	337,619,078	345,318,450	0.20%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2015年1月	買建	255,000	4,286,550	4,120,800	0.00%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2015年1月	買建	280,000	9,886,800	9,550,800	0.01%
		豪ドル買/円売 2015年1月	買建	252,000	25,252,920	24,696,000	0.01%
		ユーロ買/円売 2015年1月	買建	2,642,000	387,601,634	387,132,260	0.23%
		シンガポール・ドル買/円売 2015年1月	買建	64,000	5,806,720	5,831,040	0.00%
		スイス・フラン買/円売 2015年1月	買建	42,000	5,159,280	5,115,600	0.00%
		メキシコ・ペソ買/円売 2015年1月	買建	2,037,000	17,334,869	16,621,919	0.01%
		デンマーク・クローネ買/円売 2015年1月	買建	564,000	11,201,040	11,099,520	0.01%
南アフリカ・ランド買/円売 2015年1月	買建	784,000	8,333,920	8,122,240	0.00%		

スウェーデン・クローネ 買/円売 2015年1月	買建	482,000	7,663,800	7,427,620	0.00%
カナダ・ドル買/円売 2015年1月	買建	596,000	60,930,445	61,745,600	0.04%

(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。

## (参考情報) 運用実績

2014年12月30日現在

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

### 基準価額・純資産の推移

基準価額	12,493円
純資産総額	1.2億円

### 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.2%
3カ月間	7.2%
6カ月間	10.7%
1年間	12.2%
3年間	60.1%
5年間	51.2%
設定来	24.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

### 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期			
	08年12月	09年12月	10年12月	11年12月	12年12月	13年12月	14年12月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

### 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
国内債券	286	40.6%	日本円	61.9%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	0.8%
外国債券	715	21.4%	米ドル	19.3%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%
国内株式・先物	1,304	15.8%	ユーロ	11.1%	修正デュレーション	ソフトバンク	日本	0.3%
外国株式・先物	1,203	10.9%	英ポンド	3.1%	残存年数	三井住友フィナンシャルG	日本	0.2%
外国リート	303	5.3%	豪ドル	1.1%	債券格付別構成	本田技研	日本	0.2%
国内リート	48	5.1%	カナダ・ドル	1.1%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.4%
			スイス・フラン	0.5%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
			シンガポール・ドル	0.3%	A	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.3%
			スウェーデン・クローネ	0.3%	BBB	日本リテールファンド	日本	0.3%
コール・ローン、その他		1.3%	その他	1.2%	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	3,859	-	合計	100.0%	合計	合計		3.6%

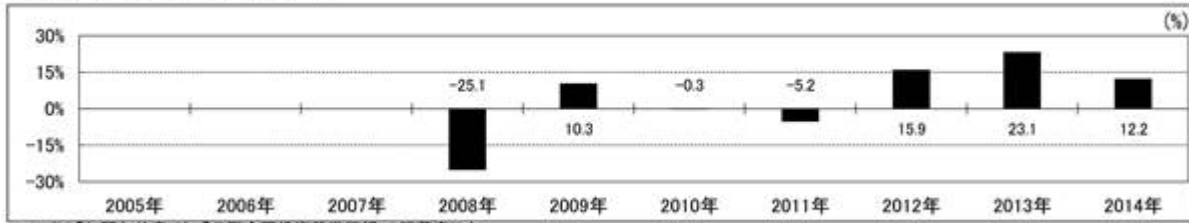
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.3%保有しております。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

**年間収益率の推移**

当ファンド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、2014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け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

### 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い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

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

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

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

## (4) 【計算期間】

毎年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。）を行います。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使することができる受益者の議決権の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ます。
2. 委託会社は、前1. の事項(前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。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、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、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使することができる受益者の議決権の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であっても、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。

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2. の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

#### 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てします。）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7期計算期間（平成25年12月19日から平成26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

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 平成25年12月18日現在	第7期 平成26年12月18日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	379,898	604,159
親投資信託受益証券	79,435,769	119,609,189
流動資産合計	79,815,667	120,213,348
資産合計	79,815,667	120,213,348
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	21,688	520
未払受託者報酬	18,323	28,111
未払委託者報酬	220,319	337,830
その他未払費用	2,685	4,139
流動負債合計	263,015	370,600
負債合計	263,015	370,600
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 73,034,878	1 97,480,751
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,517,774	22,361,997
（分配準備積立金）	16,029,492	26,194,156
元本等合計	79,552,652	119,842,748
純資産合計	79,552,652	119,842,748
負債純資産合計	79,815,667	120,213,348

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自 至	平成24年12月19日 平成25年12月18日	自 至	平成25年12月19日 平成26年12月18日
営業収益				
受取利息		1		15
有価証券売買等損益		14,102,110		12,921,420
営業収益合計		14,102,111		12,921,435
営業費用				
受託者報酬		34,750		50,413
委託者報酬		417,891		605,895
その他費用		5,068		7,435
営業費用合計		457,709		663,743
営業利益		13,644,402		12,257,692
経常利益		13,644,402		12,257,692
当期純利益		13,644,402		12,257,692
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		1,735,080		251,202
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		7,351,616		6,517,774
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,960,068		4,733,292
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		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		4,733,292
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		895,559
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		895,559
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,517,774		22,361,997



## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第7期	
	自 平成25年12月19日	至 平成26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  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第6期	第7期
	平成25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1. 1 期首元本額	62,027,527円	73,034,878円
期中追加設定元本額	22,032,793円	34,165,971円
期中一部解約元本額	11,025,442円	9,720,098円
2. 計算期間末日における受益権の総数	73,034,878口	97,480,751口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第6期	第7期
	自 平成24年12月19日 至 平成25年12月18日	自 平成25年12月19日 至 平成26年12月18日

<p>1 分配金の計算過程</p>	<p>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。</p>	<p>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(15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(12,006,475円)、投資信託約款に規定される収益調整金(11,388,836円)及び分配準備積立金(14,187,666円)より分配可能額は37,582,992円(1万口当たり3,855.43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。</p>
-------------------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第7期 自 平成25年12月19日 至 平成26年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第7期 平成26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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第6期 平成25年12月18日現在	第7期 平成26年12月18日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	11,654,416	12,428,011
合計	11,654,416	12,428,011

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第6期 平成25年12月18日現在	第7期 平成26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7期 自 平成25年12月19日 至 平成26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なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第6期 平成25年12月18日現在	第7期 平成26年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0892円 (10,892円)	1.2294円 (12,294円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	トピックス・インデックス・マザー ファンド	23,270,973	18,702,881	
	外国株式インデックスマザーファンド	6,644,893	12,814,011	
	外国債券インデックスマザーファンド	8,991,257	26,307,518	
	ダイワJ-REITマザーファンド	2,569,321	5,991,399	
	ダイワ・グローバルREITインデッ クス・マザーファンド	2,906,582	6,034,064	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	40,998,036	49,759,316	
親投資信託受益証券 合計			119,609,189	
合計			119,609,189	

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」-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。

#### 「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25年12月18日現在	平成26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	813,122,476	7,421,236,884
株式	3 4 122,192,491,830	123,389,464,940
新株予約権証券	4,926,600	-
派生商品評価勘定	1,537,912	483,644
未収入金	-	478,864,804
未収配当金	9,620,800	9,381,600
前払金	10,362,000	9,622,000
その他未収収益	5 -	1,697,749
流動資産合計	123,032,061,618	131,310,751,621
資産合計	123,032,061,618	131,310,751,621
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,311,636	2,904,890
未払金	74,472	-
未払解約金	157,055,000	305,769,000
未払利息	-	98,998
受入担保金	-	6,857,039,962
流動負債合計	159,441,108	7,165,812,850
負債合計	159,441,108	7,165,812,850
純資産の部		
元本等		
元本	1 171,609,857,377	154,467,311,877
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金( ) 2	48,737,236,867	30,322,373,106
元本等合計	122,872,620,510	124,144,938,771
純資産合計	122,872,620,510	124,144,938,771
負債純資産合計	123,032,061,618	131,310,751,621

## 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25年12月19日 至 平成26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 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1. 1期首	平成24年12月19日	平成25年12月19日
期首元本額	201,568,942,984円	171,609,857,377円
期中追加設定元本額	11,801,971,044円	13,187,877,997円
期中一部解約元本額	41,761,056,651円	30,330,423,497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	1,686,119,625円	1,649,409,274円
トピックス・インデックス ファンド	7,801,545,233円	6,799,224,936円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	23,541,978,090円	20,401,008,490円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドVA2	477,790,435円	274,800,617円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	287,060,542円	249,489,300円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	5,175,338,703円	4,326,565,713円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	244,600,824円	199,440,727円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	7,135,925,294円	5,935,437,422円
D-I's TOPIXイン デックス	1,412,946円	35,691,598円
DCダイワ日本株式インデッ クス	62,724,250,286円	60,845,884,388円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,045,924,864円	1,942,655,572円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	1,870,921,154円	2,042,621,516円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,563,316,437円	1,761,462,103円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	2,485,672,271円	3,006,891,356円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	18,876,528円	23,270,973円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	32,799,580円	43,530,576円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,988,897円	7,351,546円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	319,467,877円	22,104,793円

ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	2,367,033,356円	73,545,755円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	1,314,872,463円	46,472,829円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	78,438,955円	71,973,936円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	547,366,846円	418,068,986円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	241,641,491円	209,986,836円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	2,677,705,786円	2,200,146,307円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	406,782,366円	324,009,634円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	23,110,940,440円	20,172,386,365円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	1,097,967,765円	544,222,851円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	2,455,360,976円	1,167,273,856円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,900,887,857円	1,582,483,719円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	347,684,741円	315,436,365円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	429,784,645円	371,813,191円
ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,408,882円	412,144,225円
ダイワライフスタイル25	178,321,453円	183,464,107円
ダイワライフスタイル50	560,453,041円	604,648,931円
ダイワライフスタイル75	445,868,405円	468,534,417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)	16,028,348,323円	15,733,858,667円
計	171,609,857,377円	154,467,311,877円
2. 期末日における受益権の総数	171,609,857,377口	154,467,311,877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48,737,236,867円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は30,322,373,106円であります。
4.	3 貸付有価証券		株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 6,633,741,300円
5.	4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 1,009,400,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 725,000,000円
6.	5 その他未収収益		貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分1,069,300円が含まれております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成25年12月19日 至 平成26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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成25年12月18日現在	平成26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）
株式	3,419,546,418	4,140,446,818
新株予約権証券	4,926,600	-
合計	3,424,473,018	4,140,446,818

（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25年9月20日から平成25年12月18日まで、及び平成26年9月20日から平成26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25年12月18日 現在			平成26年12月18日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
	（円）			うち		
		（円）	（円）		（円）	（円）

		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	664,671,000	-	664,090,000	581,000	887,272,000	-	885,120,000	2,152,000
合計	664,671,000	-	664,090,000	581,000	887,272,000	-	885,120,000	2,152,000

## (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25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1口当たり純資産額	0.7160円	0.8037円
(1万口当たり純資産額)	(7,160円)	(8,037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	40,000	267.00	10,680,000	
日本水産	89,800	388.00	34,842,400	
マルハニチロ	16,200	1,721.00	27,880,200	
サカタのタネ	11,000	1,895.00	20,845,000	
ホクト	8,700	1,947.00	16,938,900	
ショーボンドHD	6,200	4,685.00	29,047,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
ミライト・ホールディングス	22,000	1,363.00	29,986,000	
日鉄鉱業	24,000	410.00	9,840,000	
三井松島	66,000	124.00	8,184,000	
国際石油開発帝石	361,300	1,286.00	464,631,800	

日本海洋掘削	2,400	3,955.00	9,492,000	貸付株式数 700株 (700株)
石油資源開発	9,600	3,580.00	34,368,000	
K & O エナジーグループ	5,600	1,418.00	7,940,800	
安藤・間	47,200	736.00	34,739,200	
東急建設	26,100	532.00	13,885,200	
コムシスホールディングス	31,300	1,720.00	53,836,000	
ミサワホーム	9,500	1,004.00	9,538,000	
高松コンストラクションG P	5,800	2,330.00	13,514,000	
東建コーポレーション	2,800	4,795.00	13,426,000	
大成建設	347,000	656.00	227,632,000	
大 林 組	207,000	758.00	156,906,000	
清水建設	211,000	811.00	171,121,000	貸付株式数 61,000株 (61,000株)
飛島建設	48,400	277.00	13,406,800	貸付株式数 14,300株 (14,300株)
長谷工コーポレーション	86,400	952.00	82,252,800	
松井建設	12,000	538.00	6,456,000	
鹿島建設	304,000	491.00	149,264,000	
不動産トラ	55,300	237.00	13,106,100	
鉄建建設	44,000	466.00	20,504,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
日鉄住金テックスエンジ	16,000	519.00	8,304,000	
西松建設	76,000	477.00	36,252,000	
三井住友建設	283,700	132.00	37,448,400	
大豊建設	21,000	510.00	10,710,000	貸付株式数 6,000株
前田建設	47,000	962.00	45,214,000	貸付株式数 13,000株 (4,000株)
奥 村 組	67,000	534.00	35,778,000	
東鉄工業	8,600	2,659.00	22,867,400	
戸田建設	88,000	460.00	40,480,000	貸付株式数 24,000株 (24,000株)
熊 谷 組	88,000	369.00	32,472,000	貸付株式数 22,000株
北野建設	20,000	385.00	7,700,000	
三井ホーム	17,000	492.00	8,364,000	
矢作建設	10,700	929.00	9,940,300	
東日本ハウス	14,400	500.00	7,200,000	
大東建託	25,800	12,960.00	334,368,000	
N I P P O	16,000	1,961.00	31,376,000	
東亜道路	16,000	455.00	7,280,000	

前田道路	21,000	1,730.00	36,330,000	
日本道路	23,000	587.00	13,501,000	
東亜建設	59,000	196.00	11,564,000	
若築建設	44,000	196.00	8,624,000	
東洋建設	21,000	478.00	10,038,000	
五洋建設	79,500	375.00	29,812,500	貸付株式数 23,100株 (23,100株)
大林道路	9,000	756.00	6,804,000	
世紀東急	12,300	603.00	7,416,900	
福田組	11,000	977.00	10,747,000	
住友林業	50,600	1,178.00	59,606,800	
日成ビルド工業	24,000	277.00	6,648,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
ヤマダ・エスバイエルホーム	52,000	94.00	4,888,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
巴コーポレーション	15,100	443.00	6,689,300	
パナホーム	26,000	760.00	19,760,000	
大和ハウス	201,100	2,219.00	446,240,900	貸付株式数 57,800株 (57,800株)
ライト工業	11,900	991.00	11,792,900	
積水ハウス	210,900	1,557.50	328,476,750	貸付株式数 50,000株 (50,000株)
日特建設	11,300	496.00	5,604,800	
ユアテック	13,000	702.00	9,126,000	
中電工	10,500	1,808.00	18,984,000	
関電工	33,000	687.00	22,671,000	
きんでん	45,000	1,196.00	53,820,000	
トーエネック	14,000	585.00	8,190,000	
住友電設	6,500	1,464.00	9,516,000	
日本電設工業	12,200	1,480.00	18,056,000	
協和エクシオ	28,800	1,319.00	37,987,200	
日本工営	25,000	479.00	11,975,000	
九電工	14,000	1,311.00	18,354,000	
三機工業	17,000	772.00	13,124,000	
日揮	69,000	2,510.00	173,190,000	
中外炉工業	32,000	269.00	8,608,000	
太平電業	11,000	929.00	10,219,000	
高砂熱学	20,200	1,520.00	30,704,000	
NEC ネットズエスアイ	8,000	2,397.00	19,176,000	
明星工業	14,000	730.00	10,220,000	

大 気 社	10,300	2,650.00	27,295,000	
ダイダン	13,000	678.00	8,814,000	
日比谷総合設備	9,800	1,609.00	15,768,200	
東芝プラントシステム	10,800	1,841.00	19,882,800	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
日本製粉	43,000	518.00	22,274,000	
日清製粉G本社	75,400	1,166.00	87,916,400	
昭和産業	33,000	455.00	15,015,000	
フィード・ワンHLDGS	76,400	108.00	8,251,200	
日本甜菜糖	52,000	206.00	10,712,000	
三井製糖	30,000	393.00	11,790,000	
ネクスト	9,300	898.00	8,351,400	
日本M&Aセンター	10,400	3,495.00	36,348,000	
アコーディア・ゴルフ	25,700	1,041.00	26,753,700	
タケエイ	8,400	920.00	7,728,000	
GCAサヴィアン	6,500	1,144.00	7,436,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
エス・エム・エス	4,000	2,637.00	10,548,000	
テンプホールディングス	12,900	3,590.00	46,311,000	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
クックパッド	3,500	4,080.00	14,280,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
森永製菓	72,000	302.00	21,744,000	
中 村 屋	27,000	452.00	12,204,000	
江崎グリコ	16,000	4,175.00	66,800,000	
不 二 家	48,000	199.00	9,552,000	貸付株式数 13,000株
山崎製パン	50,000	1,491.00	74,550,000	
モロゾフ	24,000	360.00	8,640,000	
亀田製菓	4,200	3,610.00	15,162,000	
寿スピリッツ	2,700	2,201.00	5,942,700	
カルビー	25,300	4,245.00	107,398,500	
森永乳業	65,000	396.00	25,740,000	
ヤクルト	36,500	6,220.00	227,030,000	貸付株式数 10,500株 (10,500株)
明治ホールディングス	20,400	10,730.00	218,892,000	貸付株式数 5,800株 (5,800株)
雪印メグミルク	16,300	1,405.00	22,901,500	
プリマハム	45,000	268.00	12,060,000	
日本ハム	51,000	2,477.00	126,327,000	
伊藤ハム	39,000	632.00	24,648,000	

丸大食品	39,000	413.00	16,107,000	
S Foods	5,000	2,348.00	11,740,000	
スタジオアリス	4,400	1,628.00	7,163,200	貸付株式数 1,300株
シミックホールディングス	3,600	1,651.00	5,943,600	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
システナ	10,400	841.00	8,746,400	
新日鉄住金SOL	5,700	3,060.00	17,442,000	
総合警備保障	21,500	2,677.00	57,555,500	
日本駐車場開発	84,400	118.00	9,959,200	
カカクコム	43,400	1,784.00	77,425,600	貸付株式数 12,000株
ディップ	1,800	4,615.00	8,307,000	
SBSホールディングス	5,900	1,009.00	5,953,100	
新日本科学	7,900	766.00	6,051,400	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ツクイ	9,100	963.00	8,763,300	
エムスリー	55,900	2,028.00	113,365,200	
ツカダ・グローバルHOLD	6,600	775.00	5,115,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
ディー・エヌ・エー	32,100	1,476.00	47,379,600	貸付株式数 10,400株
博報堂DYHLDGS	89,200	1,150.00	102,580,000	
ぐるなび	8,600	1,604.00	13,794,400	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
一休	6,300	1,336.00	8,416,800	
ファンコミュニケーションズ	12,000	1,398.00	16,776,000	貸付株式数 3,100株
PGMホールディングス	11,300	1,097.00	12,396,100	
サッポロホールディングス	118,000	522.00	61,596,000	
アサヒグループホールディング	137,500	3,724.00	512,050,000	
キリンHD	291,900	1,481.00	432,303,900	
宝ホールディングス	56,200	780.00	43,836,000	
オエノンホールディングス	35,000	217.00	7,595,000	
コカ・コーラウエスト	22,900	1,659.00	37,991,100	
コカ・コーライーストジャパン	21,100	1,756.00	37,051,600	
サントリー食品インター	39,600	4,105.00	162,558,000	
ダイドードリンコ	3,600	4,880.00	17,568,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
伊藤園	18,400	2,127.00	39,136,800	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
キーコーヒー	7,100	1,642.00	11,658,200	
日清オイリオグループ	36,000	414.00	14,904,000	
不二製油	18,300	1,575.00	28,822,500	

Ｊ - オイルミルズ	35,000	377.00	13,195,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
ローソン	22,200	7,250.00	160,950,000	
サンエー	4,900	4,050.00	19,845,000	
カワチ薬品	5,600	1,730.00	9,688,000	
エービーシー・マート	8,500	5,700.00	48,450,000	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
アスクル	6,600	1,977.00	13,048,200	貸付株式数 1,700株 (1,600株)
ゲオホールディングス	13,000	952.00	12,376,000	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
アダストリアホールディング	5,600	2,880.00	16,128,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
くらコーポレーション	4,000	2,988.00	11,952,000	
キャンドウ	4,900	1,555.00	7,619,500	貸付株式数 1,200株
パル	3,800	3,165.00	12,027,000	
エディオン	29,200	880.00	25,696,000	貸付株式数 8,800株
あらた	21,000	321.00	6,741,000	
ＪＰホールディングス	21,100	358.00	7,553,800	貸付株式数 6,100株 (2,000株)
あみやき亭	1,400	3,825.00	5,355,000	
ひらまつ	11,800	607.00	7,162,600	
双日	415,200	158.00	65,601,600	
アルフレッサホールディングス	71,100	1,394.00	99,113,400	
ハニーズ	6,300	928.00	5,846,400	
キッコーマン	57,000	2,945.00	167,865,000	
味の素	158,000	2,169.00	342,702,000	
キューピー	33,300	2,161.00	71,961,300	貸付株式数 9,900株 (9,900株)
ハウス食品G本社	24,400	2,037.00	49,702,800	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
カゴメ	24,800	1,836.00	45,532,800	貸付株式数 7,500株 (7,500株)
アリアケジャパン	6,700	2,833.00	18,981,100	
ニチレイ	78,000	525.00	40,950,000	
横浜冷凍	18,200	799.00	14,541,800	
東洋水産	35,200	3,840.00	135,168,000	
日清食品HD	28,200	5,570.00	157,074,000	貸付株式数 8,100株 (8,100株)
永谷園	9,000	1,049.00	9,441,000	



フジッコ	8,000	1,921.00	15,368,000	
ロックフィールド	5,700	1,924.00	10,966,800	
日本たばこ産業	378,000	3,275.00	1,237,950,000	
わらべや日洋	4,900	1,956.00	9,584,400	
片倉工業	9,700	1,220.00	11,834,000	
グ ン ゼ	55,000	306.00	16,830,000	
ヒューリック	102,400	1,102.00	112,844,800	貸付株式数 28,700株
アルペン	5,400	1,712.00	9,244,800	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
クオール	9,400	774.00	7,275,600	貸付株式数 2,200株
アルコニックス	4,400	1,934.00	8,509,600	
神戸物産	1,300	9,980.00	12,974,000	貸付株式数 300株 (300株)
ジェイアイエヌ	4,500	2,985.00	13,432,500	貸付株式数 1,300株 (1,000株)
ビックカメラ	27,100	1,264.00	34,254,400	貸付株式数 8,100株
DCMホールディングス	30,000	730.00	21,900,000	
MonotaRO	12,200	2,537.00	30,951,400	貸付株式数 3,400株 (3,400株)
あい ホールディングス	10,500	2,156.00	22,638,000	
J. フロント リテイリング	77,900	1,448.00	112,799,200	
ドトール・日レスHD	10,700	1,655.00	17,708,500	
マツモトキヨシHLDGS	13,500	3,270.00	44,145,000	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
スタートトゥデイ	19,100	2,418.00	46,183,800	
物語コーポレーション	1,800	3,605.00	6,489,000	
ココカラファイン	6,800	2,881.00	19,590,800	
三越伊勢丹HD	121,100	1,536.00	186,009,600	
東洋紡	273,000	161.00	43,953,000	
ユニチカ	235,000	60.00	14,100,000	
富士紡ホールディングス	36,000	321.00	11,556,000	
日清紡ホールディングス	43,000	1,275.00	54,825,000	
倉敷紡績	83,000	183.00	15,189,000	
ダイワボウHD	67,000	206.00	13,802,000	
シキボウ	69,000	123.00	8,487,000	
日東紡績	52,000	419.00	21,788,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
トヨタ紡織	22,100	1,446.00	31,956,600	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
ウエルシアHD	5,700	3,390.00	19,323,000	

クリエイトSDH	2,900	3,790.00	10,991,000	貸付株式数	800株
バイタルKSKHD	13,800	884.00	12,199,200	貸付株式数	3,900株 (3,900株)
UKCホールディングス	5,000	1,698.00	8,490,000		
TOKAIホールディングス	32,100	524.00	16,820,400		
三洋貿易	6,000	1,274.00	7,644,000		
ジョイフル本田	3,400	4,025.00	13,685,000		
すかいらーく	21,000	1,225.00	25,725,000	貸付株式数	5,800株
日本毛織	22,000	775.00	17,050,000		
ダイドーリミテッド	15,600	495.00	7,722,000	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
野村不動産HLDGS	35,900	1,987.00	71,333,300		
プレサンスコーポレーション	2,500	3,700.00	9,250,000		
常和ホールディングス	2,600	3,495.00	9,087,000	貸付株式数	700株 (700株)
オープンハウス	4,200	2,123.00	8,916,600		
東急不動産HD	161,000	785.00	126,385,000		
飯田GHD	38,800	1,368.00	53,078,400		
帝国繊維	7,300	2,616.00	19,096,800		
日本コークス工業	82,900	110.00	9,119,000		
あさひ	5,100	1,085.00	5,533,500	貸付株式数	1,300株
コスモス薬品	3,500	16,050.00	56,175,000	貸付株式数	900株 (900株)
シップヘルスケアHD	11,500	2,645.00	30,417,500		
セブン&アイ・HLDGS	252,200	4,307.00	1,086,225,400		
クリエイト・レストランツ・ホール	5,200	1,526.00	7,935,200		
ツルハホールディングス	11,900	6,550.00	77,945,000		
サンマルクホールディングス	2,400	6,670.00	16,008,000		
トリドール	6,800	1,682.00	11,437,600	貸付株式数	1,800株
クスリのアオキ	2,900	5,980.00	17,342,000		
帝人	270,000	311.00	83,970,000		
東レ	498,000	913.70	455,022,600	貸付株式数	138,000株 (138,000株)
クラレ	109,300	1,421.00	155,315,300		
旭化成	400,000	1,045.50	418,200,000	貸付株式数	119,000株 (119,000株)
トーカロ	5,100	2,011.00	10,256,100		
SUMCO	45,800	1,698.00	77,768,400	貸付株式数	12,000株 (12,000株)

川田テクノロジーズ	1,500	3,875.00	5,812,500	
住江織物	24,000	289.00	6,936,000	
日本バイリン	15,000	608.00	9,120,000	
アツギ	90,000	113.00	10,170,000	
セーレン	18,900	887.00	16,764,300	
小松精練	16,800	540.00	9,072,000	貸付株式数 4,200株
ワコールホールディングス	37,000	1,192.00	44,104,000	
ホギメディカル	4,100	5,390.00	22,099,000	貸付株式数 700株
T S Iホールディングス	30,800	681.00	20,974,800	
I Tホールディングス	21,100	1,798.00	37,937,800	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
グリー	37,700	725.00	27,332,500	貸付株式数 10,600株 (10,000株)
コーエーテクモHD	14,500	1,758.00	25,491,000	
三菱総合研究所	3,300	2,751.00	9,078,300	
K L a b	7,000	1,277.00	8,939,000	貸付株式数 1,900株
ネクソン	57,700	1,168.00	67,393,600	
コロプラ	10,800	2,809.00	30,337,200	貸付株式数 2,900株
ブロードリーフ	6,300	1,707.00	10,754,100	
特種東海製紙	43,000	247.00	10,621,000	
ティーガイア	7,200	1,193.00	8,589,600	
GMOペイメントゲートウェイ	6,000	2,160.00	12,960,000	貸付株式数 1,200株
インターネットイニシアティブ	10,400	2,216.00	23,046,400	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
朝日ネット	14,300	504.00	7,207,200	
王子ホールディングス	265,000	421.00	111,565,000	
日本製紙	31,500	1,705.00	53,707,500	
三菱製紙	122,000	85.00	10,370,000	
北越紀州製紙	44,400	503.00	22,333,200	
中越パルプ	38,000	175.00	6,650,000	
大王製紙	29,000	1,012.00	29,348,000	
レンゴー	55,000	477.00	26,235,000	
トーモク	27,000	278.00	7,506,000	
ザ・パック	5,100	2,242.00	11,434,200	
昭和電工	441,000	153.00	67,473,000	
住友化学	476,000	477.00	227,052,000	
住友精化	15,000	792.00	11,880,000	
日産化学	43,300	2,160.00	93,528,000	
クレハ	47,000	513.00	24,111,000	貸付株式数 14,000株
テイカ	15,000	440.00	6,600,000	

石原産業	124,000	101.00	12,524,000	
日本曹達	44,000	675.00	29,700,000	
東ソー	162,000	542.00	87,804,000	
トクヤマ	109,000	255.00	27,795,000	
セントラル硝子	67,000	436.00	29,212,000	
東亜合成	78,000	473.00	36,894,000	
ダイソー	31,000	374.00	11,594,000	
関東電化	18,000	645.00	11,610,000	
電気化学	138,000	439.00	60,582,000	
イビデン	40,500	1,771.00	71,725,500	
信越化学	115,000	7,851.00	902,865,000	
日本カ - バイド	27,000	223.00	6,021,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
堺 化 学	30,000	365.00	10,950,000	
エア・ウォーター	56,000	1,896.00	106,176,000	
大陽日酸	82,000	1,243.00	101,926,000	貸付株式数 22,000株
日本パ - カライジング	15,200	2,465.00	37,468,000	
高压ガス	12,000	568.00	6,816,000	
四国化成	11,000	812.00	8,932,000	
戸田工業	15,000	484.00	7,260,000	貸付株式数 4,000株
ステラ ケミファ	4,900	1,318.00	6,458,200	
保土谷化学	31,000	190.00	5,890,000	
日本触媒	50,000	1,469.00	73,450,000	
大日精化	30,000	641.00	19,230,000	
カネカ	82,000	618.00	50,676,000	
協和発酵キリン	77,000	1,168.00	89,936,000	
三菱瓦斯化学	108,000	613.00	66,204,000	
三井化学	297,000	327.00	97,119,000	
J S R	62,300	2,066.00	128,711,800	貸付株式数 17,000株 (17,000株)
東京応化工業	13,500	3,660.00	49,410,000	
三菱ケミカルH L D G S	402,100	589.00	236,836,900	
日本合成化学	16,000	673.00	10,768,000	
ダイセル	89,000	1,396.00	124,244,000	
住友ベ - クライト	62,000	455.00	28,210,000	貸付株式数 17,000株 (17,000株)
積水化学	151,000	1,393.00	210,343,000	
日本ゼオン	55,000	1,058.00	58,190,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
アイカ工業	19,300	2,470.00	47,671,000	

宇部興産	336,000	179.00	60,144,000	
積水樹脂	11,100	1,543.00	17,127,300	
タキロン	17,000	523.00	8,891,000	
旭有機材	30,000	283.00	8,490,000	
日立化成	31,400	2,149.00	67,478,600	
リケンテクノス	12,800	433.00	5,542,400	
大倉工業	21,000	348.00	7,308,000	
積水化成成品	24,000	413.00	9,912,000	
群栄化学	21,000	320.00	6,720,000	
日本化薬	43,000	1,432.00	61,576,000	
イーピーエス	9,100	1,281.00	11,657,100	
パナソニック インフォシス	2,500	3,065.00	7,662,500	
プレステージ・インター	6,900	1,002.00	6,913,800	
アミューズ	2,400	3,115.00	7,476,000	
野村総合研究所	33,900	3,630.00	123,057,000	
ケネディクス	93,600	529.00	49,514,400	
電通	71,500	5,020.00	358,930,000	貸付株式数 18,200株 (18,200株)
インテージホールディングス	4,800	1,648.00	7,910,400	
日本精化	8,200	861.00	7,060,200	
A D E K A	28,900	1,383.00	39,968,700	
日油	51,000	742.00	37,842,000	
ミヨシ油脂	48,000	136.00	6,528,000	
花 王	176,100	4,475.00	788,047,500	
第一工業製薬	16,000	379.00	6,064,000	貸付株式数 4,000株
三洋化成	21,000	851.00	17,871,000	
武田薬品	239,600	4,927.50	1,180,629,000	
アステラス製薬	730,800	1,655.00	1,209,474,000	
大日本住友製薬	47,000	1,174.00	55,178,000	貸付株式数 8,000株
塩野義製薬	100,500	3,175.00	319,087,500	
田辺三菱製薬	73,100	1,754.00	128,217,400	
あすか製薬	9,000	1,262.00	11,358,000	
日本新薬	15,000	3,950.00	59,250,000	
中外製薬	64,000	3,085.00	197,440,000	
科研製薬	23,000	2,430.00	55,890,000	
エーザイ	84,500	4,571.00	386,249,500	
ロート製薬	29,500	1,529.00	45,105,500	
小野薬品	29,100	10,170.00	295,947,000	
久光製薬	18,100	3,615.00	65,431,500	
持田製薬	4,900	6,480.00	31,752,000	

参天製薬	23,500	6,370.00	149,695,000	
扶桑薬品	32,000	301.00	9,632,000	
日本ケミファ	13,000	543.00	7,059,000	
ツムラ	20,400	2,667.00	54,406,800	貸付株式数 5,600株
日医工	15,500	1,841.00	28,535,500	
テルモ	94,200	2,765.00	260,463,000	
みらかホールディングス	16,800	5,000.00	84,000,000	
キッセイ薬品工業	12,400	3,150.00	39,060,000	
生化学工業	13,000	1,919.00	24,947,000	
栄研化学	6,700	1,813.00	12,147,100	
鳥居薬品	5,000	2,949.00	14,745,000	
JCRファーマ	5,700	2,370.00	13,509,000	
東和薬品	3,600	5,190.00	18,684,000	
沢井製薬	10,200	6,770.00	69,054,000	
ゼリア新薬工業	13,800	1,991.00	27,475,800	
第一三共	215,600	1,668.50	359,728,600	
キョーリン製薬HD	17,400	2,213.00	38,506,200	
大幸薬品	3,300	2,120.00	6,996,000	
ダイト	3,500	1,843.00	6,450,500	
大塚ホールディングス	126,400	3,613.00	456,683,200	
大正製薬HD	15,000	7,240.00	108,600,000	
大日本塗料	48,000	158.00	7,584,000	
日本ペイントHOLD	56,000	3,385.00	189,560,000	
関西ペイント	77,000	1,856.00	142,912,000	
中国塗料	20,000	974.00	19,480,000	
藤倉化成	13,400	580.00	7,772,000	
太陽ホールディングス	5,600	4,185.00	23,436,000	
DIC	259,000	286.00	74,074,000	
サカタインクス	14,100	1,351.00	19,049,100	
東洋インキSCホールディン	64,000	585.00	37,440,000	
T&K TOKA	2,900	2,321.00	6,730,900	
オリエンタルランド	17,300	26,465.00	457,844,500	
ダスキン	18,900	1,726.00	32,621,400	
パーク24	30,900	1,858.00	57,412,200	
明光ネットワークジャパン	8,500	1,179.00	10,021,500	貸付株式数 2,500株
ファルコホールディングス	5,200	1,218.00	6,333,600	
フジ・メディア・HD	63,500	1,500.00	95,250,000	
ラウンドワン	20,300	681.00	13,824,300	
リゾートトラスト	24,000	2,585.00	62,040,000	貸付株式数 6,800株
オービック	21,000	3,650.00	76,650,000	

ジャストシステム	10,300	733.00	7,549,900	
ヤフー	435,400	422.00	183,738,800	貸付株式数 126,100株
ビー・エム・エル	4,300	3,165.00	13,609,500	
トレンドマイクロ	32,700	3,575.00	116,902,500	
もしもしホットライン	13,600	1,076.00	14,633,600	
日本オラクル	9,600	4,660.00	44,736,000	
フューチャーアーキテクト	10,700	655.00	7,008,500	
CAC HOLDINGS	6,600	1,158.00	7,642,800	
ユー・エス・エス	77,200	1,805.00	139,346,000	
オービックビジネスC	4,300	3,255.00	13,996,500	
伊藤忠テクノソリュー	7,000	4,225.00	29,575,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
アイティフォー	14,800	446.00	6,600,800	
サイバーエージェント	12,000	4,570.00	54,840,000	
楽天	278,500	1,648.00	458,968,000	
大塚商会	16,300	3,840.00	62,592,000	
総合メディカル	1,900	5,750.00	10,925,000	
セントラルスポーツ	4,700	1,797.00	8,445,900	
電通国際情報S	5,800	1,197.00	6,942,600	
ウェザーニューズ	2,900	2,891.00	8,383,900	
WOWOW	1,800	4,870.00	8,766,000	貸付株式数 600株 (600株)
富士フイルムHLDGS	146,800	3,499.00	513,653,200	
コニカミノルタ	147,100	1,336.00	196,525,600	
資生堂	114,000	1,712.50	195,225,000	貸付株式数 32,700株
ライオン	75,000	625.00	46,875,000	
高砂香料	23,000	516.00	11,868,000	
マンダム	6,900	3,860.00	26,634,000	
ミルボン	4,500	3,085.00	13,882,500	貸付株式数 1,200株
ファンケル	16,100	1,710.00	27,531,000	
コーセー	10,400	4,565.00	47,476,000	
ドクターシーラボ	4,800	3,925.00	18,840,000	貸付株式数 1,300株
ポーラ・オルビスHD	7,600	4,755.00	36,138,000	
ノエビアホールディングス	5,500	2,097.00	11,533,500	
エステー	8,700	999.00	8,691,300	
コニシ	5,400	1,832.00	9,892,800	
長谷川香料	9,100	1,606.00	14,614,600	
小林製薬	10,200	6,820.00	69,564,000	
荒川化学工業	6,800	1,194.00	8,119,200	
メック	6,400	957.00	6,124,800	

日本高純度化学	3,500	2,414.00	8,449,000	
J C U	2,000	5,570.00	11,140,000	
新田ゼラチン	6,700	768.00	5,145,600	
アース製薬	5,000	4,140.00	20,700,000	貸付株式数 1,400株
イハラケミカル	11,000	1,278.00	14,058,000	貸付株式数 3,000株
大成ラミック	3,500	2,682.00	9,387,000	
クミアイ化学	14,000	728.00	10,192,000	貸付株式数 4,000株
日本農薬	15,500	1,396.00	21,638,000	
昭和シエル石油	58,300	1,001.00	58,358,300	
コスモ石油	182,000	156.00	28,392,000	貸付株式数 49,000株
ニチレキ	10,000	869.00	8,690,000	
東燃ゼネラル石油	93,000	1,041.00	96,813,000	
ユシロ化学	5,200	1,610.00	8,372,000	
富士石油	19,400	345.00	6,693,000	
出光興産	29,900	1,973.00	58,992,700	
J X ホールディングス	710,600	447.40	317,922,440	
横浜ゴム	73,000	1,151.00	84,023,000	
東洋ゴム	29,600	2,410.00	71,336,000	
ブリヂストン	200,600	4,193.50	841,216,100	貸付株式数 59,800株 (59,800株)
住友ゴム	49,200	1,828.00	89,937,600	
藤倉ゴム	6,800	811.00	5,514,800	
オカモト	26,000	421.00	10,946,000	
アキレス	73,000	145.00	10,585,000	
ニッタ	6,700	2,707.00	18,136,900	
住友理工	12,300	944.00	11,611,200	
三ツ星ベルト	18,000	870.00	15,660,000	
バンドー化学	28,000	423.00	11,844,000	
鬼怒川ゴム	17,000	499.00	8,483,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
旭硝子	315,000	590.00	185,850,000	
日本板硝子	330,000	113.00	37,290,000	
有沢製作所	12,300	846.00	10,405,800	
日本山村硝子	42,000	165.00	6,930,000	
日本電気硝子	126,000	536.00	67,536,000	
住友大阪セメント	123,000	337.00	41,451,000	
太平洋セメント	403,000	376.00	151,528,000	
日本ヒューム	8,500	941.00	7,998,500	
日本コンクリート	12,900	550.00	7,095,000	貸付株式数 3,800株 (3,800株)



ジャパンパイル	10,500	738.00	7,749,000	
東海カーボン	63,000	358.00	22,554,000	
日本カーボン	46,000	239.00	10,994,000	
東洋炭素	4,100	1,929.00	7,908,900	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ノリタケ	44,000	254.00	11,176,000	
TOTO	95,000	1,364.00	129,580,000	
日本碍子	81,000	2,410.00	195,210,000	
日本特殊陶業	55,500	3,505.00	194,527,500	
MARUWA	2,200	3,535.00	7,777,000	貸付株式数 500株 (500株)
品川リフラクトリーズ	22,000	268.00	5,896,000	
フジインコーポレーテッド	7,400	1,782.00	13,186,800	
ニチアス	31,000	662.00	20,522,000	
新日鐵住金	2,706,000	300.00	811,800,000	
神戸製鋼所	1,111,000	198.00	219,978,000	
合同製鐵	45,000	183.00	8,235,000	
JFEホールディングス	163,800	2,602.00	426,207,600	
日新製鋼	27,600	1,164.00	32,126,400	
東京製鐵	33,900	729.00	24,713,100	
共英製鋼	7,500	2,093.00	15,697,500	
大和工業	14,500	3,360.00	48,720,000	
東京鐵鋼	16,000	518.00	8,288,000	
大阪製鐵	4,600	1,988.00	9,144,800	
淀川製鋼所	49,000	436.00	21,364,000	
東洋鋼鈑	17,000	609.00	10,353,000	
丸一鋼管	18,600	2,554.00	47,504,400	
大同特殊鋼	105,000	449.00	47,145,000	貸付株式数 31,000株 (31,000株)
日本冶金工	53,500	249.00	13,321,500	貸付株式数 15,600株 (15,600株)
山陽特殊製鋼	40,000	377.00	15,080,000	
愛知製鋼	40,000	412.00	16,480,000	
日立金属	65,000	2,047.00	133,055,000	
大平洋金属	45,000	365.00	16,425,000	貸付株式数 13,000株
新日本電工	42,100	298.00	12,545,800	貸付株式数 8,900株 (8,900株)
栗本鉄工所	39,000	229.00	8,931,000	
日本製鋼所	97,000	421.00	40,837,000	貸付株式数 28,000株 (26,000株)

三菱製鋼	48,000	242.00	11,616,000	
日本軽金属HD	168,200	167.00	28,089,400	
三井金属	180,000	286.00	51,480,000	
東邦亜鉛	41,000	392.00	16,072,000	
三菱マテリアル	402,000	401.00	161,202,000	
住友鉱山	177,000	1,793.50	317,449,500	
DOWAホールディングス	77,000	920.00	70,840,000	
古河機金	112,000	205.00	22,960,000	
大阪チタニウム	6,900	2,294.00	15,828,600	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
東邦チタニウム	12,400	785.00	9,734,000	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
UACJ	75,000	309.00	23,175,000	貸付株式数 21,000株
古河電工	199,000	196.00	39,004,000	
住友電工	240,700	1,479.50	356,115,650	
フジクラ	96,000	479.00	45,984,000	
昭和電線HLDGS	87,000	103.00	8,961,000	
タツタ電線	13,900	491.00	6,824,900	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
リョービ	43,000	312.00	13,416,000	
アーレステイ	8,200	648.00	5,313,600	
アサヒHD	10,500	1,768.00	18,564,000	
東洋製罐グループHD	46,600	1,558.00	72,602,800	
ホッカンホールディングス	24,000	282.00	6,768,000	
横河ブリッジHLDGS	13,300	1,346.00	17,901,800	
三和ホールディングス	63,400	861.00	54,587,400	
文化シヤツタ-	20,000	961.00	19,220,000	
三協立山	8,600	2,135.00	18,361,000	
LIXILグループ	95,000	2,486.00	236,170,000	
ノーリツ	13,100	1,858.00	24,339,800	
長府製作所	7,300	2,953.00	21,556,900	
リンナイ	11,900	8,180.00	97,342,000	
ユニプレス	12,200	1,945.00	23,729,000	
岡 部	13,900	1,093.00	15,192,700	
東 プ レ	13,000	1,625.00	21,125,000	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
高周波熱錬	13,100	821.00	10,755,100	
東京製鋼	53,000	248.00	13,144,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
パイオラックス	3,600	4,995.00	17,982,000	

日本発条	55,800	1,005.00	56,079,000	
三浦工業	29,200	1,210.00	35,332,000	
タクマ	22,000	834.00	18,348,000	
リクルートホールディングス	72,000	3,445.00	248,040,000	
ツガミ	21,000	646.00	13,566,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
オークマ	44,000	956.00	42,064,000	
東芝機械	38,000	468.00	17,784,000	
アマダ	96,700	1,040.00	100,568,000	
アイダエンジニア	15,300	1,035.00	15,835,500	
滝澤鉄工所	29,000	206.00	5,974,000	
富士機械製造	21,900	1,089.00	23,849,100	
牧野フライス	33,000	905.00	29,865,000	
オーエスジー	29,500	1,863.00	54,958,500	
旭ダイヤモンド	18,500	1,223.00	22,625,500	
D M G 森精機	41,300	1,504.00	62,115,200	
ディスコ	7,300	9,500.00	69,350,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
日東工器	4,500	2,115.00	9,517,500	
豊田自動織機	55,600	5,840.00	324,704,000	
島精機製作所	9,800	2,225.00	21,805,000	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
日阪製作所	10,300	945.00	9,733,500	
やまびこ	2,800	5,330.00	14,924,000	
ナプテスコ	38,900	2,947.00	114,638,300	
三井海洋開発	6,500	1,949.00	12,668,500	貸付株式数 1,900株
S M C	19,600	31,325.00	613,970,000	
ホソカワミクロン	15,000	680.00	10,200,000	
ユニオンツール	4,000	2,632.00	10,528,000	
オイレス工業	8,500	2,027.00	17,229,500	
日精エーエスビー	2,700	2,797.00	7,551,900	
サト - ホールディングス	8,300	2,695.00	22,368,500	
日精樹脂工業	6,200	1,284.00	7,960,800	
小松製作所	317,700	2,678.00	850,800,600	貸付株式数 89,900株 (89,900株)
住友重機械	177,000	663.00	117,351,000	
日立建機	29,100	2,517.00	73,244,700	
巴工業	3,800	1,673.00	6,357,400	
井関農機	71,000	223.00	15,833,000	貸付株式数 20,000株
北川鉄工所	37,000	218.00	8,066,000	

クボタ	309,000	1,750.00	540,750,000	貸付株式数 89,000株 (89,000株)
東洋エンジニア	34,000	416.00	14,144,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
三菱化工機	24,000	451.00	10,824,000	貸付株式数 6,000株
月島機械	12,500	1,189.00	14,862,500	
帝国電機製作所	5,600	1,302.00	7,291,200	
新東工業	17,300	801.00	13,857,300	
渋谷工業	5,700	2,444.00	13,930,800	
アイチ コーポレーション	12,400	561.00	6,956,400	
小森コーポレーション	17,000	1,304.00	22,168,000	
鶴見製作所	5,500	1,965.00	10,807,500	
住友精密	15,000	509.00	7,635,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
荏原製作所	136,000	499.00	67,864,000	
西島製作所	8,600	842.00	7,241,200	貸付株式数 2,400株
北越工業	5,900	1,167.00	6,885,300	
千代田化工建	50,000	993.00	49,650,000	貸付株式数 14,000株
ダイキン工業	89,300	7,673.00	685,198,900	貸付株式数 25,200株 (25,200株)
オルガノ	17,000	465.00	7,905,000	
ト - ヨ - カネツ	44,000	247.00	10,868,000	
栗田工業	34,700	2,456.00	85,223,200	貸付株式数 10,200株 (10,200株)
椿本チエイン	33,000	976.00	32,208,000	
日本コンベヤ	25,000	257.00	6,425,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
日 機 装	21,200	1,130.00	23,956,000	
新興プランテック	15,700	806.00	12,654,200	
アネスト岩田	12,200	777.00	9,479,400	
ダイフク	31,000	1,326.00	41,106,000	
加藤製作所	15,000	971.00	14,565,000	
タダノ	30,000	1,450.00	43,500,000	
フジテック	18,400	1,204.00	22,153,600	
C K D	18,000	1,125.00	20,250,000	
キトー	7,800	1,161.00	9,055,800	
平和	13,700	2,318.00	31,756,600	
理想科学工業	4,100	3,725.00	15,272,500	
S A N K Y O	18,400	4,035.00	74,244,000	

日本金銭機械	6,300	1,701.00	10,716,300	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	4,700	2,014.00	9,465,800	
福島工業	3,900	1,931.00	7,530,900	
ダイコク電機	3,500	1,731.00	6,058,500	
ア マ ノ	20,900	1,238.00	25,874,200	
J U K I	50,000	446.00	22,300,000	
サンデン	40,000	645.00	25,800,000	
蛇の目ミシン	69,000	135.00	9,315,000	貸付株式数 19,000株
ブラザー工業	79,200	2,152.00	170,438,400	
マックス	11,000	1,193.00	13,123,000	
モリタホールディングス	12,200	1,117.00	13,627,400	
グローリー	19,700	2,856.00	56,263,200	
新晃工業	5,600	1,011.00	5,661,600	
大和冷機工業	10,600	730.00	7,738,000	
セガサミーホールディングス	66,100	1,564.00	103,380,400	
日本ピストンリング	35,000	241.00	8,435,000	
リ ケ ン	31,000	461.00	14,291,000	
T P R	7,200	2,893.00	20,829,600	
ホシザキ電機	13,400	5,910.00	79,194,000	
大豊工業	7,600	1,293.00	9,826,800	
日本精工	127,000	1,471.00	186,817,000	貸付株式数 41,000株 (41,000株)
N T N	145,000	542.00	78,590,000	
ジェイテクト	65,800	2,015.00	132,587,000	貸付株式数 6,300株 (6,300株)
不 二 越	58,000	699.00	40,542,000	
ミネベア	92,000	1,664.00	153,088,000	
日本トムソン	24,000	565.00	13,560,000	
T H K	40,500	2,820.00	114,210,000	
ユーシン精機	3,400	2,115.00	7,191,000	
イーグル工業	9,100	2,165.00	19,701,500	
日本ピラ - 工業	9,000	889.00	8,001,000	
キッツ	29,600	478.00	14,148,800	
日 立	1,470,000	871.90	1,281,693,000	
東 芝	1,290,000	499.40	644,226,000	
三菱電機	612,000	1,412.00	864,144,000	
富士電機	172,000	478.00	82,216,000	
東洋電機製造	19,000	393.00	7,467,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)

安川電機	73,000	1,583.00	115,559,000	貸付株式数	21,100株
シンフォニア テクノロジー	53,000	173.00	9,169,000		
明電舎	62,000	379.00	23,498,000		
山洋電気	15,000	783.00	11,745,000		
デンヨー	6,400	1,746.00	11,174,400		
日立工機	18,300	918.00	16,799,400		
三桜工業	13,200	737.00	9,728,400		
マキタ	39,700	5,550.00	220,335,000		
東芝テック	45,000	810.00	36,450,000		
マブチモーター	9,200	9,830.00	90,436,000		
日本電産	66,000	7,939.00	523,974,000	貸付株式数	19,900株 (19,900株)
東光高岳	3,500	1,757.00	6,149,500		
ダイヘン	36,000	572.00	20,592,000		
JVCケンウッド	50,500	256.00	12,928,000	貸付株式数	14,000株 (14,000株)
第一精工	2,800	2,552.00	7,145,600		
日新電機	16,000	642.00	10,272,000		
大崎電気	11,000	840.00	9,240,000	貸付株式数	3,000株
オムロン	69,000	5,300.00	365,700,000		
日東工業	10,100	2,311.00	23,341,100		
I D E C	9,300	992.00	9,225,600		
ジーエス・ユアサ コーポ	122,000	496.00	60,512,000		
メルコホールディングス	4,300	1,670.00	7,181,000		
日本電気	796,000	357.00	284,172,000		
富士通	593,000	645.10	382,544,300		
沖電気	219,000	233.00	51,027,000		
電気興業	21,000	488.00	10,248,000		
サンケン電気	33,000	1,016.00	33,528,000		
アイホン	4,500	1,901.00	8,554,500		
ルネサスエレクトロニクス	32,900	806.00	26,517,400	貸付株式数	9,600株
セイコーエプソン	41,900	5,420.00	227,098,000		
ワコム	52,600	474.00	24,932,400	貸付株式数	15,100株 (15,100株)
アルバック	11,800	1,886.00	22,254,800		
アクセル	4,800	1,476.00	7,084,800		
E I Z O	6,200	2,243.00	13,906,600		
ジャパンディスプレイ	96,500	410.00	39,565,000	貸付株式数	30,800株 (30,800株)
日本信号	17,400	1,217.00	21,175,800		

京三製作所	19,000	366.00	6,954,000	
能美防災	8,700	1,561.00	13,580,700	
エレコム	2,500	2,327.00	5,817,500	
日本無線	17,000	357.00	6,069,000	
パナソニック	747,200	1,423.50	1,063,639,200	
シャープ	521,000	264.00	137,544,000	貸付株式数 150,000株 (132,000株)
アンリツ	39,200	833.00	32,653,600	
富士通ゼネラル	19,000	1,108.00	21,052,000	
日立国際電気	17,000	1,639.00	27,863,000	
ソニー	394,800	2,478.50	978,511,800	
T D K	37,100	7,250.00	268,975,000	
ミツミ電機	23,100	990.00	22,869,000	
タムラ製作所	28,000	437.00	12,236,000	
アルプス電気	48,800	2,294.00	111,947,200	
パイオニア	97,200	225.00	21,870,000	貸付株式数 26,600株
日本電波工業	7,700	975.00	7,507,500	
ローランド ディー・ジー	2,800	3,980.00	11,144,000	
フオスタ - 電機	6,900	2,048.00	14,131,200	
クラリオン	35,000	370.00	12,950,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
S M K	21,000	475.00	9,975,000	
東光	19,000	306.00	5,814,000	貸付株式数 5,000株
ホシデン	21,500	673.00	14,469,500	貸付株式数 5,500株
ヒロセ電機	9,700	13,570.00	131,629,000	貸付株式数 2,700株
日本航空電子	18,000	2,733.00	49,194,000	
T O A	7,700	1,215.00	9,355,500	
日立マクセル	9,600	1,892.00	18,163,200	
古野電気	9,100	930.00	8,463,000	
ユニデン	26,000	221.00	5,746,000	
アルパイン	15,200	1,955.00	29,716,000	
スミダコーポレーション	8,400	838.00	7,039,200	
アイコム	4,300	2,816.00	12,108,800	
船井電機	7,100	1,499.00	10,642,900	
横河電機	62,500	1,328.00	83,000,000	
新電元工業	25,000	705.00	17,625,000	
アズビル	19,600	2,744.00	53,782,400	
日本光電工業	13,100	6,170.00	80,827,000	
堀場製作所	11,600	4,065.00	47,154,000	
アドバンテスト	43,700	1,486.00	64,938,200	貸付株式数 11,900株

エスペック	8,600	1,078.00	9,270,800	
キーエンス	13,800	52,410.00	723,258,000	
日置電機	4,500	1,717.00	7,726,500	
シスメックス	47,500	5,170.00	245,575,000	
メガチップス	8,400	1,380.00	11,592,000	
O B A R A G R O U P	4,200	5,160.00	21,672,000	
デンソー	150,900	5,527.00	834,024,300	
コーセル	9,700	1,211.00	11,746,700	貸付株式数 2,900株
オプテックス	4,900	1,918.00	9,398,200	
千代田インテグレ	3,400	2,044.00	6,949,600	
レーザーテック	7,700	1,374.00	10,579,800	
スタンレー電気	44,100	2,536.00	111,837,600	
岩崎電気	27,000	240.00	6,480,000	
ウシオ電機	36,800	1,290.00	47,472,000	貸付株式数 11,000株 (11,000株)
日本セラミック	4,400	1,811.00	7,968,400	
日本デジタル研究所	6,600	1,625.00	10,725,000	
古河電池	6,000	1,042.00	6,252,000	
山一電機	8,300	773.00	6,415,900	
図 研	6,700	1,132.00	7,584,400	
日本電子	29,000	609.00	17,661,000	
カ シ オ	62,100	1,892.00	117,493,200	貸付株式数 19,200株
ファナック	63,800	19,790.00	1,262,602,000	
日本シイエムケイ	22,800	314.00	7,159,200	
エンプラス	3,000	4,175.00	12,525,000	
大真空	17,000	315.00	5,355,000	
ロ ー ム	30,200	7,590.00	229,218,000	
浜松ホトニクス	25,600	5,850.00	149,760,000	
三井ハイテック	11,600	831.00	9,639,600	
新光電気工業	25,800	811.00	20,923,800	
京 セ ラ	100,500	5,557.00	558,478,500	
太陽誘電	33,400	1,390.00	46,426,000	
村田製作所	64,200	12,820.00	823,044,000	貸付株式数 18,400株 (18,400株)
ユーシン	11,300	667.00	7,537,100	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
双葉電子工業	11,200	1,744.00	19,532,800	
日東電工	49,500	6,571.00	325,264,500	
北陸電気工業	39,000	175.00	6,825,000	



東海理化電機	16,600	2,419.00	40,155,400	貸付株式数 4,900株 (4,900株)
ニチコン	20,900	994.00	20,774,600	
日本ケミコン	52,000	356.00	18,512,000	
K O A	9,900	1,128.00	11,167,200	
三井造船	244,000	213.00	51,972,000	貸付株式数 73,000株 (73,000株)
日立造船	51,400	666.00	34,232,400	
三菱重工業	1,025,000	670.90	687,672,500	
川崎重工業	448,000	544.00	243,712,000	
I H I	444,000	587.00	260,628,000	
名村造船所	17,700	1,317.00	23,310,900	
日本車輛	26,000	350.00	9,100,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
ニチユ三菱フォークリフト	8,200	770.00	6,314,000	
F P G	6,400	1,432.00	9,164,800	貸付株式数 1,700株 (1,500株)
じもとホールディングス	49,600	224.00	11,110,400	貸付株式数 13,800株
全国保証	16,300	3,335.00	54,360,500	
足利ホールディングス	37,900	488.00	18,495,200	
東京T YフィナンシャルG	8,100	3,325.00	26,932,500	
日産自動車	859,200	1,024.50	880,250,400	
いすゞ自動車	193,700	1,378.00	266,918,600	
トヨタ自動車	845,800	7,250.00	6,132,050,000	貸付株式数 243,100株 (243,100株)
日野自動車	87,800	1,491.00	130,909,800	
三菱自動車工業	224,900	1,068.00	240,193,200	
エフテック	6,000	1,197.00	7,182,000	
武蔵精密工業	7,300	2,142.00	15,636,600	
日産車体	27,500	1,421.00	39,077,500	
新明和工業	25,000	1,119.00	27,975,000	
極東開発工業	12,100	1,413.00	17,097,300	
日信工業	11,900	1,642.00	19,539,800	貸付株式数 3,200株
トピー工業	61,000	228.00	13,908,000	
ティラド	33,000	237.00	7,821,000	
曙ブレーキ	30,700	414.00	12,709,800	貸付株式数 9,800株
タチエス	10,900	1,549.00	16,884,100	
N O K	29,600	2,855.00	84,508,000	
フタバ産業	22,000	561.00	12,342,000	
カヤバ工業	72,000	507.00	36,504,000	

大同メタル工業	10,000	1,231.00	12,310,000	
プレス工業	36,000	410.00	14,760,000	
カルソニックカンセイ	47,000	653.00	30,691,000	
太平洋工業	15,200	878.00	13,345,600	貸付株式数 4,300株
ケーヒン	14,900	1,707.00	25,434,300	
河西工業	9,300	1,021.00	9,495,300	
アイシン精機	55,600	4,285.00	238,246,000	
マ ッ ダ	183,000	2,892.50	529,327,500	
ダイハツ	70,400	1,544.00	108,697,600	貸付株式数 14,100株
今仙電機製作所	6,100	1,524.00	9,296,400	貸付株式数 1,800株
本田技研	550,700	3,495.00	1,924,696,500	
スズキ	127,800	3,591.50	458,993,700	
富士重工業	208,900	4,252.00	888,242,800	
ヤマハ発動機	93,600	2,358.00	220,708,800	
ショーワ	15,900	1,102.00	17,521,800	
小糸製作所	37,000	3,585.00	132,645,000	
T B K	11,300	667.00	7,537,100	
エクセディ	8,600	2,925.00	25,155,000	
ミツバ	12,300	2,077.00	25,547,100	
豊田合成	19,900	2,402.00	47,799,800	
愛三工業	11,900	968.00	11,519,200	
ヨ ロ ズ	6,400	1,992.00	12,748,800	
エフ・シー・シー	9,800	2,049.00	20,080,200	
シマノ	26,500	15,760.00	417,640,000	
テイ・エス テック	13,200	2,706.00	35,719,200	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
小 野 建	6,800	941.00	6,398,800	
カップ・クリエイトHD	11,700	1,055.00	12,343,500	貸付株式数 3,400株 (3,400株)
ナガイレーベン	9,700	1,888.00	18,313,600	
三菱食品	6,600	2,622.00	17,305,200	
良品計画	7,500	14,530.00	108,975,000	
松田産業	6,600	1,273.00	8,401,800	
メディパルHD	59,900	1,347.00	80,685,300	
アズワン	4,900	3,085.00	15,116,500	
シモジマ	7,200	1,015.00	7,308,000	
ドウシシャ	9,000	1,583.00	14,247,000	
コナカ	9,300	596.00	5,542,800	
コーナン商事	10,600	1,297.00	13,748,200	
黒田電気	10,600	1,522.00	16,133,200	

ネットワンシステムズ	26,900	664.00	17,861,600	貸付株式数 7,500株 (7,500株)
ワタミ	8,600	1,135.00	9,761,000	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	20,900	8,210.00	171,589,000	貸付株式数 5,800株
西松屋チェーン	13,100	925.00	12,117,500	
ゼンショーホールディングス	31,200	966.00	30,139,200	貸付株式数 8,900株
ハピネット	4,400	1,507.00	6,630,800	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
幸楽苑	6,700	1,517.00	10,163,900	
サイゼリヤ	9,400	1,565.00	14,711,000	
ガリバーインターナショナル	19,900	827.00	16,457,300	
ユナイテッドアローズ	8,100	3,180.00	25,758,000	
ハイデイ日高	4,200	3,640.00	15,288,000	
シークス	4,600	2,426.00	11,159,600	
京都きもの友禅	8,800	1,005.00	8,844,000	
コロワイド	20,900	1,560.00	32,604,000	貸付株式数 6,200株
壱番屋	2,800	5,010.00	14,028,000	貸付株式数 700株
マクニカ	3,700	3,170.00	11,729,000	
スギホールディングス	10,700	4,760.00	50,932,000	
島津製作所	74,000	1,211.00	89,614,000	
J M S	24,000	284.00	6,816,000	
スター精密	12,800	1,544.00	19,763,200	
東京計器	30,000	278.00	8,340,000	
東京精密	11,700	2,393.00	27,998,100	
マニー	1,900	7,110.00	13,509,000	
ニコン	114,900	1,659.00	190,619,100	貸付株式数 33,400株
トプコン	19,000	2,523.00	47,937,000	
オリンパス	91,600	4,420.00	404,872,000	
理研計器	8,200	1,134.00	9,298,800	
S C R E E Nホールディングス	60,000	718.00	43,080,000	
キヤノン電子	5,700	1,937.00	11,040,900	
タムロン	5,300	2,260.00	11,978,000	
H O Y A	145,600	3,946.00	574,537,600	
ノーリツ鋼機	9,000	604.00	5,436,000	
キヤノン	354,900	3,880.50	1,377,189,450	
リ コ ー	184,300	1,232.00	227,057,600	
シチズンホールディングス	77,400	933.00	72,214,200	
リズム時計	39,000	152.00	5,928,000	
大研医器	5,500	1,122.00	6,171,000	

パラマウントベッドHD	6,800	3,205.00	21,794,000	
前田工織	7,300	1,248.00	9,110,400	貸付株式数 2,000株 (400株)
永大産業	14,000	454.00	6,356,000	
アートネイチャー	5,600	1,342.00	7,515,200	
バンダイナムコHLDGS	67,600	2,507.00	169,473,200	
フランスベッドHLDGS	55,000	178.00	9,790,000	
マーベラス	11,000	1,940.00	21,340,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	5,600	6,680.00	37,408,000	
エイベックス・グループHD	12,500	1,873.00	23,412,500	貸付株式数 3,600株
トッパン・フォームズ	12,600	1,175.00	14,805,000	
フジシールインターナショナル	7,800	3,330.00	25,974,000	
タカラトミー	24,900	617.00	15,363,300	貸付株式数 7,100株 (7,100株)
大建工業	34,000	257.00	8,738,000	
凸版印刷	174,000	760.00	132,240,000	
大日本印刷	187,000	1,064.50	199,061,500	
図書印刷	15,000	338.00	5,070,000	
共同印刷	26,000	379.00	9,854,000	
日本写真印刷	11,100	1,891.00	20,990,100	貸付株式数 3,200株
藤森工業	5,800	3,170.00	18,386,000	
宝印刷	9,000	812.00	7,308,000	
前澤化成工業	7,500	1,187.00	8,902,500	
アシックス	61,100	2,867.00	175,173,700	
ツ ツ ミ	3,700	2,408.00	8,909,600	
ジェイ エス ピー	5,700	1,962.00	11,183,400	
ニ チ ハ	10,600	1,177.00	12,476,200	
エフピコ	5,800	3,875.00	22,475,000	貸付株式数 1,800株
小松ウオール工業	2,700	2,627.00	7,092,900	
ヤマハ	46,000	1,792.00	82,432,000	
河合楽器	3,300	2,494.00	8,230,200	
クリナップ	8,300	855.00	7,096,500	
ビジョン	11,800	6,820.00	80,476,000	
天馬	6,100	1,569.00	9,570,900	
リンテック	14,400	2,600.00	37,440,000	
信越ポリマー	16,000	498.00	7,968,000	
東 リ	31,000	243.00	7,533,000	
イトーキ	15,400	583.00	8,978,200	
任 天 堂	37,800	12,655.00	478,359,000	

三菱鉛筆	5,500	3,520.00	19,360,000	
松 風	4,600	1,579.00	7,263,400	
タカラスタンダ - ド	27,000	894.00	24,138,000	
コ ク ヨ	33,300	878.00	29,237,400	
ニ フ コ	14,500	3,855.00	55,897,500	
岡村製作所	25,200	804.00	20,260,800	
日本バルカー	37,000	309.00	11,433,000	
MUTOHホールディングス	10,000	457.00	4,570,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
伊 藤 忠	502,600	1,216.50	611,412,900	
丸 紅	523,500	680.90	356,451,150	
ヨンドシーホールディングス	5,300	1,829.00	9,693,700	貸付株式数 1,400株
三陽商会	39,000	302.00	11,778,000	
長瀬産業	36,000	1,380.00	49,680,000	
蝶 理	5,200	1,737.00	9,032,400	
豊田通商	67,200	2,639.00	177,340,800	
オンワ - ドホールディングス	47,000	692.00	32,524,000	
三共生興	17,400	447.00	7,777,800	
兼 松	128,000	166.00	21,248,000	
美 津 濃	36,000	575.00	20,700,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
ファミリーマート	19,800	4,530.00	89,694,000	貸付株式数 5,700株 (5,700株)
三井物産	509,200	1,499.00	763,290,800	
日本紙パルプ	35,000	320.00	11,200,000	
東京エレクトロン	51,700	8,605.00	444,878,500	
日立ハイテクノロジーズ	20,800	3,465.00	72,072,000	
カメイ	10,300	724.00	7,457,200	
スターゼン	30,000	396.00	11,880,000	
セイコーHD	45,000	649.00	29,205,000	貸付株式数 5,000株
山 善	25,300	807.00	20,417,100	
住友商事	355,700	1,177.50	418,836,750	
日本ユニシス	18,700	1,025.00	19,167,500	
内田洋行	20,000	362.00	7,240,000	
三菱商事	461,300	2,046.00	943,819,800	
第一実業	19,000	578.00	10,982,000	
キヤノンマーケティングJPN	17,400	2,040.00	35,496,000	
西華産業	28,000	265.00	7,420,000	
菱洋エレクトロ	9,600	1,199.00	11,510,400	
ユアサ商事	6,300	2,352.00	14,817,600	

神鋼商事	30,000	260.00	7,800,000	
阪和興業	66,000	410.00	27,060,000	
カナデン	11,000	804.00	8,844,000	
菱電商事	15,000	808.00	12,120,000	
ニプロ	40,200	1,045.00	42,009,000	貸付株式数 11,300株
岩谷産業	68,000	769.00	52,292,000	貸付株式数 19,000株
すてきナイスグループ	37,000	187.00	6,919,000	
昭光通商	44,000	181.00	7,964,000	
兼松エレクトロニクス	6,600	1,651.00	10,896,600	
三愛石油	18,000	764.00	13,752,000	
稲畑産業	16,700	1,017.00	16,983,900	
ゴ-ルドウイン	17,000	621.00	10,557,000	
ユニ・チャ-ム	129,200	2,729.00	352,586,800	
デサント	16,000	1,166.00	18,656,000	
ワキタ	13,800	1,101.00	15,193,800	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
東邦ホールディングス	21,800	1,665.00	36,297,000	
サンゲツ	11,900	2,879.00	34,260,100	
ミツウロコグループ	14,200	525.00	7,455,000	
シナネン	21,000	438.00	9,198,000	
伊藤忠エネクス	15,500	838.00	12,989,000	
サンリオ	17,200	2,959.00	50,894,800	貸付株式数 4,900株 (4,600株)
サンワテクノス	5,600	1,188.00	6,652,800	
リョ-サン	11,200	2,536.00	28,403,200	
新光商事	9,200	1,190.00	10,948,000	
トーホ-	24,000	428.00	10,272,000	
三信電気	10,400	785.00	8,164,000	
東陽テクニカ	11,700	1,001.00	11,711,700	
モスフードサービス	8,400	2,169.00	18,219,600	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
加賀電子	6,500	1,380.00	8,970,000	
三益半導体	9,500	1,117.00	10,611,500	
木曾路	8,500	1,906.00	16,201,000	貸付株式数 2,400株
千趣会	13,800	851.00	11,743,800	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
ケーヨー	17,000	529.00	8,993,000	貸付株式数 3,200株
アデランス	9,200	1,250.00	11,500,000	
上新電機	15,000	963.00	14,445,000	
日本瓦斯	10,100	2,431.00	24,553,100	

マルエツ	19,000	531.00	10,089,000	
ロイヤルホールディングス	11,000	1,714.00	18,854,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
いなげや	8,600	1,160.00	9,976,000	
島 忠	14,600	2,833.00	41,361,800	
チヨダ	7,600	2,205.00	16,758,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
ライフコーポレーション	4,600	1,679.00	7,723,400	
カ ス ミ	14,200	1,021.00	14,498,200	
リンガーハット	7,100	1,837.00	13,042,700	貸付株式数 2,300株
A O K Iホールディングス	14,700	1,159.00	17,037,300	
オークワ	12,000	917.00	11,004,000	
コメリ	10,300	2,487.00	25,616,100	
青山商事	14,900	2,595.00	38,665,500	
しまむら	6,900	9,820.00	67,758,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
高 島 屋	86,000	997.00	85,742,000	
松 屋	13,100	1,619.00	21,208,900	
エイチ・ツー・オーリテイリング	28,800	1,928.00	55,526,400	
近鉄百貨店	28,000	308.00	8,624,000	貸付株式数 7,000株
ニッセンHD	17,900	330.00	5,907,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
パ ル コ	8,300	968.00	8,034,400	
丸井グループ	75,200	1,074.00	80,764,800	
クレディセゾン	50,100	2,172.00	108,817,200	
アクシアル リテイリング	5,400	2,574.00	13,899,600	
ダイエー	81,400	134.00	10,907,600	
イオン	242,600	1,161.00	281,658,600	貸付株式数 72,000株
ユニーグループ・HD	65,300	598.00	39,049,400	
イ ズ ミ	13,700	4,005.00	54,868,500	
東武ストア	28,000	273.00	7,644,000	貸付株式数 7,000株
平 和 堂	12,900	2,129.00	27,464,100	
フ ジ	7,600	2,087.00	15,861,200	
ヤオコー	3,600	6,870.00	24,732,000	
ゼビオ	8,400	1,983.00	16,657,200	
ケーズホールディングス	13,700	2,982.00	40,853,400	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
P a l t a c	10,000	1,349.00	13,490,000	
新生銀行	597,000	200.00	119,400,000	

あおぞら銀行	426,000	370.00	157,620,000	
三菱UFJフィナンシャルG	4,850,500	648.90	3,147,489,450	
りそなホールディングス	713,200	603.50	430,416,200	
三井住友トラストHD	1,341,000	450.30	603,852,300	
三井住友フィナンシャルG	456,400	4,152.00	1,894,972,800	
第四銀行	75,000	395.00	29,625,000	
北越銀行	73,000	215.00	15,695,000	
西日本シティ銀行	211,000	338.00	71,318,000	
千葉銀行	230,000	766.00	176,180,000	
横浜銀行	414,000	644.10	266,657,400	
常陽銀行	213,000	583.00	124,179,000	
群馬銀行	141,000	756.00	106,596,000	
武蔵野銀行	9,800	3,925.00	38,465,000	
千葉興業銀行	14,200	835.00	11,857,000	
筑波銀行	28,600	369.00	10,553,400	
七十七銀行	100,000	609.00	60,900,000	
青森銀行	52,000	346.00	17,992,000	
秋田銀行	45,000	320.00	14,400,000	
山形銀行	39,000	506.00	19,734,000	貸付株式数 11,000株
岩手銀行	4,300	4,955.00	21,306,500	
東邦銀行	55,000	405.00	22,275,000	
みちのく銀行	38,000	215.00	8,170,000	貸付株式数 10,000株
ふくおかフィナンシャルG	247,000	605.00	149,435,000	
静岡銀行	176,000	1,084.00	190,784,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
十六銀行	76,000	421.00	31,996,000	
スルガ銀行	63,300	2,133.00	135,018,900	
八十二銀行	108,000	761.00	82,188,000	
山梨中央銀行	39,000	484.00	18,876,000	
大垣共立銀行	77,000	364.00	28,028,000	
福井銀行	58,000	266.00	15,428,000	
北國銀行	68,000	375.00	25,500,000	
清水銀行	2,600	2,890.00	7,514,000	
滋賀銀行	60,000	628.00	37,680,000	
南都銀行	59,000	410.00	24,190,000	
百五銀行	58,000	488.00	28,304,000	
京都銀行	113,000	984.00	111,192,000	
紀陽銀行	24,200	1,471.00	35,598,200	
三重銀行	40,000	264.00	10,560,000	
ほくほくフィナンシャルG	402,000	239.00	96,078,000	



広島銀行	177,000	564.00	99,828,000	
山陰合同銀行	37,000	873.00	32,301,000	
中国銀行	41,400	1,642.00	67,978,800	
伊予銀行	62,600	1,268.00	79,376,800	
百十四銀行	67,000	392.00	26,264,000	
四国銀行	52,000	248.00	12,896,000	
阿波銀行	50,000	626.00	31,300,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
鹿児島銀行	42,000	736.00	30,912,000	
大分銀行	39,000	427.00	16,653,000	貸付株式数 11,000株
宮崎銀行	44,000	366.00	16,104,000	
肥後銀行	50,000	623.00	31,150,000	
佐賀銀行	46,000	271.00	12,466,000	
十八銀行	42,000	334.00	14,028,000	
沖縄銀行	5,100	4,825.00	24,607,500	
琉球銀行	13,300	1,672.00	22,237,600	
セブン銀行	202,100	485.00	98,018,500	
みずほフィナンシャルG	8,331,000	198.00	1,649,538,000	
山口フィナンシャルG	58,000	1,198.00	69,484,000	
芙蓉総合リース	6,600	3,945.00	26,037,000	
興銀リース	12,300	2,310.00	28,413,000	
東京センチュリーリース	14,200	2,884.00	40,952,800	
SBIホールディングス	73,300	1,329.00	97,415,700	
日本証券金融	32,100	610.00	19,581,000	
アイフル	103,400	405.00	41,877,000	貸付株式数 33,200株 (33,200株)
名古屋銀行	58,000	434.00	25,172,000	
北洋銀行	90,000	458.00	41,220,000	
愛知銀行	2,500	5,860.00	14,650,000	
第三銀行	48,000	195.00	9,360,000	
東日本銀行	31,000	335.00	10,385,000	
大光銀行	34,000	221.00	7,514,000	
愛媛銀行	42,000	240.00	10,080,000	貸付株式数 14,000株
トマト銀行	46,000	177.00	8,142,000	
みなと銀行	59,000	212.00	12,508,000	
京葉銀行	49,000	668.00	32,732,000	
関西アーバン銀行	7,500	1,253.00	9,397,500	
栃木銀行	33,000	544.00	17,952,000	
北日本銀行	2,800	2,811.00	7,870,800	
東和銀行	87,000	101.00	8,787,000	

福島銀行	99,000	93.00	9,207,000	
大東銀行	56,000	141.00	7,896,000	
リコーリース	5,600	2,978.00	16,676,800	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
イオンフィナンシャルサービス	39,900	2,309.00	92,129,100	貸付株式数 10,500株 (10,500株)
アコム	124,000	327.00	40,548,000	貸付株式数 36,500株 (36,500株)
ジャックス	36,000	579.00	20,844,000	
オリコ	140,900	196.00	27,616,400	
日立キャピタル	12,400	2,559.00	31,731,600	
オリックス	425,800	1,491.00	634,867,800	
三菱UFJリース	152,400	537.00	81,838,800	
ジャフコ	8,700	4,030.00	35,061,000	
トモニホールディングス	48,500	497.00	24,104,500	
大和証券G本社	566,000	928.20	525,361,200	
野村ホールディングス	1,235,900	686.00	847,827,400	
岡三証券グループ	53,000	910.00	48,230,000	
丸三証券	22,100	810.00	17,901,000	
東洋証券	32,000	352.00	11,264,000	
東海東京HD	70,700	824.00	58,256,800	
水戸証券	24,800	429.00	10,639,200	
いちよし証券	14,500	1,294.00	18,763,000	
松井証券	32,500	1,055.00	34,287,500	
損保ジャパン興亜HD	134,600	2,937.50	395,387,500	
日本取引所グループ	89,100	2,750.00	245,025,000	
マネックスG	75,400	277.00	20,885,800	
カブドットコム証券	28,900	593.00	17,137,700	
極東証券	9,400	1,895.00	17,813,000	
岩井コスモホールディング	7,700	1,323.00	10,187,100	
フィデアホール	40,100	218.00	8,741,800	貸付株式数 11,600株
池田泉州HD	47,600	543.00	25,846,800	貸付株式数 13,400株 (13,400株)
MS&AD	193,400	2,812.50	543,937,500	
SONY FH	58,600	1,744.00	102,198,400	
第一生命	386,200	1,783.00	688,594,600	
東京海上HD	248,400	3,815.00	947,646,000	
NECキャピタルソリューション	3,600	1,950.00	7,020,000	
T&Dホールディングス	220,000	1,420.00	312,400,000	

三井不動産	320,000	3,116.50	997,280,000	貸付株式数 95,000株 (95,000株)
三菱地所	450,000	2,445.50	1,100,475,000	
平和不動産	13,400	1,749.00	23,436,600	
東京建物	134,000	869.00	116,446,000	
ダイビル	16,600	1,118.00	18,558,800	
京阪神ビルディング	16,100	605.00	9,740,500	
住友不動産	145,000	3,931.50	570,067,500	貸付株式数 40,000株
大京	99,000	185.00	18,315,000	
テーオーシー	22,700	675.00	15,322,500	
東京楽天地	18,000	505.00	9,090,000	
レオパレス21	66,900	712.00	47,632,800	
スターツコーポレーション	7,900	1,533.00	12,110,700	
フジ住宅	13,000	667.00	8,671,000	貸付株式数 3,200株
空港施設	10,900	701.00	7,640,900	
住友不動産販売	4,600	2,582.00	11,877,200	
ゴールドクレスト	6,100	2,046.00	12,480,600	
リロ・ホールディング	2,300	7,940.00	18,262,000	
タカラレーベン	29,500	518.00	15,281,000	貸付株式数 6,800株 (6,800株)
サンヨーハウジング 名古屋	5,900	1,231.00	7,262,900	
イオンモール	39,000	1,915.00	74,685,000	
トーセイ	10,500	643.00	6,751,500	貸付株式数 3,000株
エヌ・ティ・ティ都市開発	38,200	1,151.00	43,968,200	
サンフロンティア不動産	7,800	1,030.00	8,034,000	貸付株式数 2,200株
東武鉄道	331,000	510.00	168,810,000	
相鉄ホールディングス	108,000	474.00	51,192,000	
東京急行	335,000	722.00	241,870,000	
京浜急行	167,000	872.00	145,624,000	
小田急電鉄	197,000	1,023.00	201,531,000	
京王電鉄	172,000	852.00	146,544,000	
京成電鉄	93,000	1,431.00	133,083,000	
富士急行	18,000	1,125.00	20,250,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
新京成電鉄	21,000	383.00	8,043,000	
東日本旅客鉄道	111,700	8,880.00	991,896,000	
西日本旅客鉄道	59,100	5,651.00	333,974,100	
東海旅客鉄道	54,800	17,430.00	955,164,000	
西武ホールディングス	48,800	2,455.00	119,804,000	貸付株式数 14,600株
鴻池運輸	3,900	2,185.00	8,521,500	

西日本鉄道	82,000	483.00	39,606,000	
ハマキョウレックス	2,400	3,735.00	8,964,000	
サカイ引越センター	1,300	3,480.00	4,524,000	
近畿日本鉄道	614,000	382.00	234,548,000	貸付株式数 181,000株
阪急阪神HLDGS	409,000	626.00	256,034,000	
南海電鉄	130,000	466.00	60,580,000	貸付株式数 36,000株 (35,000株)
京阪電鉄	140,000	614.00	85,960,000	貸付株式数 38,000株
神戸電鉄	28,000	345.00	9,660,000	
名古屋鉄道	221,000	438.00	96,798,000	貸付株式数 63,000株 (63,000株)
山陽電鉄	30,000	444.00	13,320,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
トランコム	2,100	4,780.00	10,038,000	
日本通運	244,000	594.00	144,936,000	
ヤマトホールディングス	112,400	2,481.50	278,920,600	貸付株式数 31,700株 (31,700株)
山九	75,000	490.00	36,750,000	
日新	33,000	271.00	8,943,000	
丸全昭和運輸	25,000	375.00	9,375,000	
センコー	27,000	555.00	14,985,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
日本梱包運輸	19,800	1,768.00	35,006,400	
福山通運	36,000	636.00	22,896,000	貸付株式数 10,000株
セイノーホールディングス	48,000	1,152.00	55,296,000	
神奈川中央交通	18,000	570.00	10,260,000	
日立物流	12,300	1,464.00	18,007,200	
日本郵船	520,000	337.00	175,240,000	
商船三井	322,000	362.00	116,564,000	貸付株式数 103,000株
川崎汽船	273,000	307.00	83,811,000	
NSユニテッド海運	31,000	322.00	9,982,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
飯野海運	34,300	658.00	22,569,400	
日本航空	116,400	3,715.00	432,426,000	
ANAホールディングス	1,207,000	296.50	357,875,500	
三菱倉庫	41,000	1,862.00	76,342,000	
三井倉庫HOLD	41,000	416.00	17,056,000	
住友倉庫	46,000	653.00	30,038,000	
渋沢倉庫	21,000	337.00	7,077,000	
ヤマタネ	49,000	172.00	8,428,000	

東陽倉庫	26,000	305.00	7,930,000	
日本トランスシティ	21,000	377.00	7,917,000	
安田倉庫	7,300	1,019.00	7,438,700	
東洋埠頭	33,000	200.00	6,600,000	
上組	69,000	1,058.00	73,002,000	
郵船ロジスティクス	6,900	1,363.00	9,404,700	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
近鉄エクスプレス	5,400	4,445.00	24,003,000	
東京放送HD	37,400	1,402.00	52,434,800	貸付株式数 10,100株 (10,100株)
日本テレビHLD S	55,200	1,772.00	97,814,400	
テレビ朝日HD	17,100	1,887.00	32,267,700	
スカパーJ S A T H D	49,900	709.00	35,379,100	
テレビ東京HD	5,600	2,680.00	15,008,000	
コネクシオ	6,700	1,117.00	7,483,900	
日本電信電話	236,800	6,175.00	1,462,240,000	
K D D I	205,100	7,687.00	1,576,603,700	
光通信	5,500	7,130.00	39,215,000	貸付株式数 1,600株
N T T ドコモ	497,600	1,769.50	880,503,200	
G M O インターネット	21,200	1,050.00	22,260,000	
K A D O K A W A ・ D W A N G O	16,400	1,997.00	32,750,800	
学研ホールディングス	32,000	244.00	7,808,000	
ゼンリン	9,800	1,324.00	12,975,200	貸付株式数 2,500株
東京電力	521,100	459.00	239,184,900	
中部電力	187,500	1,382.00	259,125,000	
関西電力	251,000	1,190.50	298,815,500	
中国電力	84,200	1,552.00	130,678,400	
北陸電力	60,100	1,524.00	91,592,400	
東北電力	152,800	1,408.00	215,142,400	
四国電力	55,400	1,472.00	81,548,800	
九州電力	135,500	1,250.00	169,375,000	
北海道電力	58,000	967.00	56,086,000	
沖縄電力	4,400	3,675.00	16,170,000	
電源開発	41,100	3,955.00	162,550,500	
東京瓦斯	740,000	628.50	465,090,000	
大阪瓦斯	627,000	435.00	272,745,000	
東邦瓦斯	154,000	594.00	91,476,000	
北海道瓦斯	28,000	286.00	8,008,000	貸付株式数 7,000株 (2,000株)

西部瓦斯	74,000	258.00	19,092,000	
静岡瓦斯	18,600	730.00	13,578,000	
松竹	41,000	1,105.00	45,305,000	
東宝	43,400	2,690.00	116,746,000	
エイチ・アイ・エス	10,600	3,415.00	36,199,000	
東映	25,000	689.00	17,225,000	
N T Tデータ	37,800	4,305.00	162,729,000	
共立メンテナンス	3,600	5,680.00	20,448,000	貸付株式数 1,000株
イチネンホールディングス	10,200	993.00	10,128,600	貸付株式数 2,900株 (2,900株)
建設技術研究所	4,800	1,588.00	7,622,400	貸付株式数 1,300株
アインファーマシーズ	7,100	3,325.00	23,607,500	
東京テアトル	47,000	140.00	6,580,000	
よみうりランド	17,000	488.00	8,296,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
東京都競馬	49,000	299.00	14,651,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
常磐興産	46,000	150.00	6,900,000	
カナモト	9,200	3,080.00	28,336,000	
東京ドーム	50,000	468.00	23,400,000	
D T S	7,400	2,319.00	17,160,600	
スクウェア・エニックス・HD	22,300	2,417.00	53,899,100	
シーイーシー	6,200	1,058.00	6,559,600	
カプコン	16,200	1,767.00	28,625,400	貸付株式数 4,800株 (4,800株)
西尾レントオール	5,400	3,765.00	20,331,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本空港ビルデング	21,100	4,955.00	104,550,500	
トランス・コスモス	9,400	1,979.00	18,602,600	
乃村工藝社	14,100	908.00	12,802,800	
ジャステック	8,700	772.00	6,716,400	貸付株式数 2,400株
S C S K	14,800	2,876.00	42,564,800	
藤田観光	31,000	354.00	10,974,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
K N T - C Tホールディングス	38,000	163.00	6,194,000	
日本管財	4,000	2,638.00	10,552,000	
トーカイ	3,300	3,490.00	11,517,000	
セコム	62,000	6,847.00	424,514,000	
アイネス	11,200	868.00	9,721,600	
丹青社	8,500	827.00	7,029,500	

メイテック	9,200	3,370.00	31,004,000	
T K C	6,400	1,924.00	12,313,600	
アサツー ディ・ケイ	12,700	3,075.00	39,052,500	
富士ソフト	9,400	2,489.00	23,396,600	
応用地質	7,600	1,793.00	13,626,800	
船井総研ホールディング	11,300	996.00	11,254,800	
N S D	14,800	1,686.00	24,952,800	
コナミ	25,300	2,177.00	55,078,100	
ベネッセホールディングス	23,300	3,585.00	83,530,500	貸付株式数 6,300株 (6,300株)
イオンディライト	6,800	2,712.00	18,441,600	
ナック	5,700	1,067.00	6,081,900	
ニチイ学館	14,900	939.00	13,991,100	貸付株式数 4,800株 (4,800株)
ダイセキ	11,300	2,047.00	23,131,100	
日鉄住金物産	39,000	407.00	15,873,000	
トラスコ中山	8,000	3,150.00	25,200,000	
ヤマダ電機	238,300	375.00	89,362,500	貸付株式数 71,100株 (71,100株)
オートバックスセブン	21,500	1,674.00	35,991,000	貸付株式数 6,200株 (6,200株)
アークランドサカモト	5,000	2,259.00	11,295,000	
ニトリホールディングス	25,900	6,730.00	174,307,000	
吉野家ホールディングス	17,500	1,343.00	23,502,500	
加藤産業	9,000	2,176.00	19,584,000	
イエローハット	6,100	2,364.00	14,420,400	
富士エレクトロニクス	5,900	1,321.00	7,793,900	
松屋フーズ	4,000	2,331.00	9,324,000	
J B C Cホールディングス	10,400	746.00	7,758,400	
サガミチェーン	10,000	1,033.00	10,330,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
日 伝	3,000	2,422.00	7,266,000	
因幡電機産業	8,800	3,820.00	33,616,000	
王将フードサービス	4,700	4,270.00	20,069,000	貸付株式数 1,300株
プレナス	7,400	2,032.00	15,036,800	
ミニストップ	6,200	1,568.00	9,721,600	
アークス	10,800	2,435.00	26,298,000	
バ ロ ー	13,800	2,058.00	28,400,400	
ミスミグループ本社	22,600	3,770.00	85,202,000	

江守グループHD	3,800	1,085.00	4,123,000	貸付株式数 800株 (800株)
ベルク	3,200	3,525.00	11,280,000	
ファーストリテイリング	12,100	43,715.00	528,951,500	貸付株式数 3,500株
ソフトバンク	320,400	7,200.00	2,306,880,000	
スズケン	24,800	3,180.00	78,864,000	
サンドラッグ	12,800	4,670.00	59,776,000	
サクスパーホールディング	5,300	1,491.00	7,902,300	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ジェコス	4,900	1,795.00	8,795,500	
ベルーナ	18,000	496.00	8,928,000	
合計			123,389,464,940	

(注) 1. 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

2. 貸付株式数のうち（括弧書）の数字は、委託者の利害関係人である大和証券株式会社に対する  
貸付であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「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25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	398,107,497	537,997,146
コール・ローン	74,978,643	165,308,800



株式	67,190,451,296	75,952,619,888
投資証券	1,259,965,705	1,756,088,720
派生商品評価勘定	2,317,986	10,042,849
未収入金	60,577,489	1,440,826
未収配当金	96,699,442	97,472,217
差入委託証拠金	409,057,773	483,498,088
流動資産合計	69,492,155,831	79,004,468,534
資産合計	69,492,155,831	79,004,468,534
負債の部		
流動負債		
未払解約金	73,943,400	67,318,000
流動負債合計	73,943,400	67,318,000
負債合計	73,943,400	67,318,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 44,891,925,596	40,934,323,072
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	24,526,286,835	38,002,827,462
元本等合計	69,418,212,431	78,937,150,534
純資産合計	69,418,212,431	78,937,150,534
負債純資産合計	69,492,155,831	79,004,468,534

## 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25年12月19日 至 平成26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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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)新株予約権証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1. 1 期首	平成24年12月19日	平成25年12月19日
期首元本額	51,632,637,762円	44,891,925,596円
期中追加設定元本額	3,307,895,188円	4,855,554,109円
期中一部解約元本額	10,048,607,354円	8,813,156,633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	1,566,664,619円	1,375,301,973円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	66,995,414円	51,988,101円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,024,274,926円	770,197,210円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	112,588,725円	83,075,634円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	3,304,623,498円	2,454,327,535円
D-I's 外国株式インデッ クス	650,166円	1,080,494円
DCダイワ外国株式インデッ クス	18,329,380,938円	19,816,726,749円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	466,776,591円	404,159,831円

ダイワ・ライフ・バランス50	569,787,955円	574,230,884円
ダイワ・ライフ・バランス70	398,178,405円	407,312,710円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,471,238,560円	1,474,330,436円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	6,111,206円	6,644,893円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,992,645円	9,404,656円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,816,460円	1,985,056円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	73,963,497円	4,627,190円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	1,082,681,103円	30,611,679円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	24,042,451円	20,450,186円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	254,295,810円	178,130,353円
ダイワ世界バランスファンド40VA	3,706,456,472円	2,710,722,413円
ダイワ世界バランスファンド60VA	936,084,750円	665,345,093円
ダイワ・バランスファンド35VA	7,995,137,542円	6,337,064,025円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	373,999,026円	281,738,024円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	656,185円	134,587,395円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,982,187,147円	3,009,097,274円
ダイワライフスタイル25	20,324,526円	19,098,014円
ダイワライフスタイル50	64,279,582円	63,402,328円
ダイワライフスタイル75	50,737,397円	48,682,936円
計	44,891,925,596円	40,934,323,072円
2. 期末日における受益権の総数	44,891,925,596口	40,934,323,072口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成25年12月19日 至 平成26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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従って外国の取引所における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成25年12月18日現在	平成26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）
株式	1,480,971,021	2,842,004,079
投資証券	27,681,707	4,280,226
合計	1,508,652,728	2,846,284,305

（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25年12月3日から平成25年12月18日まで、及び平成26年12月2日から平成26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25年12月18日 現在				平成26年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数 先物取引								
買 建	909,362,700	-	911,676,600	2,313,900	1,122,993,632	-	1,133,036,481	10,042,849
合計	909,362,700	-	911,676,600	2,313,900	1,122,993,632	-	1,133,036,481	10,042,849

（注） 1. 時価の算定方法

株値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. 株値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25年12月18日 現在				平成26年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	85,409,286	-	85,405,200	4,086	-	-	-	-
イギリス・ポンド	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	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25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.5463円	1.9284円
(1万口当たり純資産額)	(15,463円)	(19,284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	
	PALO ALTO NETWORKS INC	1,400	120.030	168,042.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,200	166.400	199,680.000	
	AVON PRODUCTS	10,700	9.330	99,831.000	
	ABBOTT LABS	32,900	44.260	1,456,154.000	
	ALCOA	25,700	15.050	386,785.000	
	VERISK ANALYTICS INC-CL A	3,300	63.750	210,375.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	8,700	52.310	455,097.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	6,900	52.640	363,216.000	
	KLX INC	1,150	42.450	48,817.500	
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	6,329	61.500	389,233.500	
	AFLAC INC	10,100	59.070	596,607.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	2,900	57.080	165,532.000	
	MONSTER BEVERAGE CORP	3,200	108.560	347,392.000	
	ADOBE SYSTEMS	10,400	73.995	769,548.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,100	256.760	282,436.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,500	53.240	133,100.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,800	14.830	100,844.000	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,000	38.100	76,200.000	
	GARMIN LTD	2,600	53.380	138,788.000	
	AETNA INC	7,979	87.180	695,609.220	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	4,700	140.960	662,512.000	
	ALTERA CORPORATION	7,200	37.410	269,352.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL	16,000	97.660	1,562,560.000	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,751	32.930	123,520.430	
	WR BERKLEY CORP	2,400	50.650	121,560.000	
	AUTOZONE INC	700	602.460	421,722.000	
	DOLLAR TREE INC	4,700	68.060	319,882.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL	2,400	65.990	158,376.000	
	CELANESE CORP-SERIES A	3,600	57.300	206,280.000	
D.R.HORTON INC	6,566	24.190	158,831.540		
CONTINENTAL RESOURCES	2,100	36.510	76,671.000		
DENTSPLY INTERNATIONAL IN	3,300	53.190	175,527.000		



AUTODESK INC	5,200	57.010	296,452.000	
MOODY'S CORP	4,100	96.670	396,347.000	
DEVON ENERGY CORPORATION	8,500	58.470	496,995.000	
ALBEMARLE CORP	2,200	57.200	125,840.000	
CONSOL ENERGY INC	5,400	34.900	188,460.000	
ALLIANT ENERGY CORP	2,500	64.160	160,400.000	
CITIGROUP INC	66,123	52.450	3,468,151.350	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,600	84.685	897,661.000	
AMERICAN ELEC POWER	10,500	58.820	617,610.000	
NETSUITE INC	600	104.990	62,994.000	
ALLEGHANY CORP	400	442.600	177,040.000	
DUN&BRADSTREET CORP	900	116.120	104,508.000	
HESS CORP	6,000	69.030	414,180.000	
COVIDIEN PLC	9,925	101.260	1,005,005.500	
DAVITA HEALTHCAR	3,800	74.330	282,454.000	
DANAHER CORP	14,000	83.940	1,175,160.000	
AVNET INC	3,400	42.590	144,806.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE	2,570	221.590	569,486.300	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,800	69.150	262,770.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	14,300	49.640	709,852.000	
BUNGE LIMITED	3,300	90.400	298,320.000	
TE CONNECTIVITY LTD	8,825	61.920	546,444.000	
APPLE INC	130,300	109.410	14,256,123.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	10,200	62.420	636,684.000	
BOEING CO	14,900	125.060	1,863,394.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,515	50.740	178,351.100	
MEADWESTVACO CORP	3,800	44.010	167,238.000	
SPECTRA ENERGY CORP	14,696	34.770	510,979.920	
BECTON DICKINSON & CO	4,300	136.800	588,240.000	
NISOURCE INC	7,100	40.300	286,130.000	
JOY GLOBAL INC	2,700	46.140	124,578.000	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	3,400	71.880	244,392.000	
BARD(C.R.) INC	1,700	168.870	287,079.000	
BANK OF NEW YORK MELLON	25,071	40.350	1,011,614.850	
VERIZON COMMUNICATIONS	90,254	46.440	4,191,395.760	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	24,900	148.450	3,696,405.000	
ANSYS INC	2,100	81.660	171,486.000	
H&R BLOCK INC	6,200	32.820	203,484.000	
BB&T CORPORATION	16,200	37.520	607,824.000	

HOSPIRA INC	3,620	60.250	218,105.000	
BROADCOM CORP-CL A	11,650	42.230	491,979.500	
BAKER HUGHES INC	9,723	56.350	547,891.050	
BRISTOL MYERS SQUIBB	36,400	59.190	2,154,516.000	
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,400	128.750	180,250.000	
JPMORGAN CHASE & CO	81,720	59.770	4,884,404.400	
LEGG MASON INC	2,650	51.460	136,369.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	5,900	84.000	495,600.000	
CIGNA CORP	5,900	101.600	599,440.000	
LKQ CORP	6,800	27.400	186,320.000	
COMPUTER SCIENCES CORP	3,400	62.180	211,412.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,300	95.840	124,592.000	
FRONTIER COMMUNICATIONS	22,142	6.550	145,030.100	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,700	87.190	235,413.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,160	129.270	537,763.200	
DOLLAR GENERAL CORP	6,500	71.020	461,630.000	
SERVICENOW INC	3,000	65.690	197,070.000	
CATERPILLAR INC DEL	12,800	89.750	1,148,800.000	
GENWORTH FINANCIAL INC-A	11,400	7.930	90,402.000	
CMS ENERGY CORP	6,000	33.930	203,580.000	
HERBALIFE LTD	2,200	37.740	83,028.000	
MOSAIC CO/THE	7,300	44.360	323,828.000	
DELTA AIR LINES INC	4,400	46.170	203,148.000	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	4,600	98.580	453,468.000	
CORNING INC	27,600	21.290	587,604.000	
CISCO SYSTEMS	111,000	26.810	2,975,910.000	
DU PONT	19,700	70.260	1,384,122.000	
MORGAN STANLEY	31,700	36.730	1,164,341.000	
DOW CHEMICAL	25,700	44.550	1,144,935.000	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	5,600	98.990	554,344.000	
ENSCO PLC-CL A	5,500	28.430	156,365.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,300	49.570	114,011.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,000	83.750	335,000.000	
AGCO CORP	2,500	44.160	110,400.000	
DOMINION RESOURCES INC/VA	12,800	73.970	946,816.000	
DENBURY RESOURCES INC	8,700	7.170	62,379.000	
DEERE & CO	7,300	88.740	647,802.000	
AIRGAS INC	1,500	112.890	169,335.000	
QUANTA SERVICES INC	4,900	26.630	130,487.000	

TIME WARNER INC	18,433	82.280	1,516,667.240	
VMWARE INC-CLASS A	1,900	78.650	149,435.000	
URBAN OUTFITTERS INC	3,000	33.320	99,960.000	
NASDAQ OMX GROUP	2,700	46.530	125,631.000	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,200	57.760	69,312.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	6,600	64.780	427,548.000	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,900	82.900	240,410.000	
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,100	83.100	174,510.000	
COLGATE PALMOLIVE CO	20,100	68.660	1,380,066.000	
AMETEK INC	5,625	50.110	281,868.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,100	77.080	238,948.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,600	75.600	725,760.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	9,400	139.330	1,309,702.000	
SCANA CORP	3,100	58.760	182,156.000	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	2,800	136.650	382,620.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,200	202.540	243,048.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL IN	700	649.150	454,405.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,300	21.650	158,045.000	
CUMMINS INC	3,900	140.420	547,638.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,900	19.670	214,403.000	
HANESBRANDS INC	2,100	110.890	232,869.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS	7,000	25.300	177,100.000	
LORILLARD INC	7,700	61.790	475,783.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,100	194.690	214,159.000	
SBA COMMUNICATIONS CORP-C	2,800	111.520	312,256.000	
NIELSEN NV	7,000	43.800	306,600.000	
KINDER MORGAN INC	21,081	39.890	840,921.090	
HCA HOLDINGS INC	6,800	72.580	493,544.000	
CABOT OIL & GAS CORP	9,600	31.660	303,936.000	
T-MOBILE US INC	5,650	25.100	141,815.000	
COCA COLA CO	86,400	41.550	3,589,920.000	
COCA-COLA ENTERPRISES	5,000	42.750	213,750.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,400	43.275	190,410.000	
EATON VANCE CORP	3,700	41.010	151,737.000	
FMC TECHNOLOGIES INC	5,300	44.320	234,896.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,700	54.640	475,368.000	
CSX CORP	21,500	35.770	769,055.000	
FLUOR CORP	3,700	57.950	214,415.000	
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,000	103.560	207,120.000	

EXPEDIA INC	2,375	86.860	206,292.500	
AUTOLIV INC	2,200	102.970	226,534.000	
AMAZON.COM INC	8,500	298.880	2,540,480.000	
FLOWSERVE CORP	3,200	56.300	180,160.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,300	129.740	298,402.000	
EXXON MOBIL CORP	93,255	89.020	8,301,560.100	
EQUINIX INC	1,128	224.670	253,427.760	
FLIR SYSTEMS INC	3,100	32.370	100,347.000	
AES CORP	15,700	13.130	206,141.000	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	2,000	121.890	243,780.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,100	168.920	185,812.000	
EOG RESOURCES INC	12,000	91.140	1,093,680.000	
EQUITABLE RESOURCES INC	3,500	79.920	279,720.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	3,900	61.480	239,772.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,900	90.560	443,744.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,290	39.760	289,850.400	
FORD MOTOR CO	77,623	14.450	1,121,652.350	
MACY'S INC	7,898	62.760	495,678.480	
DISCOVERY COMMUNICATION-A	3,440	34.220	117,716.800	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	48.390	236,481.930	
LIBERTY MEDIA CORP	2,100	33.820	71,022.000	
DISCOVERY COMMUNICATION-C	6,620	33.520	221,902.400	
FOSSIL INC	1,300	106.550	138,515.000	
NEXTERA ENERGY INC	9,600	103.120	989,952.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	22,308	22.130	493,676.040	
US BANCORP	38,700	43.920	1,699,704.000	
UNITED RENTALS INC	2,200	99.190	218,218.000	
FAMILY DOLLAR STORES	2,300	79.250	182,275.000	
F5 NETWORKS INC	1,600	129.950	207,920.000	
FASTENAL CO	6,400	45.380	290,432.000	
FISERV INC	5,600	70.050	392,280.000	
GENERAL ELECTRIC CO	217,900	24.660	5,373,414.000	
GENERAL MOTORS CO	28,200	31.150	878,430.000	
TRIPADVISOR INC	2,700	72.530	195,831.000	
LINKEDIN CORP-A	2,400	219.780	527,472.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,200	137.230	850,826.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,600	185.030	1,591,258.000	
GAMESTOP CORP-CLASS A	3,000	32.690	98,070.000	
GOOGLE INC-CL A	6,200	506.450	3,139,990.000	

GOOGLE INC-CL C	6,300	504.890	3,180,807.000	
GENERAL MILLS INC	13,100	52.190	683,689.000	
FIRSTENERGY CORP	9,368	38.060	356,546.080	
GENUINE PARTS CO	3,500	103.900	363,650.000	
FIFTH THIRD BANCORP	18,600	19.600	364,560.000	
MEDIVATION INC	1,500	106.620	159,930.000	
HARRIS CORP	2,400	69.950	167,880.000	
AMERICAN AIRLINES GROUP	4,200	48.800	204,960.000	
HALLIBURTON CO	18,600	39.440	733,584.000	
HOME DEPOT INC	29,400	98.940	2,908,836.000	
ASSURANT INC	1,600	66.190	105,904.000	
HERSHEY CO/THE	3,500	100.330	351,155.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,800	62.980	302,304.000	
HUMANA INC	3,400	143.330	487,322.000	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	4,300	76.940	330,842.000	
HELMERICH & PAYNE	2,500	65.020	162,550.000	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	13,600	8.900	121,040.000	
HENRY SCHEIN INC	2,000	134.090	268,180.000	
HEWLETT-PACKARD CO	40,200	38.650	1,553,730.000	
DIRECTV	10,182	83.210	847,244.220	
HOLLYFRONTIER CORP	4,300	36.900	158,670.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,200	58.110	185,952.000	
INT'L BUSINESS MACHINES	20,600	151.930	3,129,758.000	
INTERNATIONAL PAPER	9,100	53.460	486,486.000	
ZOETIS INC	10,900	41.130	448,317.000	
INGERSOLL-RAND CO-CL A	5,729	61.980	355,083.420	
CHENIERE ENERGY INC	5,000	65.480	327,400.000	
LEGGETT & PLATT INC	3,100	42.010	130,231.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	11,923	46.750	557,400.250	
JUNIPER NETWORKS INC	9,500	21.420	203,490.000	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	2,400	100.350	240,840.000	
JOHNSON & JOHNSON	61,500	104.070	6,400,305.000	
ABBVIE INC	35,000	66.570	2,329,950.000	
HOLOGIC INC	5,100	26.370	134,487.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	8,300	113.860	945,038.000	
KROGER CO	10,000	62.460	624,600.000	
KLA-TENCOR CORPORATION	3,600	67.750	243,900.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	5,900	185.150	1,092,385.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,700	148.060	251,702.000	

L BRANDS INC	5,300	82.740	438,522.000	
LOWE'S COS INC	21,600	65.950	1,424,520.000	
ELI LILLY & CO	21,700	70.280	1,525,076.000	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN	4,100	47.940	196,554.000	
LAM RESEARCH CORP	3,600	78.330	281,988.000	
RANGE RESOURCES CORP	3,700	61.910	229,067.000	
LOEWS CORP	8,000	39.690	317,520.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,749	55.590	319,586.910	
MCDONALD'S CORP	21,100	91.650	1,933,815.000	
3M CO	13,300	160.600	2,135,980.000	
FACEBOOK INC-A	43,100	76.110	3,280,341.000	
MANPOWER INC	2,000	65.380	130,760.000	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	6,000	88.550	531,300.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,300	111.260	144,638.000	
CONCHO RESOURCES INC	2,400	91.590	219,816.000	
PHILLIPS 66	12,400	68.360	847,664.000	
MURPHY OIL CORP	4,000	47.520	190,080.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	8,900	18.010	160,289.000	
MATTEL INC	7,900	30.760	243,004.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SH	2,800	72.980	204,344.000	
MYLAN INC	8,100	55.255	447,565.500	
METLIFE INC	21,000	51.790	1,087,590.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	8,400	14.200	119,280.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,028	63.990	321,741.720	
MONSANTO CO	11,506	118.400	1,362,310.400	
METTLER-TOLEDO INTER	700	290.150	203,105.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,000	107.930	323,790.000	
MERCK & CO INC	63,321	57.630	3,649,189.230	
MASCO CORP	8,100	24.430	197,883.000	
M & T BANK CORP	2,700	121.860	329,022.000	
MARSH & MCLENNAN COS	12,000	56.990	683,880.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	4,982	76.740	382,318.680	
WORKDAY INC-CLASS A	2,200	80.620	177,364.000	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4,700	75.650	355,555.000	
TOWERS WATSON & CO-CL A	1,500	112.990	169,485.000	
VANTIV INC - CL A	3,300	33.750	111,375.000	
FIREEYE INC	1,200	28.610	34,332.000	
REALOGY HOLDINGS CORP	3,600	43.590	156,924.000	
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	1,200	114.490	137,388.000	

NETAPP INC	7,300	40.850	298,205.000	
NIKE INC -CL B	14,900	94.500	1,408,050.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,700	105.250	705,175.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,500	43.710	196,695.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL	3,000	55.670	167,010.000	
ALLY FINANCIAL INC	6,000	22.160	132,960.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,300	143.620	617,566.000	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,800	71.000	482,800.000	
NEWMONT MINIG CORP	11,200	18.500	207,200.000	
KRAFT FOODS GROUP INC	13,303	59.560	792,326.680	
ADT CORP/THE	3,962	32.060	127,021.720	
MCKESSON CORP	5,000	205.280	1,026,400.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,600	30.790	203,214.000	
XYLEM INC	4,200	36.910	155,022.000	
PHILIP MORRIS INTERNATION	34,200	81.850	2,799,270.000	
NUCOR CORP	7,200	49.490	356,328.000	
NABORS INDUSTRIES LTD	6,000	11.490	68,940.000	
WESTERN UNION CO	12,546	17.470	219,178.620	
NEWELL RUBBERMAID INC	6,000	35.870	215,220.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM	16,800	77.800	1,307,040.000	
OMNICARE INC	2,200	71.480	157,256.000	
LIBERTY MEDIA CORP-C	4,500	33.620	151,290.000	
PAYCHEX INC	7,200	47.180	339,696.000	
PATTERSON COS INC	2,300	47.990	110,377.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,200	192.200	422,840.000	
ALTRIA GROUP INC	43,700	49.940	2,182,378.000	
OWENS-ILLINOIS INC	4,600	24.630	113,298.000	
PG & E CORPORATION	10,200	52.730	537,846.000	
PFIZER INC	138,463	31.120	4,308,968.560	
XCEL ENERGY INC	11,200	34.750	389,200.000	
STRYKER CORP	7,500	92.830	696,225.000	
PARKER HANNIFIN CORP	3,400	123.510	419,934.000	
PALL CORP	2,400	95.300	228,720.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES	3,200	144.800	463,360.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,400	143.950	201,530.000	
PROCTER & GAMBLE CO	59,237	90.700	5,372,795.900	
EXELON CORP	18,822	36.580	688,508.760	
ALEXION PHARMACEUTICALS	4,300	182.080	782,944.000	
CONOCOPHILLIPS	27,000	66.940	1,807,380.000	

PEPSICO INC	32,800	93.720	3,074,016.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,200	86.750	884,850.000	
AMERICAN WATER WORKS CO	4,100	51.760	212,216.000	
ACCENTURE LTD-CL A	13,900	85.300	1,185,670.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,700	49.940	134,838.000	
PENTAIR PLC	4,305	63.710	274,271.550	
QUALCOMM INC	36,500	72.210	2,635,665.000	
PARTNERRE LTD	1,000	112.500	112,500.000	
INVESCO LTD	9,550	39.240	374,742.000	
ADVANCE AUTO PARTS	1,650	159.550	263,257.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,600	50.180	331,188.000	
MDU RESOURCES GROUP INC	4,200	22.650	95,130.000	
ENERGEN CORP	2,000	61.490	122,980.000	
RAYTHEON CO	6,900	102.650	708,285.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	1,800	77.850	140,130.000	
RED HAT INC	4,200	59.480	249,816.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,700	410.990	698,683.000	
REPUBLIC SERVICES INC	6,600	39.310	259,446.000	
PRICELINE.COM INC	1,100	1,075.340	1,182,874.000	
ROSS STORES INC	4,600	90.770	417,542.000	
QEP RESOURCES INC	4,400	19.910	87,604.000	
RESMED INC	3,200	54.950	175,840.000	
QUEST DIAGNOSTICS	3,300	63.780	210,474.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,100	57.620	178,622.000	
REYNOLDS AMERICAN INC	7,200	63.940	460,368.000	
RALPH LAUREN CORP	1,400	179.200	250,880.000	
AUTONATION INC	1,700	57.070	97,019.000	
ROCKWELL COLLINS INC.	2,700	83.490	225,423.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	30,635	10.220	313,089.700	
CHEVRON CORP	41,618	106.020	4,412,340.360	
EDISON INTERNATIONAL	6,600	63.890	421,674.000	
TESLA MOTORS INC	1,900	205.820	391,058.000	
SYMANTEC CORP	15,700	25.190	395,483.000	
ENDO INTERNATIONAL PLC	3,300	69.590	229,647.000	
STANLEY BLACK & DECKER IN	3,322	94.390	313,563.580	
SYNOPSYS INC	3,400	42.970	146,098.000	
CHARTER COMMUNICATION-A	1,700	162.250	275,825.000	
CBRE GROUP INC	7,000	33.120	231,840.000	
TWITTER INC	7,100	35.570	252,547.000	



COBALT INT'L ENERGY	7,200	8.550	61,560.000	
NAVIENT CORP	9,800	21.260	208,348.000	
SANDISK CORP	5,100	98.740	503,574.000	
SOUTHERN CO	19,800	48.300	956,340.000	
SYSCO CORP	13,200	40.120	529,584.000	
PHARMACYCLICS INC	1,500	131.030	196,545.000	
TRAVELERS COS INC	7,323	104.410	764,594.430	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	7,900	30.200	238,580.000	
SPX CORP	1,100	80.040	88,044.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,200	39.730	127,136.000	
STERICYCLE INC	1,900	128.480	244,112.000	
SCHLUMBERGER LTD	28,167	82.880	2,334,480.960	
SENSATA TECHNOLOGIES	3,500	51.000	178,500.000	
RACKSPACE HOSTING INC	2,700	46.500	125,550.000	
AT&T INC	113,795	32.670	3,717,682.650	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,800	40.120	152,456.000	
SIGMA-ALDRICH	2,600	135.980	353,548.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,900	252.330	479,427.000	
SEMPRA ENERGY	5,000	106.860	534,300.000	
TIFFANY & CO	3,000	104.190	312,570.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,400	65.010	481,074.000	
TEXAS INSTRUMENT INC	23,000	53.500	1,230,500.000	
SALESFORCE.COM INC	12,800	57.000	729,600.000	
SUPERIOR ENERGY SERVICES	4,200	19.840	83,328.000	
TRW AUTOMOTIVE	2,500	102.120	255,300.000	
ROCK-TENN COMPANY-CL A	3,400	60.940	207,196.000	
TIME WARNER CABLE	6,053	144.040	871,874.120	
TYCO INTERNATIONAL PLC	9,525	41.850	398,621.250	
TESORO CORP	2,800	74.530	208,684.000	
UNION PACIFIC CORP	19,500	114.920	2,240,940.000	
MARATHON OIL CORP	15,100	26.670	402,717.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	6,100	84.730	516,853.000	
UNITED TECHNOLOGIES	18,700	113.900	2,129,930.000	
UNITED PARCEL SERVICE-B	15,300	108.550	1,660,815.000	
UNUM GROUP	5,900	33.260	196,234.000	
SPRINT CORP	17,765	3.970	70,527.050	
QUINTILES TRANSNATIONAL	1,200	57.540	69,048.000	
VOYA FINANCIAL INC	4,000	41.130	164,520.000	
AMEREN CORPORATION	5,500	44.060	242,330.000	

UNITEDHEALTH GROUP INC	21,026	99.140	2,084,517.640	
VERISIGN INC	2,800	56.260	157,528.000	
VALERO ENERGY CORP	11,692	47.790	558,760.680	
ULTA SALON COSME	1,400	130.860	183,204.000	
FNF GROUP	5,638	33.080	186,505.040	
UNIVERSAL HEALTH SVC-B	2,000	105.600	211,200.000	
WEYERHAEUSER CO	11,894	35.010	416,408.940	
ANTHEM INC	5,900	123.710	729,889.000	
THE WALT DISNEY CO.	35,600	91.380	3,253,128.000	
WELLS FARGO & CO	107,972	53.790	5,807,813.880	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	1,800	75.680	136,224.000	
WASTE MANAGEMENT INC	9,700	49.550	480,635.000	
WILLIAMS COMPANY	15,700	43.630	684,991.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,200	76.900	246,080.000	
WHITING PETROLEUM CORP	2,700	30.200	81,540.000	
WHIRLPOOL CORP	1,800	188.930	340,074.000	
WAL-MART STORES	34,900	84.230	2,939,627.000	
ZIMMER HOLDINGS INC	3,700	111.920	414,104.000	
WEATHERFORD INTERNATIONAL	16,800	11.380	191,184.000	
WYNN RESORTS LTD	1,800	138.970	250,146.000	
XEROX CORP	24,644	13.460	331,708.240	
TJX COMPANIES INC	15,000	65.360	980,400.000	
WATERS CORP	2,000	113.350	226,700.000	
UNITED CONTINENTAL HLDS	2,200	62.850	138,270.000	
ACTAVIS INC	5,750	260.900	1,500,175.000	
WHOLE FOODS MARKET INC	7,800	48.555	378,729.000	
WALGREEN CO	19,500	71.990	1,403,805.000	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	3,800	44.630	169,594.000	
WESTERN DIGITAL CORP	4,900	107.950	528,955.000	
WISCONSIN ENERGY CORP	5,100	51.190	261,069.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	11,500	41.670	479,205.000	
VISA INC-CLASS A SHS	10,800	259.080	2,798,064.000	
PPL CORPORATION	14,300	34.840	498,212.000	
PEPCO HOLDINGS INC	5,600	27.050	151,480.000	
PULTE GROUP INC	8,200	20.470	167,854.000	
PPG INDUSTRIES INC	3,100	222.260	689,006.000	
NORTHERN TRUST CORP	4,900	66.360	325,164.000	
PRECISION CASTPARTS CORP	3,200	233.700	747,840.000	
NVIDIA CORP	12,750	20.140	256,785.000	

PNC FINANCIAL SERVICES	11,893	89.440	1,063,709.920	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	10,350	28.190	291,766.500	
TERADATA CORP	3,500	41.280	144,480.000	
TYSON FOODS INC-CL A	7,000	39.460	276,220.000	
NETFLIX.COM INC	1,300	333.650	433,745.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC	8,600	124.770	1,073,022.000	
NRG ENERGY INC	7,700	26.750	205,975.000	
TORCHMARK CORP	2,975	53.020	157,734.500	
FIRST REPUBLIC BANK	3,000	51.120	153,360.000	
TEXTRON INC	6,300	40.650	256,095.000	
TWENTY-FIRST CENTURY-A	30,450	37.230	1,133,653.500	
TWENTY-FIRST CENTURY-B	9,600	35.795	343,632.000	
NEWS CORP - CLASS A	8,337	14.890	124,137.930	
OGE ENERGY CORP	4,700	34.340	161,398.000	
OMNICOM GROUP	5,700	76.240	434,568.000	
ORACLE CORPORATION	77,283	41.160	3,180,968.280	
MASTERCARD INC-CLASS A	21,600	84.730	1,830,168.000	
ONEOK INC	4,600	47.490	218,454.000	
OCEANEERING INTL INC	2,500	58.840	147,100.000	
CENTURYLINK INC	12,695	38.690	491,169.550	
ROPER INDUSTRIES INC	2,300	151.950	349,485.000	
YUM! BRANDS INC	9,500	70.600	670,700.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,200	282.880	339,456.000	
MOLSON COORS BREWING CO-B	3,500	73.660	257,810.000	
NOBLE ENERGY INC	8,200	47.940	393,108.000	
BANK OF AMERICA CORP	230,201	17.260	3,973,269.260	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL	3,400	87.210	296,514.000	
NORDSTROM INC	3,200	75.770	242,464.000	
AMERICAN EXPRESS CO	20,300	90.440	1,835,932.000	
ANALOG DEVICES INC	7,000	55.990	391,930.000	
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,000	34.800	208,800.000	
AMERICAN INTL GROUP	30,972	54.020	1,673,107.440	
ASHLAND INC	1,600	115.770	185,232.000	
ANADARKO PETROLEUM CORP	11,300	78.600	888,180.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,900	70.820	276,198.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	3,600	81.840	294,624.000	
HUDSON CITY BANCORP INC	14,800	9.660	142,968.000	
MALLINCKRODT PLC	2,500	92.920	232,300.000	
AVERY DENNISON CORP	3,000	50.210	150,630.000	

COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	13,300	51.000	678,300.000	
EMERSON ELECTRIC CO	15,500	59.740	925,970.000	
AON CORP	6,200	95.650	593,030.000	
AMGEN	16,700	163.480	2,730,116.000	
CORE LABORATORIES N.V.	1,000	119.560	119,560.000	
ALLERGAN INC	6,400	208.030	1,331,392.000	
COACH INC	6,400	35.750	228,800.000	
EATON CORP PLC	10,486	64.880	680,331.680	
CROWN CASTLE INTL CORP	7,500	75.110	563,325.000	
CELGENE CORP	17,600	112.820	1,985,632.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-	3,700	93.160	344,692.000	
APPLIED MATERIALS INC	27,200	24.455	665,176.000	
CIT GROUP INC	4,300	46.510	199,993.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,000	106.820	213,640.000	
CME GROUP INC	7,000	89.940	629,580.000	
NATIONAL OILWELL VARCO IN	9,344	64.020	598,202.880	
ECOLAB INC	5,800	104.430	605,694.000	
EQUIFAX INC	2,800	79.100	221,480.000	
GAP INC	5,400	40.410	218,214.000	
GILEAD SCIENCES INC	33,000	102.400	3,379,200.000	
ST JUDE MEDICAL INC	6,200	65.610	406,782.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	4,548	70.510	320,679.480	
HORMEL FOODS CORP	3,200	50.870	162,784.000	
SAFEWAY INC	5,100	34.740	177,174.000	
STATE STREET CORP	9,443	76.860	725,788.980	
STAPLES INC	14,700	17.290	254,163.000	
SUNTRUST BANKS INC	11,648	40.550	472,326.400	
SCHWAB(CHARLES) CORP	25,200	29.190	735,588.000	
IHS INC-CLASS A	1,500	118.070	177,105.000	
BAXTER INTL INC	12,100	72.270	874,467.000	
B/E AEROSPACE INC	2,300	56.120	129,076.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,600	43.180	198,628.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,100	49.210	152,551.000	
CHUBB CORP	5,200	102.520	533,104.000	
CARDINAL HEALTH INC	7,500	80.650	604,875.000	
CAREFUSION CORP	4,750	58.900	279,775.000	
FEDEX CORP	5,900	167.780	989,902.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	12,054	79.610	959,618.940	
FMC CORP	3,100	56.000	173,600.000	

FLEXTRONICS INTL LTD	13,300	10.680	142,044.000	
CERNER CORP	7,000	62.420	436,940.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,800	100.490	180,882.000	
CITRIX SYSTEMS INC	3,700	61.235	226,569.500	
INTEL CORP	107,200	36.240	3,884,928.000	
CAMERON INTERNATIONAL COR	4,500	46.950	211,275.000	
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	9,600	19.580	187,968.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	9,900	40.960	405,504.000	
CREE INC	2,800	30.160	84,448.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	8,300	93.210	773,643.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	55,300	3.410	188,573.000	
ILLUMINA INC	2,900	181.210	525,509.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,900	18.680	222,292.000	
SEALED AIR CORP	4,400	41.940	184,536.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	800	510.210	408,168.000	
CALPINE CORP	8,200	21.290	174,578.000	
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	6,100	19.850	121,085.000	
CARMAX INC	4,900	60.110	294,539.000	
COMERICA INC	4,000	45.000	180,000.000	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO	2,300	39.650	91,195.000	
DUKE ENERGY CORP	15,228	81.370	1,239,102.360	
TARGET CORP	13,000	73.570	956,410.000	
DOVER CORP	3,700	71.270	263,699.000	
WW GRAINGER INC	1,400	244.020	341,628.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP	3,000	41.080	123,240.000	
JOHNSON CONTROLS INC	14,800	45.680	676,064.000	
CINTAS CORP	2,300	72.840	167,532.000	
CA INC	7,605	29.600	225,108.000	
CONAGRA INC	9,600	37.100	356,160.000	
CLOROX COMPANY	2,800	102.000	285,600.000	
ENTERGY CORP	4,000	87.320	349,280.000	
MICROSOFT CORP	171,000	45.740	7,821,540.000	
INCYTE CORP	3,000	75.580	226,740.000	
CVS HEALTH CORP	25,074	94.170	2,361,218.580	
MEDTRONIC INC	21,100	72.670	1,533,337.000	
MICRON TECHNOLOGY INC	23,000	33.830	778,090.000	
BLACKROCK INC-CLASS A	2,900	348.530	1,010,737.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	9,100	22.490	204,659.000	
HASBRO INC	2,600	57.370	149,162.000	

KELLOGG CO	5,900	64.840	382,556.000	
KEYCORP	20,200	13.430	271,286.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,400	115.360	276,864.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL IN	36,411	36.000	1,310,796.000	
KOHL'S CORP	4,600	57.640	265,144.000	
NEW YORK COMMUNITY BANCOR	10,000	15.740	157,400.000	
APACHE CORP	8,610	60.200	518,322.000	
ACE LTD	7,400	112.690	833,906.000	
ARROW ELECTRONICS INC	2,300	55.360	127,328.000	
ALLSTATE CORP	9,700	68.220	661,734.000	
EBAY INC	24,500	56.405	1,381,922.500	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,500	72.900	255,150.000	
XILINX INC	6,200	43.420	269,204.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	16,310	79.940	1,303,821.400	
DISH NETWORK CORP	5,000	69.720	348,600.000	
YAHOO! INC	21,000	50.120	1,052,520.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-A	5,200	74.000	384,800.000	
TOLL BROTHERS INC	3,800	31.860	121,068.000	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	6,000	26.835	161,010.000	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,300	45.760	242,528.000	
LENNAR CORP	3,900	43.110	168,129.000	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,800	21.310	208,838.000	
NOBLE CORP PLC	6,000	16.400	98,400.000	
PROGRESSIVE CORP	13,000	26.180	340,340.000	
PRAXAIR INC	6,400	126.480	809,472.000	
PACCAR INC	8,037	68.000	546,516.000	
PETSMART INC	2,100	81.335	170,803.500	
PVH CORP	1,900	123.820	235,258.000	
EMC CORP/MASS	43,800	28.570	1,251,366.000	
BIOGEN IDEC INC	5,030	332.890	1,674,436.700	
STARBUCKS CORP	16,500	80.435	1,327,177.500	
PERRIGO CO PLC	2,900	159.150	461,535.000	
NORTHEAST UTILITIES	7,180	51.840	372,211.200	
INTUIT INC	5,900	92.880	547,992.000	
BORG-WARNER AUTOMOTIVE	5,200	52.450	272,740.000	
BEST BUY COMPANY INC	6,500	37.470	243,555.000	
BALL CORP	3,100	65.510	203,081.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,947	13.020	376,889.940	
BED BATH & BEYOND INC	4,600	73.500	338,100.000	

	XL GROUP PLC	6,400	33.660	215,424.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	6,900	46.060	317,814.000	
	VULCAN MATERIALS CO	2,900	63.990	185,571.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS IN	5,200	111.850	581,620.000	
	VF CORP	7,500	73.130	548,475.000	
	CBS CORP-CL B	10,971	53.300	584,754.300	
	VIACOM INC-CLASS B	7,971	73.570	586,426.470	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,400	151.710	212,394.000	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,000	14.320	85,920.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	2,400	86.080	206,592.000	
	CARNIVAL CORP	8,600	44.610	383,646.000	
	COMCAST CORP -CL A	46,670	55.335	2,582,484.450	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	9,300	55.010	511,593.000	
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 401,635,327.920 (47,706,244,251)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	TUI AG-NEW	5,147	10.900	56,102.300	
	BP PLC	412,500	3.975	1,639,687.500	
	UNILEVER PLC	28,160	25.620	721,459.200	
	BARCLAYS PLC	360,500	2.281	822,300.500	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	42,100	8.335	350,903.500	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	37,100	4.578	169,843.800	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,100	41.170	86,457.000	
	REXAM PLC	16,960	4.388	74,420.480	
	PRUDENTIAL PLC	56,200	14.570	818,834.000	
	INMARSAT PLC	12,800	7.825	100,160.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	56,191	3.673	206,389.540	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,609	32.570	150,115.130	
	BAE SYSTEMS PLC	70,000	4.501	315,070.000	
	AVIVA PLC	65,200	4.679	305,070.800	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	108,102	13.470	1,456,133.940	
	MELROSE INDUSTRI	25,892	2.508	64,937.130	
	ROYAL MAIL PLC	15,300	3.942	60,312.600	
	REED ELSEVIER PLC	25,846	10.560	272,933.760	
	BG GROUP PLC	76,300	8.547	652,136.100	
DIAGEO PLC	55,500	17.910	994,005.000		
RIO TINTO PLC-REG	28,000	28.015	784,420.000		

STANDARD CHARTERED PLC	55,600	8.950	497,620.000	
TESCO PLC	182,300	1.681	306,446.300	
FRESNILLO PLC	5,000	7.075	35,375.000	
SMITH & NEPHEW PLC	20,400	10.530	214,812.000	
GLENCORE PLC	233,625	2.924	683,119.500	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,700	9.525	54,292.500	
SMITHS GROUP PLC	9,133	10.510	95,987.830	
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	10.480	63,928.000	
DIRECT LINE INSURANCE	35,200	2.801	98,595.200	
DIXONS CARPHONE PLC	23,100	4.397	101,570.700	
PEARSON PLC	18,163	11.570	210,145.910	
SAINSBURY (J) PLC	28,525	2.296	65,493.400	
NEXT PLC	3,500	64.000	224,000.000	
WHITBREAD PLC	4,011	44.750	179,492.250	
IMI PLC	6,650	11.740	78,071.000	
BUNZL PLC	7,655	17.140	131,206.700	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	20,600	4.086	84,171.600	
GKN PLC	36,500	3.293	120,194.500	
SPORTS DIRECT INTERNATION	5,500	6.660	36,630.000	
VODAFONE GROUP PLC	584,683	2.196	1,283,963.860	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,100	25.730	79,763.000	
KINGFISHER PLC	51,911	3.188	165,492.260	
WPP PLC	29,400	12.800	376,320.000	
UNITED UTILITIES GROUP PL	15,627	9.180	143,455.860	
SEVERN TRENT PLC	5,533	19.690	108,944.770	
RECKITT BENCKISER PLC	14,600	50.700	740,220.000	
SCHRODERS PLC	3,200	25.730	82,336.000	
TATE&LYLE PLC	11,600	5.820	67,512.000	
AMEC FOSTER WHEE	7,900	8.305	65,609.500	
SSE PLC	21,600	16.150	348,840.000	
WEIR GROUP PLC (THE)	4,800	18.300	87,840.000	
ASTRAZENECA PLC	27,900	44.490	1,241,271.000	
WOLSELEY PLC	6,015	35.550	213,833.250	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	129,800	2.340	303,732.000	
3I GROUP PLC	22,791	4.224	96,269.180	
SKY PLC	23,200	8.900	206,480.000	
SAGE GROUP PLC (THE)	24,114	4.377	105,546.970	
NATIONAL GRID PLC	84,428	8.865	748,454.220	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,260,765	0.753	949,356.040	



RSA INSURANCE GROUP PLC	23,660	4.323	102,282.180	
IMPERIAL TOBACCO GROUP	21,500	27.240	585,660.000	
CENTRICA PLC	111,260	2.665	296,507.900	
ARM HOLDINGS PLC	31,700	9.300	294,810.000	
BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	41,660	33.650	1,401,859.000	
ICAP PLC	16,900	4.380	74,022.000	
SABMILLER PLC	21,300	31.960	680,748.000	
BHP BILLITON PLC	46,377	13.275	615,654.670	
ASSOCIATED BRITISH FOODS	8,000	30.420	243,360.000	
HSBC HOLDINGS PLC	425,300	5.929	2,521,603.700	
SHIRE PLC	13,200	45.220	596,904.000	
OLD MUTUAL PLC	108,525	1.797	195,019.420	
ANGLO AMERICAN PLC	30,883	11.570	357,316.310	
MORRISON SUPERMARKETS	50,900	1.670	85,003.000	
CARNIVAL PLC	4,161	28.010	116,549.610	
EASYJET PLC	4,100	16.040	65,764.000	
COMPASS GROUP PLC	37,741	10.580	399,299.780	
PERSIMMON PLC	6,800	15.100	102,680.000	
BT GROUP PLC	179,800	4.018	722,436.400	
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,100	12.420	63,342.000	
WILLIAM HILL PLC	23,200	3.423	79,413.600	
BURBERRY GROUP PLC	10,089	15.830	159,708.870	
INTERCONTINENTAL HOTELS	5,373	24.850	133,519.050	
AGGREKO PLC	5,968	14.660	87,490.880	
CAPITA PLC	15,090	10.540	159,048.600	
TRAVIS PERKINS PLC	5,700	17.730	101,061.000	
INTERTEK GROUP PLC	3,800	22.540	85,652.000	
ITV PLC	86,000	2.053	176,558.000	
TULLOW OIL PLC	21,100	3.951	83,366.100	
PETROFAC LTD	7,000	7.000	49,000.000	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,949	21.310	105,463.190	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	88,300	20.945	1,849,443.500	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	54,081	21.555	1,165,715.950	
MEGGITT PLC	19,800	4.840	95,832.000	
G4S PLC	34,600	2.671	92,416.600	
COBHAM PLC	25,600	3.149	80,614.400	
ADMIRAL GROUP PLC	5,700	12.660	72,162.000	
INVESTEC PLC	12,300	5.190	63,837.000	
ANTOFAGASTA PLC	10,800	7.165	77,382.000	

	STANDARD LIFE PLC	52,200	3.929	205,093.800	
	EXPERIAN PLC	21,954	10.470	229,858.380	
	FRIENDS LIFE GROUP LTD	31,576	3.500	110,516.000	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 35,582,059.470 (6,585,527,566)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM COR	56,400	7.062	398,296.800	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	28.260	395,640.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND L	19,700	216.700	4,268,990.000	
	BANK HAPOALIM BM	26,500	19.230	509,595.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,600	13.200	496,320.000	
	NICE SYSTEMS LTD	1,700	193.000	328,100.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 6,396,941.800 (193,315,582)	
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	71,200	27.510	1,958,712.000	
	LEND LEASE	12,100	15.700	189,970.000	
	ASCIANO LTD	28,600	5.750	164,450.000	
	ALUMINA LTD	69,900	1.650	115,335.000	
	WOODSIDE PETROLEUM	16,900	35.500	599,950.000	
	FORTESCUE METALS GROUP	39,700	2.350	93,295.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	12.150	143,370.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	53,300	31.350	1,670,955.000	
	WESTPAC BANKING	69,198	31.330	2,167,973.340	
	SANTOS LIMITED	22,000	7.580	166,760.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	61,700	30.470	1,879,999.000	
	RIO TINTO LTD	9,700	53.380	517,786.000	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	24,400	11.020	268,888.000	
	AMCOR	26,700	13.120	350,304.000	
	METCASH LTD	23,500	1.720	40,420.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,800	4.400	205,920.000	
	SEEK LTD	6,500	16.050	104,325.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	14,600	4.440	64,824.000	
	NEWCREST MINING	17,600	10.280	180,928.000	
INCITEC PIVOT LTD	45,600	3.070	139,992.000		
COMMONWEALTH BANK OF AUST	36,600	81.020	2,965,332.000		

CALTEX AUSTRALIA LIMITED	3,800	32.860	124,868.000	
ORICA LIMITED	8,300	17.790	147,657.000	
QBE INSURANCE	28,800	10.220	294,336.000	
LEIGHTON HOLDINGS	2,900	20.950	60,755.000	
WOOLWORTHS	28,300	29.140	824,662.000	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	13,700	8.850	121,245.000	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	4.140	84,870.000	
CROWN LTD	10,600	12.270	130,062.000	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	15,500	2.310	35,805.000	
TELSTRA CORPORATION	98,400	5.760	566,784.000	
AMP LIMITED	66,500	5.310	353,115.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES	11,400	12.590	143,526.000	
MACQUARIE GROUP LIMITED	6,484	55.780	361,677.520	
CSL LIMITED	10,800	85.800	926,640.000	
WESFARMERS LTD	25,245	40.520	1,022,927.400	
COCHLEAR LIMITED	1,700	72.000	122,400.000	
SUNCORP GROUP LTD	28,700	13.600	390,320.000	
BORAL LIMITED	22,700	5.020	113,954.000	
ASX LTD	5,000	35.040	175,200.000	
COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	11.180	155,402.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LT	14,000	3.270	45,780.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	49,800	6.170	307,266.000	
SONIC HEALTHCARE LTD	9,500	17.550	166,725.000	
TRANSURBAN GROUP	41,800	8.700	363,660.000	
ILUKA RESOURCES LTD	12,000	5.700	68,400.000	
TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	5.650	106,220.000	
SYDNEY AIRPORT	25,100	4.730	118,723.000	
WORLEYPARSONS LTD	6,100	8.990	54,839.000	
TATTS GROUP LTD	36,900	3.420	126,198.000	
AGL ENERGY LTD	14,000	12.910	180,740.000	
BRAMBLES LTD	34,900	10.030	350,047.000	
APA GROUP	21,700	7.760	168,392.000	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,900	54.860	159,094.000	
ALS LTD	9,500	4.600	43,700.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 22,405,478.260 (2,162,128,653)	
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
IMPERIAL OIL LTD	6,600	49.860	329,076.000	

RESTAURANT BRAND	2,487	42.730	106,269.510	
SILVER WHEATON CORP	7,900	23.670	186,993.000	
INTACT FINANCIAL CORP	2,900	81.730	237,017.000	
BCE INC	6,230	52.610	327,760.300	
FRANCO-NEVADA CORP	3,500	55.580	194,530.000	
SUNCOR ENERGY INC	32,080	35.710	1,145,576.800	
METRO INC-A	2,000	89.040	178,080.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	7,400	47.210	349,354.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	27,300	65.030	1,775,319.000	
CANADIAN IMPERIAL BANK	8,800	99.020	871,376.000	
TORONTO-DOMINION BANK	40,700	53.100	2,161,170.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	6,700	32.410	217,147.000	
MEG ENERGY CORP	3,800	16.560	62,928.000	
ROYAL BANK OF CANADA	31,900	79.630	2,540,197.000	
TOURMALINE OIL CORP	3,800	41.300	156,940.000	
VERMILION ENERGY INC	2,500	52.660	131,650.000	
TRANSCANADA CORP	16,000	54.330	869,280.000	
BAYTEX ENERGY CORP	3,800	18.570	70,566.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	7,500	38.750	290,625.000	
BOMBARDIER INC 'B'	36,600	4.010	146,766.000	
BARRICK GOLD CORP	26,100	12.580	328,338.000	
CAE INC	9,200	14.850	136,620.000	
THOMSON REUTERS CORP	8,304	46.020	382,150.080	
POTASH CORP OF SASKATCHEW	18,500	41.020	758,870.000	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,100	85.210	93,731.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,160	60.080	310,012.800	
CANADIAN UTILITIES LTD A	3,600	38.700	139,320.000	
ROGERS COMMUNICATIONS-B	8,100	44.880	363,528.000	
AGNICO-EAGLE MINES	4,800	27.000	129,600.000	
KINROSS GOLD CORP	29,500	3.130	92,335.000	
BANK OF MONTREAL	14,500	80.260	1,163,770.000	
POWER CORP OF CANADA	8,500	30.220	256,870.000	
METHANEX CORP	2,200	53.150	116,930.000	
CAMECO CORP	9,200	17.950	165,140.000	
TELUS CORP	6,400	42.640	272,896.000	
POWER FINANCIAL CORP	5,600	34.630	193,928.000	
NEW GOLD INC	14,000	4.780	66,920.000	
TECK RESOURCES LIMITED-B	13,100	14.410	188,771.000	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,700	123.430	209,831.000	

TALISMAN ENERGY INC	23,200	8.900	206,480.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES	16,800	3.370	56,616.000	
AGRIUM INC	3,300	109.930	362,769.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCE	23,900	34.530	825,267.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS L	500	609.000	304,500.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	4,700	121.160	569,452.000	
TRANSALTA CORP	6,700	10.220	68,474.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,400	98.510	137,914.000	
BLACKBERRY LTD	11,900	11.620	138,278.000	
SUN LIFE FINANCIAL SVSC	13,800	41.190	568,422.000	
ENBRIDGE INC	19,000	55.270	1,050,130.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	12,400	56.250	697,500.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	41,900	21.720	910,068.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS I	7,000	163.010	1,141,070.000	
GOLDCORP INC	18,659	20.900	389,973.100	
ENCANA CORP	16,600	15.210	252,486.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	3,900	221.530	863,967.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSUR	2,800	43.470	121,716.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,600	65.870	171,262.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	18,100	78.160	1,414,696.000	
CGI GROUP INC - CL A	5,200	42.310	220,012.000	
HUSKY ENERGY INC	8,000	25.840	206,720.000	
ONEX CORPORATION	2,000	66.090	132,180.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,800	31.280	275,264.000	
FINNING INTERNATIONAL INC	5,200	24.200	125,840.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,400	42.410	144,194.000	
ELDORADO GOLD CORPORATION	17,200	7.260	124,872.000	
IGM FINANCIAL INC	3,100	44.420	137,702.000	
OPEN TEXT CORP	2,800	65.800	184,240.000	
CI FINANCIAL CORP	5,300	31.990	169,547.000	
SAPUTO INC	5,800	32.670	189,486.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LT	13,200	16.610	219,252.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD	9,600	42.540	408,384.000	
YAMANA GOLD INC	20,100	4.380	88,038.000	
FORTIS INC	6,100	38.250	233,325.000	
CRESCENT POINT ENERGY COR	9,300	26.500	246,450.000	
CENOVUS ENERGY INC	16,700	21.870	365,229.000	
DOLLARAMA INC	3,000	58.000	174,000.000	
CATAMARAN CORP	4,600	57.520	264,592.000	

	ALTAGAS LTD	3,100	40.260	124,806.000	
	KEYERA CORP	2,000	73.100	146,200.000	
	PEYTO EXPLORATION & DEV	3,400	35.690	121,346.000	
	INTER PIPELINE LTD	7,400	30.000	222,000.000	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	11,200	9.740	109,088.000	
	ENERPLUS CORP	6,000	11.000	66,000.000	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	13,600	2.540	34,544.000	
	ARC RESOURCES LTD	7,000	26.820	187,740.000	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY C	8,100	6.700	54,270.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 32,944,542.590 (3,361,990,570)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK	29,000	23.380	678,020.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	39,000	19.080	744,120.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	11.310	186,275.700	
	KEPPEL CORP	31,500	8.220	258,930.000	
	UOL GROUP LIMITED	16,400	6.530	107,092.000	
	CITY DEVELOPMENT	14,000	9.840	137,760.000	
	CAPITALAND LIMITED	59,000	3.100	182,900.000	
	SEMBCORP MARINE LTD	25,000	3.160	79,000.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	41,000	4.100	168,100.000	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	3,000	39.880	119,640.000	
	O.C.B.C.	65,000	10.080	655,200.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	153,000	1.040	159,120.000	
	SINGAPORE TELECOM LTD	178,450	3.910	697,739.500	
	NOBLE GROUP LTD	115,181	1.060	122,091.860	
	SINGAP. TECH ENGINEERING	48,000	3.220	154,560.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	29,000	4.160	120,640.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	219,400	0.425	93,245.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	19,000	7.540	143,260.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	41,000	2.510	102,910.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	56,000	3.110	174,160.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIE	69,000	2.490	171,810.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 5,256,574.060 (475,141,728)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG	80,250	16.740	1,343,385.000	

ADECCO SA-REG	4,100	65.500	268,550.000	
ROCHE HOLDING AG-GENUS	15,750	279.000	4,394,250.000	
PARGESA HOLDING SA-BR	800	74.600	59,680.000	
SIKA AG-BR	54	3,040.000	164,160.000	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	2	55,490.000	110,980.000	
ABB LTD	49,600	20.160	999,936.000	
ARYZTA AG	1,950	76.050	148,297.500	
TRANSOCEAN LTD	8,450	17.650	149,142.500	
SWISS RE LTD	7,900	81.300	642,270.000	
NESTLE SA-REGISTERED	71,650	70.000	5,015,500.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	450	276.000	124,200.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,000	138.500	138,500.000	
CREDIT SUISSE GROUP AG	34,070	24.300	827,901.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	4,900	43.560	213,444.000	
SULZER AG-REG	800	101.700	81,360.000	
SGS SA	130	1,954.000	254,020.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	700	443.500	310,450.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,382	297.900	1,007,497.800	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,200	123.900	148,680.000	
NOVARTIS AG-REG SHS	51,300	88.950	4,563,135.000	
CIE FINANC RICHEMON-REG	11,950	86.300	1,031,285.000	
SWISSCOM AG-REG	550	566.000	311,300.000	
GEBERIT AG-REG	850	324.900	276,165.000	
GIVAUDAN REG	220	1,748.000	384,560.000	
ACTELION LTD-REG	2,450	112.700	276,115.000	
SYNGENTA AG	2,112	302.100	638,035.200	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,300	138.600	180,180.000	
LONZA GROUP AG-REG	1,300	108.900	141,570.000	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	83.750	125,625.000	
HOLCIM LTD-REG	5,500	68.100	374,550.000	
SWISS LIFE HOLDING AG	800	227.700	182,160.000	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,350	129.700	175,095.000	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 25,061,979.000 (3,057,310,818)	
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	68,430	90.700	6,206,601.000	
VOLVO AB-B SHS	34,200	82.700	2,828,340.000	

MILLICOM INTL CELLULAR-SD	1,500	569.000	853,500.000	
S.K.F. AB-B SHS	8,650	157.500	1,362,375.000	
ELECTROLUX AB-SER B	5,450	214.400	1,168,480.000	
NORDEA AB	67,250	86.050	5,786,862.500	
ELEKTA AB-B SHS	8,800	79.550	700,040.000	
SWEDISH MATCH AB	4,550	236.000	1,073,800.000	
TELE2 AB-B SHS	8,950	92.700	829,665.000	
GETINGE AB-B SHS	4,700	167.400	786,780.000	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	33,900	94.800	3,213,720.000	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	11,200	353.200	3,955,840.000	
SWEDBANK AB	19,850	186.900	3,709,965.000	
HENNES & MAURITZ AB-B	20,800	310.600	6,460,480.000	
SVENSKA CELLULOSA AB-B	13,100	165.500	2,168,050.000	
SKANSKA AB-B	8,850	159.700	1,413,345.000	
SANDVIK AB	23,750	74.850	1,777,687.500	
INVESTOR AB-B SHS	10,400	270.200	2,810,080.000	
ATLAS COPCO AB-A SHS	15,100	210.100	3,172,510.000	
SECURITAS AB-B SHS	9,200	89.100	819,720.000	
TELIASONERA AB	54,050	49.280	2,663,584.000	
ALFA LAVAL AB	7,000	145.000	1,015,000.000	
ATLAS COPCO AB-B SHS	8,900	190.900	1,699,010.000	
ASSA ABLOY AB-B	7,400	397.200	2,939,280.000	
LUNDIN PETROLEUM AB	6,400	104.200	666,880.000	
BOLIDEN AB	7,900	122.000	963,800.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	12,550	54.800	687,740.000	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,300	249.500	1,322,350.000	
HEXAGON AB-B SHS	5,550	230.300	1,278,165.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クロー ナ 64,333,650.000 (995,884,902)	
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	44,700	259.900	11,617,530.000	
DANSKE BANK A/S	15,050	162.200	2,441,110.000	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	95	11,100.000	1,054,500.000	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,200	211.500	1,099,800.000	
TDC A/S	19,300	46.180	891,274.000	
CARLSBERG AS-B	2,450	475.000	1,163,750.000	



	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,500	255.100	1,403,050.000	
	COLOPLAST-B	2,500	501.500	1,253,750.000	
	DSV A/S	4,200	184.900	776,580.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	675	455.700	307,597.500	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	160	11,500.000	1,840,000.000	
	PANDORA A/S	2,750	482.600	1,327,150.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 25,176,091.500 (495,717,242)	
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	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.115	164,126.230	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	4.275	100,035.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	7.970	160,197.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 424,358.230 (38,833,022)	
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	29,900	41.370	1,236,963.000	
	DNB ASA	21,950	106.500	2,337,675.000	
	ORKLA ASA	19,050	48.970	932,878.500	
	TELENOR ASA	16,750	146.900	2,460,575.000	
	STATOIL ASA	25,073	125.800	3,154,183.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,060	311.000	1,262,660.000	
	SEADRILL LTD	8,750	86.400	756,000.000	
	SUBSEA 7 SA	6,600	74.400	491,040.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	3,950	119.800	473,210.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 13,105,184.900 (209,158,751)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG	18,350	112.100	2,057,035.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	31,100	24.355	757,440.500	
	COMMERZBANK AG	21,685	10.850	235,282.250	
	VOLKSWAGEN AG	750	177.050	132,787.500	
	VOLKSWAGEN AG PFD	3,650	177.950	649,517.500	
	M.A.N.	1,050	91.370	95,938.500	
	SIEMENS AG	17,450	91.100	1,589,695.000	

E.ON SE	44,900	13.870	622,763.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE	7,500	87.500	656,250.000	
GEA GROUP AG	4,400	35.290	155,276.000	
OSRAM LICHT AG	2,410	32.255	77,734.550	
CONTINENTAL AG	2,550	164.600	419,730.000	
BASF SE	20,750	69.100	1,433,825.000	
LINDE	4,200	148.750	624,750.000	
K+S AG	4,400	22.775	100,210.000	
ALLIANZ SE-REG	10,150	134.550	1,365,682.500	
THYSSENKRUPP AG	10,750	20.620	221,665.000	
HENKEL AG & CO KGAA	4,100	86.540	354,814.000	
R.W.E. AG	10,800	26.430	285,444.000	
LUFTHANSA	6,750	13.730	92,677.500	
FRAPORT AG	1,100	47.500	52,250.000	
BRENNTAG AG	3,750	43.715	163,931.250	
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,600	41.700	358,620.000	
UNITED INTERNET AG-REG SH	3,300	35.800	118,140.000	
SAP SE	20,242	54.850	1,110,273.700	
MUENCHENER RUE-R	3,900	160.900	627,510.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,400	55.800	189,720.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	3,400	65.150	221,510.000	
BEIERSDORF AG	2,450	66.580	163,121.000	
CELESIO AG	1,450	26.310	38,149.500	
MERCK KGAA	2,900	76.580	222,082.000	
ADIDAS AG	4,870	55.670	271,112.900	
HENKEL KGAA	2,650	78.480	207,972.000	
METRO AG	3,700	23.540	87,098.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	71,350	12.930	922,555.500	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	4,850	59.090	286,586.500	
DAIMLER AG	21,150	67.170	1,420,645.500	
QIAGEN N.V.	5,350	18.275	97,771.250	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	26,900	8.383	225,502.700	
HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,400	72.670	101,738.000	
DEUTSCHE POST AG	22,150	26.085	577,782.750	
DEUTSCHE BOERSE AG	4,250	57.280	243,440.000	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-	5,200	33.980	176,696.000	
LANXESS	2,250	37.370	84,082.500	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	7,050	18.455	130,107.750	
SYMRISE AG	2,800	49.060	137,368.000	

KABEL DEUTSCHLAND HOLDING	650	112.000	72,800.000	
HUGO BOSS AG -ORD	800	100.000	80,000.000	
RTL GROUP	1,000	76.980	76,980.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,026	22.515	473,400.390	
ARCELORMITTAL	22,400	8.791	196,918.400	
UNILEVER NV-CVA	35,800	31.120	1,114,096.000	
HEINEKEN NV	5,050	57.500	290,375.000	
REED ELSEVIER NV	15,927	18.705	297,914.530	
AEGON NV	40,744	5.998	244,382.510	
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	19,643	13.820	271,466.260	
AKZO NOBEL	5,500	53.920	296,560.000	
KONINKLIJKE DSM NV	3,800	49.275	187,245.000	
WOLTERS KLUWER	6,900	23.900	164,910.000	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,100	43.455	91,255.500	
ING GROEP N.V.	86,750	10.440	905,670.000	
KONINKLIJKE KPN NV	73,550	2.508	184,463.400	
ASML HOLDING NV	7,880	84.080	662,550.400	
TNT EXPRESS NV	10,195	5.273	53,758.230	
VOPAK	2,000	40.085	80,170.000	
RANDSTAD HOLDING NV	2,950	37.700	111,215.000	
HEINEKEN HOLDING NV	2,300	50.030	115,069.000	
GEMALTO	1,900	63.530	120,707.000	
OCI NV	2,300	27.325	62,847.500	
DELTA LLOYD NV	4,400	18.900	83,160.000	
ALTICE SA	2,050	57.160	117,178.000	
TOTAL SA	47,800	41.845	2,000,191.000	
MICHELIN (CGDE) - B	4,150	71.930	298,509.500	
AIR LIQUIDE	7,548	99.030	747,478.440	
KERING	1,900	152.450	289,655.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,700	58.410	683,397.000	
BOUYGUES	3,750	28.665	107,493.750	
LAFARGE SA	4,200	55.180	231,756.000	
BNP PARIBAS	23,550	47.480	1,118,154.000	
PEUGEOT SA	9,250	9.780	90,465.000	
NATIXIS	21,550	5.375	115,831.250	
THALES SA	2,250	42.470	95,557.500	
GROUPE DANONE	12,900	52.890	682,281.000	
CARREFOUR	14,050	23.485	329,964.250	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	8,075	14.025	113,251.870	

VIVENDI SA	27,241	19.650	535,285.650	
L'OREAL	5,500	133.500	734,250.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,000	33.575	335,750.000	
LEGRAND SA	5,917	41.045	242,863.260	
ALCATEL-LUCENT	63,000	2.660	167,580.000	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,300	72.810	94,653.000	
PERNOD-RICARD	4,667	89.010	415,409.670	
EURAZEO	976	54.620	53,309.120	
REXEL SA	6,050	14.515	87,815.750	
SOCIETE GENERALE-A	16,200	33.885	548,937.000	
LVMH	6,200	125.850	780,270.000	
ACCOR SA	3,800	35.900	136,420.000	
CAP GEMINI SA	3,250	56.320	183,040.000	
VALEO	1,650	97.220	160,413.000	
PUBLICIS GROUPE	4,100	57.350	235,135.000	
VALLOUREC	2,650	22.240	58,936.000	
BUREAU VERITAS SA	5,600	17.820	99,792.000	
SODEXO	2,050	77.480	158,834.000	
ZODIAC AEROSPACE	4,200	26.310	110,502.000	
ESSILOR INTERNATIONAL	4,600	87.080	400,568.000	
AXA	40,650	18.230	741,049.500	
CHRISTIAN DIOR	1,200	133.000	159,600.000	
LAGARDERE S.C.A.	3,800	21.380	81,244.000	
TECHNIP S.A.	2,350	48.850	114,797.500	
EDENRED	4,750	22.980	109,155.000	
RENAULT	4,300	58.370	250,991.000	
HERMES INTERNATIONAL	370	304.700	112,739.000	
STMICROELECTRONICS NV	15,950	5.904	94,168.800	
ATOS	1,800	57.530	103,554.000	
DASSAULT SYSTEMS SA	2,800	48.325	135,310.000	
WENDEL	1,100	88.770	97,647.000	
ORANGE	40,700	13.520	550,264.000	
ALSTOM	4,950	26.555	131,447.250	
CNP ASSURANCES	5,150	14.300	73,645.000	
SANOFI	26,425	74.100	1,958,092.500	
VINCI	10,950	43.135	472,328.250	
AIRBUS GROUP NV	13,150	40.950	538,492.500	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,350	14.120	132,022.000	
CREDIT AGRICOLE SA	23,000	10.345	237,935.000	

GDF SUEZ	31,973	18.770	600,133.210
IMERYS SA	1,100	58.750	64,625.000
ELECTRICITE DE FRANCE	5,550	22.180	123,099.000
SES	6,850	29.290	200,636.500
SAFRAN SA	6,100	48.895	298,259.500
ILIAD SA	600	186.250	111,750.000
ARKEMA	1,550	51.780	80,259.000
ADP	950	98.860	93,917.000
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	26.050	105,502.500
SCOR SE	4,550	23.920	108,836.000
GROUPE EUROTUNNEL SA-REGR	10,450	10.330	107,948.500
UCB SA	2,800	63.400	177,520.000
KBC GROUPE	5,550	44.620	247,641.000
COLRUYT SA	2,500	36.965	92,412.500
DELHAIZE GROUP	2,300	56.180	129,214.000
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	1,850	68.730	127,150.500
SOLVAY SA	1,350	106.600	143,910.000
UMICORE	2,950	31.790	93,780.500
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	17,850	88.560	1,580,796.000
AGEAS	4,790	28.490	136,467.100
BELGACOM SA	3,500	29.755	104,142.500
UNIPOLSAI SPA	21,750	2.154	46,849.500
BANCO POPOLARE SCARL	8,300	9.950	82,585.000
PRYSMIAN SPA	5,700	14.400	82,080.000
ASSICURAZIONI GENERALI	26,243	16.550	434,321.650
SAIPEM	6,100	8.665	52,856.500
MEDIOBANCA SPA	14,615	6.685	97,701.270
TENARIS SA	10,550	12.130	127,971.500
UNICREDIT SPA	97,569	5.255	512,725.090
TELECOM ITALIA SPA	220,782	0.889	196,275.190
TELECOM ITALIA-RNC	134,950	0.682	92,035.900
INTESA SANPAOLO	259,797	2.416	627,669.550
ATLANTIA SPA	9,407	18.780	176,663.460
ENI SPA	55,850	14.060	785,251.000
FINMECCANICA SPA	11,225	7.450	83,626.250
MONTE DEI PASCHI SIENA	96,319	0.529	50,952.750
ENEL SPA	144,300	3.596	518,902.800
SNAM SPA	44,400	3.978	176,623.200
LUXOTTICA GROUP SPA	3,700	43.080	159,396.000

UNIONE DI BANCHE ITALIANE	19,600	5.875	115,150.000	
TERNA SPA	34,700	3.670	127,349.000	
PIRELLI & C.	7,645	10.660	81,495.700	
ENEL GREEN POWER SPA	55,400	1.706	94,512.400	
EXOR SPA	2,100	33.020	69,342.000	
CNH INDUSTRIAL NV	20,900	6.505	135,954.500	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES	19,350	9.150	177,052.500	
TELEFONICA S.A.	92,177	11.965	1,102,897.800	
BANCO POPULAR ESPANOL	40,473	4.223	170,917.470	
BANCO BILBAO VIZCAYA	131,712	7.781	1,024,851.070	
IBERDROLA SA	114,834	5.506	632,276.000	
BANCO DE SABADELL SA	80,572	2.182	175,808.100	
REPSOL SA	22,950	15.680	359,856.000	
GRIFOLS SA	3,350	31.955	107,049.250	
BANCO SANTANDER SA	276,550	6.833	1,889,666.150	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	9,300	15.685	145,870.500	
AMADEUS IT HOLDING SA-A	8,550	31.060	265,563.000	
GAS NATURAL SDG SA	8,000	20.730	165,840.000	
MAPFRE SA	21,450	2.781	59,652.450	
CAIXABANK	40,200	4.293	172,578.600	
ZARDOYA OTIS SA	4,550	8.570	38,993.500	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE	22,800	5.597	127,611.600	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	4,276	27.325	116,841.700	
INDITEX	24,000	22.285	534,840.000	
ENAGAS	4,700	25.765	121,095.500	
RED ELECTRICA DE ESPANA	2,500	70.800	177,000.000	
FERROVIAL SA	9,800	15.680	153,664.000	
DISTRIBUIDORA INTERNACION	18,700	5.211	97,445.700	
BANKIA SA	108,422	1.249	135,419.070	
UPM-KYMMENE OYJ	11,850	13.190	156,301.500	
NOKIA OYJ	84,150	6.325	532,248.750	
WARTSILA OYJ	3,450	36.220	124,959.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	13,100	7.040	92,224.000	
METSO OYJ	3,750	24.250	90,937.500	
ELISA OYJ-A SHARES	4,550	22.140	100,737.000	
SAMPO OYJ-A SHS	9,950	37.630	374,418.500	
FORTUM OYJ	9,950	17.870	177,806.500	
KONE OYJ-B	6,950	36.520	253,814.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,000	19.920	59,760.000	

	NESTE OIL OYJ	4,300	19.590	84,237.000	
	ORION OYJ-CLASS B	2,050	25.990	53,279.500	
	IMMOFINANZ AG	31,200	2.089	65,176.800	
	OMV AG	3,550	21.000	74,550.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	5,550	19.050	105,727.500	
	VOESTALPINE AG	2,850	31.405	89,504.250	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATI	2,400	11.790	28,296.000	
	ANDRITZ AG	1,600	43.300	69,280.000	
	VIENNA INSURANCE GROUP	1,000	36.085	36,085.000	
	BANK OF IRELAND	661,800	0.324	214,423.200	
	JERONIMO MARTINS	6,000	7.790	46,740.000	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	59,000	3.163	186,617.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B	10,350	8.652	89,548.200	
	KERRY GROUP PLC-A	3,600	55.970	201,492.000	
	CRH PLC	16,600	18.540	307,764.000	
ユーロ 小計				ユーロ 66,282,615.710 (9,709,077,550)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	32,000	71.650	2,292,800.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT	52,000	42.000	2,184,000.000	
	MTR CORP	37,500	31.100	1,166,250.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	37,000	110.600	4,092,200.000	
	SINO LAND	88,000	12.160	1,070,080.000	
	CHEUNG KONG	31,000	125.900	3,902,900.000	
	WHARF HOLDINGS	34,000	54.400	1,849,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	14,500	98.500	1,428,250.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	42,500	64.750	2,751,875.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	16.840	690,440.000	
	HUTCHISON WHAMPOA	48,300	86.050	4,156,215.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMNT	23,460	50.650	1,188,249.000	
	HK & CHINA GAS	143,903	17.140	2,466,497.420	
	HANG SENG BANK	16,900	125.300	2,117,570.000	
	WHEELOCK & CO	25,000	34.850	871,250.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	113,000	8.690	981,970.000	
	HONG KONG EX & CL	24,400	168.700	4,116,280.000	
	LI & FUNG LTD	132,000	7.580	1,000,560.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	52,000	21.100	1,097,200.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	71.150	462,475.000	

YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	27.050	568,050.000	
NWS HOLDINGS LTD	46,500	14.300	664,950.000	
KERRY PROPERTIES LTD	22,500	27.750	624,375.000	
BANK OF EAST ASIA	29,040	29.450	855,228.000	
SJM HOLDINGS LTD	47,000	11.560	543,320.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	30,000	22.850	685,500.000	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTUR	15,000	56.250	843,750.000	
AIA GROUP LTD	270,000	40.950	11,056,500.000	
SANDS CHINA LTD	54,000	37.950	2,049,300.000	
SHANGRI-LA ASIA	42,000	10.540	442,680.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	31,500	25.850	814,275.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	20,000	18.740	374,800.000	
BANK OF CHINA HONG KONG	81,500	25.450	2,074,175.000	
WYNN MACAU LTD	38,000	20.050	761,900.000	
HKT TRUST AND HKT LTD	57,000	9.950	567,150.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 62,812,614.420 (962,289,253)	
合計			75,952,619,888 [75,952,619,888]	

## (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	2,847	469,470.300	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,887	1,260,183.260	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,400	448,766.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	12,300	342,678.000	
		VORNADO REALTY TRUST	3,827	438,153.230	
		EQUITY RESIDENTIAL	7,700	556,479.000	
		AMERICAN TOWER CORP	8,700	845,118.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	17,093	407,838.980	
		KIMCO REALTY CORP	9,400	238,102.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	4,000	165,600.000	
		RAYONIER INC	3,000	80,610.000	
		VENTAS INC	6,600	483,450.000	
		AMERICAN CAPITAL AGENCY	7,800	170,976.000	
		IRON MOUNTAIN INC	3,910	150,926.000	
		AMERICAN REALTY CAP PROP	20,400	171,564.000	
PROLOGIS INC	11,162	473,045.560			



	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,000	149,360.000	
	DUKE REALTY CORP	8,000	159,440.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	286,958.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,500	199,230.000	
	HEALTH CARE REIT INC	7,100	542,085.000	
	HCP INC	10,200	460,938.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	123,420.000	
	MACERICH CO/THE	3,200	263,584.000	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	21,400	239,680.000	
	REALTY INCOME CORP	5,200	247,780.000	
	PUBLIC STORAGE	3,300	603,471.000	
	REGENCY CENTERS CORP	2,100	133,056.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,100	256,746.000	
	UDR INC	5,700	176,871.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,100	203,515.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 10,749,094.330 (1,276,777,425)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES PLC	18,000	205,020.000	イギリス・ポンド
	SEGRO PLC	16,750	61,388.750	
	HAMMERSON PLC	17,400	103,008.000	
	BRITISH LAND CO PLC	22,000	162,250.000	
	INTU PROPERTIES PLC	21,100	68,828.200	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 600,494.950 (111,139,605)	
オーストラリア・ドル	SCENTRE GROUP	117,222	416,138.100	オーストラリア・ドル
	NOVION PROPERTY GROUP	65,500	142,790.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	23,950	168,608.000	
	GPT GROUP	35,960	154,628.000	
	MIRVAC GROUP	93,400	167,653.000	
	STOCKLAND	51,500	212,180.000	
	WESTFIELD CORP	45,596	410,364.000	
	GOODMAN GROUP	40,900	236,811.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,909,172.100	

			(184,235,107)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	48,000	113,280.000
	CAPITAMALL TRUST	79,000	158,000.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 271,280.000 (24,521,000)
ユーロ			ユーロ
	CORIO NV	2,024	77,944.240
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,150	427,097.500
	ICADE	950	59,945.000
	GECINA SA	750	77,475.000
	KLEPIERRE	3,200	109,008.000
FONCIERE DES REGIONS	950	70,214.500	
ユーロ 小計			ユーロ 821,684.240 (120,360,307)
香港・ドル			香港・ドル
	LINK REIT	53,000	2,549,300.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 2,549,300.000 (39,055,276)
投資証券 合計			1,756,088,720 [1,756,088,720]
合計			1,756,088,720 [1,756,088,720]

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 591銘柄	97.4%	2.6%	63.3%
	投資証券 31銘柄			
イギリス・ポンド	株式 102銘柄	98.3%	1.7%	8.6%
	投資証券 5銘柄			
イスラエル・シェケル	株式 6銘柄	100%	-%	0.2%

オーストラリア・ドル	株式	55銘柄	92.1%	7.9%	3.0%
	投資証券	8銘柄			
カナダ・ドル	株式	88銘柄	100%	-%	4.3%
シンガポール・ドル	株式	21銘柄	95.1%	4.9%	0.6%
	投資証券	2銘柄			
スイス・フラン	株式	33銘柄	100%	-%	3.9%
スウェーデン・クローナ	株式	29銘柄	100%	-%	1.3%
デンマーク・クローネ	株式	12銘柄	100%	-%	0.6%
ニュージーランド・ドル	株式	3銘柄	100%	-%	0.0%
ノルウェー・クローネ	株式	9銘柄	100%	-%	0.3%
ユーロ	株式	217銘柄	98.8%	1.2%	12.6%
	投資証券	6銘柄			
香港・ドル	株式	35銘柄	96.1%	3.9%	1.3%
	投資証券	1銘柄			

## 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。

## 「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25年12月18日現在	平成26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	1,492,297,015	369,259,013
投資証券	123,068,548,220	170,023,126,500
未収配当金	565,330,680	715,626,502
流動資産合計	125,126,175,915	171,108,012,015
資産合計	125,126,175,915	171,108,012,015
負債の部		
流動負債		
未払金	1,261,581,580	307,953,900
未払解約金	3,800,000	8,000
流動負債合計	1,265,381,580	307,961,900

負債合計		1,265,381,580	307,961,900
純資産の部			
元本等			
元本	1	69,992,508,701	73,244,127,617
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		53,868,285,634	97,555,922,498
元本等合計		123,860,794,335	170,800,050,115
純資産合計		123,860,794,335	170,800,050,115
負債純資産合計		125,126,175,915	171,108,012,015

## 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25年12月19日 至 平成26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  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1. 1期首	平成24年12月19日	平成25年12月19日
期首元本額	42,668,886,025円	69,992,508,701円
期中追加設定元本額	34,750,665,114円	11,529,286,794円
期中一部解約元本額	7,427,042,438円	8,277,667,878円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-R E I Tオープン	10,278,204,640円	8,479,749,838円
ダイワJ-R E I Tオープン (毎月分配型)	58,543,906,837円	62,217,826,982円

ダイワJ - R E I Tオープン (年1回決算型)	556,577円	245,075,420円
DC・ダイワJ - R E I T オープン	1,163,807,433円	1,855,855,042円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,225,277円	2,569,321円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	2,870,501円	3,361,031円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	381,725円	419,121円
ダイワ・インデックスセレク ト J - R E I T	555,711円	439,270,862円
計	69,992,508,701円	73,244,127,617円
2. 期末日における受益権の総数	69,992,508,701口	73,244,127,617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25年12月19日 至 平成26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 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26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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成25年12月18日現在	平成26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	898,472,941	18,702,365,406
合計	898,472,941	18,702,365,406

（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25年9月18日から平成25年12月18日まで、及び平成26年9月17日から平成26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25年12月18日現在	平成26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25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.7696円	2.3319円
（1万口当たり純資産額）	（17,696円）	（23,319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 (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	7,778	3,706,217,000	
	M I Dリート投資法人	3,095	917,667,500	
	森ヒルズリート	26,466	4,287,492,000	
	野村不レジデンシャル	2,711	1,848,902,000	
	産業ファンド	2,790	2,985,300,000	
	大和ハウスリート	4,947	2,795,055,000	
	アドバンス・レジデンス	21,914	6,639,942,000	
	ケネディクスレジデンシャル	4,705	1,602,052,500	
	A P I投資法人	4,609	4,797,969,000	
	G L P投資法人	40,301	5,339,882,500	
	コンフォリア・レジデンシャル	6,787	1,718,468,400	
	日本プロロジスリート	29,175	7,162,462,500	
	N M F投資法人	28,071	4,308,898,500	
	星野リゾート・リート	724	867,352,000	
	S I A不動産投資	1,266	564,636,000	
	イオンリート投資	16,014	2,635,904,400	
	ヒューリックリート投資法	13,165	2,344,686,500	
	日本リート投資法人	2,559	923,799,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	7,294	797,234,200	
	日本ビルファンド	23,802	14,043,180,000	
	ジャパンリアルエステイト	21,097	11,708,835,000	
	日本リテールファンド	40,966	10,007,993,800	
	オリックス不動産投資	35,752	5,945,557,600	
	日本プライムリアルティ	13,907	5,896,568,000	
	プレミアム投資法人	3,687	1,902,492,000	
	東急リアル・エステート	16,479	2,513,047,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	3,267	1,403,176,500	
	野村不動産オフィスF	6,280	3,359,800,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	44,372	8,257,629,200	
	森トラスト総合リート	22,251	5,184,483,000	
	インヴィンシブル投資法人	44,986	2,195,316,800	
	フロンティア不動産投資	8,361	4,707,243,000	
	平和不動産リート	15,978	1,474,769,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	13,991	3,662,843,800		
福岡リート投資法人	11,631	2,539,047,300		
ケネディクス・オフィス投資法人	6,788	4,554,748,000		
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	17,162	2,208,749,400		

いちご不動産投資法人	18,914	1,645,518,000	
大和証券オフィス投資法人	7,434	4,438,098,000	
阪急リート投資法人	10,072	1,465,476,000	
スタートプロシード投資法人	2,929	573,205,300	
トップリート投資法人	2,967	1,459,764,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	6,302	3,472,402,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	47,053	3,736,008,200	
日本賃貸住宅投資法人	24,865	2,205,525,500	
ジャパンエクセレント投資法人	20,443	3,217,728,200	
投資証券 合計		170,023,126,500	
合計		170,023,126,500	

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。

## 「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25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,875,287	15,829,523
コール・ローン	6,584,586	24,865,522
投資証券	803,893,209	2,055,905,282
未収入金	1,717	5,250
未収配当金	1,338,510	3,451,480
流動資産合計	814,693,309	2,100,057,057
資産合計	814,693,309	2,100,057,057
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	111
未払金	-	18,010,577
未払解約金	-	6,000



その他未払費用	-	13,581
流動負債合計	-	18,030,269
負債合計	-	18,030,269
純資産の部		
元本等		
元本	1	560,248,764
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		254,444,545
元本等合計		814,693,309
純資産合計		814,693,309
負債純資産合計		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25年12月19日 至 平成26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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 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。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1. 1 期首	平成24年12月19日	平成25年12月19日
期首元本額	512,564,161円	560,248,764円
期中追加設定元本額	181,383,825円	498,128,275円
期中一部解約元本額	133,699,222円	55,470,678円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
D - I ' s グローバル R E I T インデックス	672,004円	3,174,666円
D C ダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド	552,296,056円	867,364,533円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,720,556円	2,906,582円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2030	3,495,157円	3,869,978円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2040	395,195円	474,979円
ダイワ・インデックスセレクト ト グローバル R E I T	669,796円	125,115,623円

計	560,248,764円	1,002,906,361円
2. 期末日における受益権の総数	560,248,764口	1,002,906,361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25年12月19日 至 平成26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。 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。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成25年12月18日現在	平成26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	17,333,763	2,350,038
合計	17,333,763	2,350,038

（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25年12月3日から平成25年12月18日まで、及び平成26年12月2日から平成26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25年12月18日 現在				平成26年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	-	-	-	-	4,293,916	-	4,293,805	111
オーストラリア・ ドル	-	-	-	-	4,293,916	-	4,293,805	111
合計	-	-	-	-	4,293,916	-	4,293,805	111

（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25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4542円 (14,542円)	2.0760円 (20,760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	1,300	59,137.000	
		EXCEL TRUST INC	1,100	14,421.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,300	379,270.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	5,547	1,014,990.060	
		GRAMERCY PROPERTY TRUST	1,800	12,096.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,700	356,373.000	
		BIOMED REALTY TRUST INC	3,500	74,270.000	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	2,655	95,898.600	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	11,177	311,391.220	
		VORNADO REALTY TRUST	3,164	362,246.360	
		ROUSE PROPERTIES	561	10,154.100	
		QTS REALTY TRUST INC	200	6,566.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	6,500	469,755.000	
EPR PROPERTIES	1,000	57,230.000			

CHATHAM LODGING TRUST	600	17,634.000	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	1,000	36,580.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERT	900	48,213.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVEST	1,500	24,915.000	
ASHFORD HOSPITALITYP REIT	340	5,892.200	
HOST HOTELS&RESORTS INC	13,500	322,110.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	2,500	42,675.000	
CHAMBERS STREET PROPERTIE	4,200	34,566.000	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	1,200	40,740.000	
CORESITE REALTY CORP	400	15,220.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES	1,000	29,500.000	
CAMPUS CREST COMMUNITIES	1,000	7,380.000	
RLJ LODGING TRUST	2,400	80,928.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	800	12,960.000	
AMERICAN RESIDENTIAL PROP	600	10,242.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	400	3,804.000	
CYRUSONE INC	600	15,900.000	
SILVER BAY REALTY TRUST	600	9,780.000	
AMREIT INC	300	7,977.000	
KIMCO REALTY CORP	7,300	184,909.000	
HEALTHCARE TRUST OF AMERI	2,150	55,642.000	
WHITESTONE REIT	300	4,416.000	
GAMING AND LEISURE PROPER	1,600	46,256.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TR	2,800	51,856.000	
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	700	18,473.000	
AVIV REIT INC	400	13,624.000	
WASHINGTON PRIME GROUP	2,823	47,059.410	
CORRECTIONS CORP OF AMERI	2,124	77,993.280	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES	1,500	18,285.000	
SOVRAN SELF STORAGE INC	600	51,318.000	
SELECT INCOME REIT	700	17,150.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	600	23,460.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST	300	2,751.000	
PREFERRED APARTMENT COMMU	300	2,595.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST	1,800	31,878.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY	600	9,462.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST	2,200	56,518.000	
STAG INDUSTRIAL INC	1,100	27,566.000	
VENTAS INC	5,279	386,686.750	

CARETRUST REIT INC	403	4,928.690	
NEW YORK REIT INC	2,800	30,156.000	
GEO GROUP INC/THE	1,300	49,959.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP	2,400	58,368.000	
GOVERNMENT PROP INCOME	1,300	29,913.000	
SABRA HEALTH CARE REIT	1,000	28,790.000	
UMH PROPERTIES	400	3,812.000	
IRON MOUNTAIN INC	3,300	127,380.000	
TERRENO REALTY CORP	600	12,186.000	
AMERICAN REALTY CAP PROP	16,108	135,468.280	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	7,000	82,810.000	
SUN COMMUNITIES INC	800	49,256.000	
ASSOCIATED ESTATES REALTY	1,000	22,620.000	
ACADIA REALTY TRUST	1,111	35,229.810	
ALEXANDER'S INC	100	41,140.000	
PROLOGIS INC	8,946	379,131.480	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ	1,300	114,946.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	3,100	48,670.000	
SAUL CENTERS INC	200	11,224.000	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	2,945	56,985.750	
MACK-CALI REALTY CORP	1,500	27,435.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,500	112,020.000	
COUSINS PROPERTIES INC	3,558	40,312.140	
DDR CORP	5,256	95,501.520	
DUKE REALTY CORP	6,100	121,573.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	600	38,082.000	
EQUITY ONE INC	1,400	34,972.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,167	239,199.990	
FELCOR LODGING TRUST INC	2,000	21,300.000	
FIRST INDUSTRIAL REALTY	2,000	40,720.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,200	159,384.000	
GLIMCHER REALTY TRUST	2,500	34,400.000	
GETTY REALTY CORP	500	9,010.000	
HEALTH CARE REIT INC	5,800	442,830.000	
HCP INC	8,200	370,558.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,600	70,304.000	
HOME PROPERTIES INC	1,000	66,010.000	
HOSPITALITY PROPERTIES	2,700	84,537.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST	1,700	46,036.000	

EQUITY COMMONWEALTH	2,275	55,168.750	
KILROY REALTY CORP	1,500	103,365.000	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,900	77,425.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2,600	97,240.000	
LTC PROPERTIES INC	600	25,152.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	3,600	40,068.000	
MID-AMERICA APARTMENT COM	1,324	98,174.600	
MACERICH CO/THE	2,500	205,925.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTI	1,400	70,322.000	
NATL HEALTHINVESTORS INC	500	33,920.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIE	2,400	94,200.000	
REALTY INCOME CORP	4,017	191,410.050	
CORPORATE OFFICE PROPERTI	1,700	47,770.000	
PENN REAL ESTATE INVEST	1,200	27,096.000	
PARKWAY PROPERTIES INC	1,500	27,165.000	
POST PROPERTIES INC	1,000	58,400.000	
PUBLIC STORAGE	2,600	475,462.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	300	23,352.000	
REGENCY CENTERS CORP	1,700	107,712.000	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTI	1,400	25,508.000	
TANGER FACTORY OUTLET CEN	1,700	61,812.000	
SL GREEN REALTY CORP	1,700	207,842.000	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	3,600	80,100.000	
TAUBMAN CENTERS INC	1,100	81,488.000	
URSTADT BIDDLE-CL A	500	11,190.000	
UDR INC	4,500	139,635.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INC	200	9,558.000	
WP CAREY INC	1,700	120,122.000	
WASHINGTON REAL ESTATE IN	1,200	33,144.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTO	2,000	68,820.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,400	14,504.000	
AGREE REALTY CORP	300	9,303.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTOR	2,300	89,332.000	
INLAND REAL ESTATE CORP	1,500	16,455.000	
STRATEGIC HOTELS&RESORTS	4,300	56,975.000	
CUBESMART	2,900	63,452.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	3,647	61,451.950	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,400	157,560.000	
CEDAR REALTY TRUST	1,200	8,232.000	



	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,000	117,260.000	
	FIRST POTOMAC REALTY TRUS	1,000	12,160.000	
	WINTHROP REALTY TRUST	600	10,434.000	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,400	24,990.000	
	INVESTORS REAL ESTATE TRU	1,800	15,066.000	
	KITE REALTY GROUP TRUST	1,450	40,846.500	
	MONMOUTH REIT-CLASS A	1,000	11,040.000	
	ONE LIBERTY PROPERTIES IN	200	4,858.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITI	1,900	76,380.000	
	EDUCATION REALTY TRUST	800	28,680.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	300	5,178.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY	3,442	53,041.220	
	TRADE STREET RESIDENTIAL	200	1,594.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	3,100	41,416.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIE	1,500	18,210.000	
	DOUGLAS EMMETT	2,400	67,128.000	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	1,500	52,155.000	
	RETAIL PROPERTIES OF AME-	4,100	67,937.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 12,320,056.710 (1,463,376,336)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA GROUP LTD	15,400	7,854.000	
	MUCKLOW<A&J>GROUP PLC	900	3,915.000	
	REDEFINE INT'L REIT	14,300	7,293.000	
	LAND SECURITIES PLC	13,950	158,890.500	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	11,850	12,395.100	
	SEGRO PLC	13,150	48,194.750	
	HAMMERSON PLC	14,000	82,880.000	
	BRITISH LAND CO PLC	18,300	134,962.500	
	GREAT PORTLAND ESTATES PL	6,050	42,501.250	
	INTU PROPERTIES PLC	16,700	54,475.400	
	DERWENT LONDON PLC	1,800	51,660.000	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	1,750	6,300.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	2,050	14,514.000	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	3,600	8,431.200	
	SHAFTESBURY PLC	4,950	37,323.000	
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	1,450	3,262.500	

	BIG YELLOW GROUP PLC	2,550	14,841.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	10,200	15,187.800	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	5,250	5,591.250	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 710,472.250 (131,494,204)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	2,400	22,876.800	イスラエル・シュケル
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 22,876.800 (691,337)	
オーストラリ ア・ドル			オーストラリア・ドル	
	FOLKESTONE EDUCATION	3,000	5,760.000	
	GALILEO JAPAN TRUST	1,500	2,520.000	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	21,500	22,145.000	
	SHOPPING CENTERS AUSTRALA	10,500	20,055.000	
	GROWTHPOINT PROPERTIES	2,500	7,000.000	
	NATIONAL STORAGE REIT	5,000	7,050.000	
	AUSTRALIAN INDUSTRIAL REI	1,500	3,390.000	
	INDUSTRIA REIT	2,000	4,040.000	
	GDI PROPERTY GROUP	7,500	6,562.500	
	360 CAPITAL OFFICE FUND	1,000	2,045.000	
	SCENTRE GROUP	97,011	344,389.050	
	ARENA REIT	3,000	4,500.000	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENT	2,000	5,040.000	
	BWP TRUST	8,428	22,924.160	
	NOVION PROPERTY GROUP	43,000	93,740.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	16,509	116,223.360	
	GPT GROUP	31,000	133,300.000	
	INVESTA OFFICE FUND	10,525	38,311.000	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	5,500	22,825.000	
	MIRVAC GROUP	66,500	119,367.500	
	STOCKLAND	42,000	173,040.000	
	WESTFIELD CORP	34,500	310,500.000	
	ABACUS PROPERTY GROUP	4,000	11,720.000	
	GOODMAN GROUP	28,000	162,120.000	
	FEDERATION CENTRES	25,500	70,380.000	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROU	1,000	4,680.000	

	CHARTER HALL GROUP	4,950	23,512.500	
	ALE PROPERTY GROUP	2,500	8,150.000	
	ASPEN GROUP	1,500	1,905.000	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	14,500	5,945.000	
	360 CAPITAL GROUP LTD	4,000	4,020.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,757,160.070 (169,565,947)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTM	1,200	17,124.000	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE	900	7,569.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROP	400	3,452.000	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE	300	8,061.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVES	400	16,048.000	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	500	3,990.000	
	RETROCOM MID-MARKET REIT	500	1,905.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INV	400	2,300.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	700	7,392.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTA	1,400	5,950.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN R	400	3,820.000	
	MILESTONE APARTMENTS REAL	400	4,700.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT	500	5,875.000	
	PLAZA RETAIL REIT	500	2,030.000	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVE	1,200	33,300.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL	1,000	24,320.000	
	CAN REAL ESTATE INVEST TR	600	27,222.000	
	CHARTWELL RETIREMENT RESI	1,500	17,865.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-T	1,390	25,270.200	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-	2,366	50,585.080	
	INNVEST REAL ESTATE INVES	700	3,969.000	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR U	500	8,680.000	
RIOCAN REAL ESTATE INVST	2,700	71,226.000		
DREAM OFFICE REAL ESTATE	900	22,131.000		
BOARDWALK REAL ESTATE INV	500	31,355.000		
NORTHERN PROPERTY REAL ES	300	7,200.000		
CROMBIE REAL ESTATE INVES	1,000	12,790.000		
ALLIED PROPERTIES REAL ES	700	25,417.000		
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 451,546.280 (46,080,299)	

シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	FIRST REAL ESTATE INV T	10,000	12,350.000	
	MAPLETREE GREATER CHINA	32,000	29,920.000	
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRI	8,400	12,012.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	6,000	5,280.000	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	36,000	60,300.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	37,000	87,320.000	
	CAPITAMALL TRUST	46,000	92,000.000	
	SUNTEC REIT	45,000	87,525.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	26,000	30,550.000	
	KEPPEL REIT	28,400	33,796.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	8,960	12,544.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	15,000	18,750.000	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUS	19,779	13,153.030	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	12,000	20,820.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	9,000	16,920.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	23,000	18,170.000	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	10,000	15,800.000	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	6,000	14,460.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RET	30,000	9,600.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUS	19,880	29,223.600	
	CACHE LOGISTICS TRUST	13,000	14,755.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TR	24,000	35,040.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUS	13,000	10,595.000	
SPH REIT	12,000	12,600.000		
SOILBUILD BUSINESS SPACE	10,000	7,700.000		
SABANA SHARIAH COMP IND R	10,000	9,200.000		
ASCENDAS HOSPITALITY TRST	13,000	8,645.000		
QUE HOSPITALITY TRUST	11,000	9,900.000		
QUE COMMERCIAL REAL ESTAT	7,000	5,565.000		
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 734,493.630 (66,390,880)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	DNZ PROPERTY FUND LTD	5,500	10,367.500	
	KIWI INCOME PROPERTY TRU	17,500	21,962.500	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	7,000	10,500.000	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY	3,500	5,425.000		

	GOODMAN PROPERTY TRUST	17,000	19,125.000	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 67,380.000 (6,165,944)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT	1,350	13,844.250	
	HAMBORNER REIT AG	650	5,200.000	
	WERELDHAVE NV	650	35,100.000	
	CORIO NV	1,800	69,318.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,750	347,637.500	
	EUROCOMMERCIAL -CVA	750	25,365.000	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS	1,374	4,946.400	
	VASTNED RETAIL NV	350	12,773.250	
	ICADE	600	37,860.000	
	ANF IMMOBILIER	150	3,015.000	
	ALTAREA	50	6,630.000	
	GECINA SA	650	67,145.000	
	KLEPIERRE	1,800	61,317.000	
	FONCIERE DES REGIONS	800	59,128.000	
	MERCIALYS	950	16,268.750	
	AEDIFICA	150	8,122.500	
	COFINIMMO	300	27,417.000	
	BEFIMMO S.C.A	350	20,755.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	203	11,926.250	
	BENI STABILI SPA	17,100	9,045.900	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRI	4,900	2,989.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE	600	5,329.800	
AXIA REAL ESTATE SOCIMI S	550	5,621.000		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI	2,300	22,402.000		
IRISH RESIDENTIAL PROPERT	2,500	2,600.000		
GREEN REIT PLC	11,913	14,652.990		
HIBERNIA REIT PLC	12,000	12,900.000		
ユーロ 小計			ユーロ 909,309.590 (133,195,669)	
香港・ドル			香港・ドル	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEM	17,000	65,620.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVE	14,000	48,860.000	
	FORTUNE REIT	23,000	172,500.000	
	PROSPERITY REIT	18,000	47,700.000	

	LINK REIT	41,000	1,972,100.000	
	NEW CENTURY REIT	6,000	19,800.000	
	SPRING REAL ESTATE INVEST	11,000	39,600.000	
	REGAL REAL ESTATE INV	13,000	26,260.000	
	CHAMPION REIT	43,000	149,640.000	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 2,542,080.000 (38,944,666)	
投資証券	合計		2,055,905,282 [2,055,905,282]	
合計			2,055,905,282 [2,055,905,282]	

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 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 149銘柄	100%	71.3%
イギリス・ポンド	投資証券 19銘柄	100%	6.4%
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 31銘柄	100%	8.2%
カナダ・ドル	投資証券 28銘柄	100%	2.2%
シンガポール・ドル	投資証券 29銘柄	100%	3.2%
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 27銘柄	100%	6.5%
香港・ドル	投資証券 9銘柄	100%	1.9%

## 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。

「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25年12月18日現在	平成26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	63,209,164	77,648,369
国債証券	10,903,951,230	10,328,476,930
地方債証券	1,235,755,614	1,574,280,203
特殊債券	1,302,101,450	1,403,379,900
社債券	1,336,629,188	1,341,675,450
未収入金	139,188,990	2,380,620
未収利息	57,726,327	57,029,923
前払費用	3,908,911	3,430,098
流動資産合計	15,042,470,874	14,788,301,493
資産合計	15,042,470,874	14,788,301,493
負債の部		
流動負債		
未払金	105,304,000	-
未払解約金	43,255,000	41,579,000
流動負債合計	148,559,000	41,579,000
負債合計	148,559,000	41,579,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,691,941,085	12,150,667,512
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,201,970,789	2,596,054,981
元本等合計	14,893,911,874	14,746,722,493
純資産合計	14,893,911,874	14,746,722,493
負債純資産合計	15,042,470,874	14,788,301,493

## 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25年12月19日 至 平成26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

個別法に基づき、時価で評価しております。  
時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1. 1 期首	平成24年12月19日	平成25年12月19日
期首元本額	11,560,180,230円	12,691,941,085円
期中追加設定元本額	2,925,321,778円	1,559,039,870円
期中一部解約元本額	1,793,560,923円	2,100,313,443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）	263,242円	- 円
ワールドアセット（分散コース）	177,483円	- 円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,352,658,502円	3,608,693,904円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,509,796,403円	1,779,777,394円
ダイワ・ライフ・バランス70	424,207,005円	528,911,393円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	365,615,760円	445,053,924円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	260,045,562円	365,702,129円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	61,088,460円	90,920,694円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	25,740,390円	40,998,036円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	13,042,893円	20,766,084円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	582,010円	923,489円
ダイワ世界バランスファンド40VA	4,113,772,819円	3,756,808,871円
ダイワ世界バランスファンド60VA	375,130,392円	331,712,497円



ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	677,147,826円	375,245,921円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	1,512,672,338円	805,153,176円
計	12,691,941,085円	12,150,667,512円
2. 期末日における受益権の総数	12,691,941,085口	12,150,667,512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25年12月19日 至 平成26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26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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成25年12月18日現在	平成26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）
国債証券	10,328,440	81,487,220
地方債証券	1,855,998	2,002,633
特殊債券	1,712,800	1,223,200
社債券	1,188,333	1,263,840
合計	15,085,571	85,976,893

（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25年12月3日から平成25年12月18日まで、及び平成26年12月2日から平成26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25年12月18日現在	平成26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25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.1735円	1.2137円
（1万口当たり純資産額）	（11,735円）	（12,137円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	3 3 9 2年国債	30,000,000	30,047,100	
	3 4 0 2年国債	35,000,000	35,058,450	
	3 4 1 2年国債	70,000,000	70,123,900	
	3 4 3 2年国債	55,000,000	55,103,950	
	3 4 4 2年国債	35,000,000	35,069,650	
	3 4 5 2年国債	40,000,000	40,083,200	
	3 4 6 2年国債	60,000,000	60,130,800	

9 5	5年国債	102,000,000	102,784,380	
9 6	5年国債	75,000,000	75,483,750	
9 7	5年国債	95,000,000	95,595,650	
9 8	5年国債	40,000,000	40,190,800	
1 0 0	5年国債	50,000,000	50,274,500	
1 0 1	5年国債	5,000,000	5,041,350	
1 0 6	5年国債	35,000,000	35,201,600	
1 1 1	5年国債	10,000,000	10,132,900	
1 1 2	5年国債	45,000,000	45,636,300	
1 1 3	5年国債	35,000,000	35,372,750	
1 1 4	5年国債	62,000,000	62,708,040	
1 1 5	5年国債	85,000,000	85,651,950	
1 1 6	5年国債	150,000,000	151,167,000	
1 1 7	5年国債	114,000,000	114,893,760	
1 1 8	5年国債	65,000,000	65,510,250	
1 1 9	5年国債	87,000,000	87,292,320	
1 2 0	5年国債	45,000,000	45,362,250	
1 2 1	5年国債	35,000,000	35,115,850	
1	40年国債	24,000,000	30,552,960	
2	40年国債	23,000,000	28,037,460	
3	40年国債	19,000,000	23,188,740	
4	40年国債	30,000,000	36,651,300	
5	40年国債	35,000,000	40,789,350	
6	40年国債	24,000,000	27,226,080	
7	40年国債	25,000,000	26,797,500	
2 7 7	10年国債	58,000,000	59,166,380	
2 7 8	10年国債	20,000,000	20,451,800	
2 7 9	10年国債	2,000,000	2,050,140	
2 8 0	10年国債	3,000,000	3,086,010	
2 8 1	10年国債	5,000,000	5,150,850	
2 8 7	10年国債	21,000,000	22,000,230	
2 8 8	10年国債	63,000,000	65,957,850	
2 9 2	10年国債	17,000,000	17,942,480	
2 9 3	10年国債	19,000,000	20,198,140	
2 9 4	10年国債	28,000,000	29,667,680	
2 9 5	10年国債	57,000,000	59,997,060	
2 9 6	10年国債	35,000,000	36,972,950	
2 9 7	10年国債	20,000,000	21,114,200	
2 9 8	10年国債	61,000,000	64,154,310	

299	10年国債	10,000,000	10,546,800	
300	10年国債	8,000,000	8,505,280	
301	10年国債	35,000,000	37,316,650	
302	10年国債	54,000,000	57,332,340	
303	10年国債	44,000,000	46,867,040	
304	10年国債	50,000,000	53,021,000	
305	10年国債	100,000,000	106,307,000	
306	10年国債	50,000,000	53,556,000	
307	10年国債	113,000,000	120,445,570	
308	10年国債	100,000,000	106,906,000	
309	10年国債	84,000,000	88,879,560	
310	10年国債	30,000,000	31,641,600	
311	10年国債	42,000,000	43,816,920	
312	10年国債	90,000,000	96,156,900	
313	10年国債	75,000,000	80,757,000	
314	10年国債	92,000,000	97,918,360	
315	10年国債	90,000,000	96,542,100	
316	10年国債	59,000,000	62,907,570	
317	10年国債	35,000,000	37,369,850	
318	10年国債	25,000,000	26,525,250	
319	10年国債	99,000,000	105,838,920	
320	10年国債	63,000,000	66,914,820	
321	10年国債	65,000,000	69,056,650	
322	10年国債	71,000,000	74,921,330	
323	10年国債	60,000,000	63,334,200	
324	10年国債	101,000,000	105,864,160	
325	10年国債	142,000,000	148,838,720	
326	10年国債	47,000,000	48,887,520	
327	10年国債	21,000,000	22,008,630	
328	10年国債	55,000,000	56,737,450	
329	10年国債	72,000,000	75,449,520	
330	10年国債	81,000,000	84,884,760	
331	10年国債	75,000,000	77,312,250	
332	10年国債	145,000,000	149,332,600	
333	10年国債	172,000,000	176,957,040	
334	10年国債	165,000,000	169,568,850	
335	10年国債	153,000,000	155,602,530	
2	30年国債	9,000,000	11,151,000	
3	30年国債	4,000,000	4,896,920	

4	30年国債	8,000,000	10,527,360
5	30年国債	8,000,000	9,673,520
6	30年国債	9,000,000	11,161,710
7	30年国債	12,000,000	14,671,920
8	30年国債	5,000,000	5,694,300
9	30年国債	11,000,000	11,787,820
10	30年国債	15,000,000	15,290,250
11	30年国債	9,000,000	10,045,890
12	30年国債	11,000,000	13,012,780
13	30年国債	11,000,000	12,806,970
14	30年国債	22,000,000	27,101,140
15	30年国債	21,000,000	26,224,170
16	30年国債	17,000,000	21,204,780
17	30年国債	17,000,000	20,913,400
18	30年国債	15,000,000	18,160,200
19	30年国債	15,000,000	18,177,300
20	30年国債	16,000,000	19,986,080
21	30年国債	16,000,000	19,390,400
22	30年国債	19,000,000	23,743,350
23	30年国債	20,000,000	24,975,800
24	30年国債	15,000,000	18,734,250
25	30年国債	17,000,000	20,594,480
26	30年国債	32,000,000	39,398,400
27	30年国債	31,000,000	38,825,020
28	30年国債	39,000,000	48,969,960
29	30年国債	39,000,000	48,272,640
30	30年国債	44,000,000	53,642,600
31	30年国債	42,000,000	50,397,900
32	30年国債	47,000,000	57,460,790
33	30年国債	57,000,000	66,033,360
34	30年国債	51,000,000	61,361,160
35	30年国債	57,000,000	66,098,340
36	30年国債	55,000,000	63,836,300
37	30年国債	59,000,000	67,107,190
38	30年国債	35,000,000	38,977,050
39	30年国債	36,000,000	40,916,160
40	30年国債	31,000,000	34,495,870
41	30年国債	32,000,000	34,841,920
42	30年国債	36,000,000	39,175,200

4 3	3 0 年国債	40,000,000	43,503,600	
4 4	3 0 年国債	40,000,000	43,432,000	
3 2	利付国債 2 0 年	8,000,000	8,369,680	
3 3	利付国債 2 0 年	5,000,000	5,332,950	
3 6	利付国債 2 0 年	33,000,000	35,727,450	
3 7	利付国債 2 0 年	5,000,000	5,426,950	
3 8	利付国債 2 0 年	11,000,000	11,966,460	
3 9	2 0 年国債	32,000,000	34,707,840	
4 0	2 0 年国債	51,000,000	55,403,340	
4 1	2 0 年国債	40,000,000	42,517,600	
4 2	2 0 年国債	22,000,000	24,410,320	
4 3	2 0 年国債	14,000,000	15,907,640	
4 4	2 0 年国債	32,000,000	36,126,400	
4 5	2 0 年国債	20,000,000	22,474,400	
4 6	2 0 年国債	19,000,000	21,257,390	
4 7	2 0 年国債	23,000,000	25,849,010	
4 8	2 0 年国債	9,000,000	10,321,470	
4 9	2 0 年国債	4,000,000	4,509,200	
5 0	2 0 年国債	30,000,000	33,445,500	
5 1	2 0 年国債	25,000,000	28,138,250	
5 2	2 0 年国債	19,000,000	21,568,610	
5 3	2 0 年国債	13,000,000	14,805,830	
5 4	2 0 年国債	14,000,000	16,042,040	
5 5	2 0 年国債	41,000,000	46,518,600	
5 6	2 0 年国債	12,000,000	13,650,000	
5 7	2 0 年国債	24,000,000	27,122,160	
5 8	2 0 年国債	35,000,000	39,658,850	
5 9	2 0 年国債	28,000,000	31,354,120	
6 0	2 0 年国債	16,000,000	17,531,360	
6 1	2 0 年国債	40,000,000	42,576,800	
6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,766,560	
6 3	2 0 年国債	30,000,000	33,966,000	
6 4	2 0 年国債	35,000,000	40,010,600	
6 5	2 0 年国債	42,000,000	48,116,880	
6 6	2 0 年国債	30,000,000	34,105,200	
6 7	2 0 年国債	19,000,000	21,802,120	
6 8	2 0 年国債	25,000,000	29,376,750	
6 9	2 0 年国債	12,000,000	13,992,480	
7 0	2 0 年国債	18,000,000	21,538,620	

7 1	2 0 年国債	17,000,000	20,018,180	
7 2	2 0 年国債	53,000,000	62,032,790	
7 3	2 0 年国債	30,000,000	34,897,800	
7 4	2 0 年国債	22,000,000	25,804,900	
7 5	2 0 年国債	14,000,000	16,462,880	
7 6	2 0 年国債	25,000,000	28,888,000	
7 7	2 0 年国債	12,000,000	13,985,160	
7 8	2 0 年国債	17,000,000	19,676,820	
7 9	2 0 年国債	14,000,000	16,354,520	
8 0	2 0 年国債	14,000,000	16,496,340	
8 1	2 0 年国債	18,000,000	21,064,680	
8 2	2 0 年国債	28,000,000	33,057,080	
8 3	2 0 年国債	25,000,000	29,569,250	
8 4	2 0 年国債	27,000,000	31,649,400	
8 5	2 0 年国債	31,000,000	36,728,180	
8 6	2 0 年国債	6,000,000	7,241,880	
8 7	2 0 年国債	20,000,000	23,924,000	
8 8	2 0 年国債	33,000,000	39,911,190	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	17,966,700	
9 0	2 0 年国債	37,000,000	44,396,300	
9 1	2 0 年国債	18,000,000	21,799,800	
9 2	2 0 年国債	52,000,000	61,869,600	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	21,224,520	
9 4	2 0 年国債	36,000,000	42,916,320	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	36,521,400	
9 6	2 0 年国債	23,000,000	27,439,920	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	30,164,250	
9 8	2 0 年国債	29,000,000	34,621,650	
9 9	2 0 年国債	54,000,000	64,541,880	
1 0 0	2 0 年国債	20,000,000	24,162,400	
1 0 1	2 0 年国債	30,000,000	37,032,600	
1 0 2	2 0 年国債	20,000,000	24,709,600	
1 0 3	2 0 年国債	21,000,000	25,664,310	
1 0 4	2 0 年国債	24,000,000	28,708,560	
1 0 5	2 0 年国債	38,000,000	45,468,520	
1 0 6	2 0 年国債	23,000,000	27,831,840	
1 0 7	2 0 年国債	45,000,000	53,853,300	
1 0 8	2 0 年国債	18,000,000	21,061,800	
1 0 9	2 0 年国債	35,000,000	40,942,650	

1 1 0	2 0 年国債	28,000,000	33,510,400	
1 1 1	2 0 年国債	35,000,000	42,381,850	
1 1 2	2 0 年国債	30,000,000	35,928,000	
1 1 3	2 0 年国債	73,000,000	87,359,830	
1 1 4	2 0 年国債	51,000,000	61,019,970	
1 1 5	2 0 年国債	15,000,000	18,164,100	
1 1 6	2 0 年国債	27,000,000	32,689,980	
1 1 7	2 0 年国債	43,000,000	51,431,870	
1 1 8	2 0 年国債	33,000,000	38,996,100	
1 1 9	2 0 年国債	13,000,000	14,977,690	
1 2 0	2 0 年国債	38,000,000	42,660,700	
1 2 1	2 0 年国債	56,000,000	65,298,800	
1 2 2	2 0 年国債	14,000,000	16,115,400	
1 2 3	2 0 年国債	42,000,000	50,169,000	
1 2 4	2 0 年国債	35,000,000	41,277,250	
1 2 5	2 0 年国債	28,000,000	33,853,400	
1 2 6	2 0 年国債	21,000,000	24,764,460	
1 2 7	2 0 年国債	23,000,000	26,751,760	
1 2 8	2 0 年国債	27,000,000	31,372,920	
1 2 9	2 0 年国債	37,000,000	42,421,980	
1 3 0	2 0 年国債	28,000,000	32,063,640	
1 3 1	2 0 年国債	35,000,000	39,534,600	
1 3 2	2 0 年国債	25,000,000	28,197,250	
1 3 3	2 0 年国債	43,000,000	49,211,780	
1 3 4	2 0 年国債	25,000,000	28,549,750	
1 3 5	2 0 年国債	24,000,000	27,047,280	
1 3 6	2 0 年国債	20,000,000	22,222,000	
1 3 7	2 0 年国債	18,000,000	20,237,400	
1 3 8	2 0 年国債	31,000,000	33,862,230	
1 3 9	2 0 年国債	26,000,000	28,815,800	
1 4 0	2 0 年国債	72,000,000	80,813,520	
1 4 1	2 0 年国債	50,000,000	56,021,000	
1 4 2	2 0 年国債	27,000,000	30,691,710	
1 4 3	2 0 年国債	48,000,000	52,891,680	
1 4 4	2 0 年国債	21,000,000	22,795,500	
1 4 5	2 0 年国債	72,000,000	80,304,480	
1 4 6	2 0 年国債	73,000,000	81,322,730	
1 4 7	2 0 年国債	74,000,000	81,022,600	
1 4 8	2 0 年国債	65,000,000	69,849,650	



	149	20年国債	75,000,000	80,395,500	
	150	20年国債	73,000,000	76,739,060	
国債証券 合計				10,328,476,930	
地方債証券	648	東京都公債	100,000,000	104,531,600	
	653	東京都公債	100,000,000	104,518,400	
	20-6	北海道公債	100,000,000	106,105,900	
	293	大阪府公債	100,000,000	103,461,300	
	19-2	静岡県公債	100,000,000	104,782,500	
	24-16	愛知県公債	100,000,000	104,093,100	
	19-1	広島県公債	110,800,000	115,499,803	
	21-2	埼玉県公債	100,000,000	106,665,700	
	24-7	福岡県5年	100,000,000	100,439,300	
	76	共同発行地方	100,000,000	106,112,900	
	117	共同発行地方	100,000,000	103,813,500	
	21-6	大阪市公債	100,000,000	107,343,000	
	24-6	京都市5年	100,000,000	100,302,000	
	18-4	札幌市公債	100,000,000	103,094,100	
	18-2	北九州市債	100,000,000	103,517,100	
地方債証券 合計				1,574,280,203	
特殊債券	16	政保政策投資B	100,000,000	103,909,400	
	5	日本政策投資CO	100,000,000	107,045,600	
	3	政保道路機構	100,000,000	101,628,600	
	27	政保道路機構	50,000,000	51,954,700	
	56	政保道路機構	100,000,000	104,572,600	
	122	政保道路機構	100,000,000	104,844,000	
	190	政保道路機構	100,000,000	102,884,600	
	2	政保地方公営機	100,000,000	106,126,800	
	3	政保地方公共6年	100,000,000	101,149,300	
	26	公営企業	100,000,000	103,889,400	
	28	公営企業	100,000,000	105,204,600	
	27	国際協力銀行	100,000,000	103,850,400	
	30	国際協力銀行	100,000,000	105,867,800	
1728	利付農林債	100,000,000	100,452,100		
特殊債券 合計				1,403,379,900	
社債券	10	首都高速道路	100,000,000	100,679,100	
	4	成田国際空港	100,000,000	104,766,100	
	7	オーストラリアコモンウェルス	100,000,000	100,210,100	
	33	中日本高速道	100,000,000	105,913,900	
	1	明治安田2011基	100,000,000	101,261,600	

6	ドン・キホーテ	100,000,000	101,717,300	
5 8	伊藤忠商事	100,000,000	100,677,100	
3 5	みずほBK	100,000,000	100,447,000	
1 6 4	オリックス	100,000,000	104,134,500	
1 5	三菱UFJリース	100,000,000	101,099,600	
7 0	東日本旅客鉄道	100,000,000	106,038,300	
1 5	NTTドコモ	100,000,000	106,524,600	
3 7 8	東北電力	100,000,000	104,987,400	
2 6 1	北海道電力	3,000,000	3,218,850	
社債券 合計			1,341,675,450	
合計			14,647,812,483	

## 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。

## 「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25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	178,858,708	-
コール・ローン	965,535,380	1,393,450,117
国債証券	145,979,809,599	167,711,973,324
派生商品評価勘定	9,136,371	3,286,694
未収入金	2,921,815	330,603,769
未収利息	1,519,473,783	1,577,604,580
前払費用	49,311,789	35,146,802
流動資産合計	148,705,047,445	171,052,065,286
資産合計	148,705,047,445	171,052,065,286
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	992,677	3,807,230

前受金	-	323,424,760
未払金	-	2,428,994
未払解約金	128,159,000	275,972,000
流動負債合計	129,151,677	605,632,984
負債合計	129,151,677	605,632,984
純資産の部		
元本等		
元本	1	60,054,118,108
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	88,521,777,660	112,191,752,420
元本等合計	148,575,895,768	170,446,432,302
純資産合計	148,575,895,768	170,446,432,302
負債純資産合計	148,705,047,445	171,052,065,286

## 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25年12月19日 至 平成26年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1. 1 期首	平成24年12月19日	平成25年12月19日
期首元本額	62,378,283,951円	60,054,118,108円
期中追加設定元本額	4,344,275,934円	4,857,376,486円
期中一部解約元本額	6,668,441,777円	6,656,814,712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	2,545,379,912円	2,257,226,543円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30 V A (一般投資家私 募)	84,164,616円	70,806,460円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50 V A (一般投資家私 募)	643,546,074円	519,882,604円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30 V A (一般投資家私 募)	167,354,074円	127,652,861円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50 V A (一般投資家私 募)	2,056,271,586円	1,666,504,098円
ワールドアセット (安定コー ス)	128,133円	- 円
ワールドアセット (分散コー ス)	85,567円	- 円
D - I ' s 外国債券インデッ クス	406,104円	479,462円
DCダイワ外国債券インデッ クス	32,349,060,558円	34,564,449,956円

ダイワ・ライフ・バランス30	445,800,383円	409,660,113円
ダイワ・ライフ・バランス50	178,683,574円	191,399,099円
ダイワ・ライフ・バランス70	100,777,152円	109,356,466円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	174,921,608円	187,229,796円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	123,959,627円	150,595,289円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	29,707,678円	37,167,376円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	7,425,218円	8,991,257円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	4,697,941円	6,645,252円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	279,828円	335,422円
ダイワ世界バランスファンド40VA	2,763,914,461円	2,174,142,605円
ダイワ世界バランスファンド60VA	299,269,751円	228,683,867円
ダイワ・バランスファンド35VA	10,102,491,803円	8,552,380,920円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	1,292,865,235円	615,247,592円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	1,079,918,049円	492,148,765円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	553,506,309円	447,009,986円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	414,192円	41,674,967円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	4,971,994,896円	5,315,895,721円
ダイワライフスタイル25	25,924,729円	25,786,212円
ダイワライフスタイル50	40,647,847円	42,280,879円
ダイワライフスタイル75	10,521,203円	11,046,314円
計	60,054,118,108円	58,254,679,882円
2. 期末日における受益権の総数	60,054,118,108口	58,254,679,882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25年12月19日 至 平成26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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成25年12月18日現在	平成26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）
国債証券	554,438,294	555,739,190
合計	554,438,294	555,739,190

(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25年12月3日から平成25年12月18日まで、及び平成26年12月2日から平成26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25年12月18日 現在				平成26年12月18日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(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	979,277,735	-	986,725,610	7,447,875	1,030,239,595	-	1,029,719,059	520,536
アメリカ・ドル	337,974,171	-	339,581,410	1,607,239	337,344,788	-	340,161,450	2,816,662
イギリス・ポンド	137,896,920	-	137,520,600	376,320	149,877,653	-	149,841,900	35,753

オーストラリア・ドル	21,459,989	-	21,070,300	389,689	25,305,249	-	24,272,640	1,032,609
カナダ・ドル	61,235,909	-	61,137,590	98,319	60,949,695	-	60,774,120	175,575
シンガポール・ドル	5,137,492	-	5,151,510	14,018	5,798,086	-	5,779,840	18,246
スイス・フラン	5,426,472	-	5,578,560	152,088	5,141,486	-	5,123,580	17,906
スウェーデン・クローナ	7,946,711	-	7,976,030	29,319	7,651,852	-	7,456,540	195,312
デンマーク・クローネ	11,264,160	-	11,444,940	180,780	11,140,187	-	11,099,520	40,667
ノルウェー・クローネ	4,737,858	-	4,774,040	36,182	4,300,598	-	4,064,700	235,898
ポーランド・ズロチ	11,944,496	-	12,198,190	253,694	9,829,685	-	9,671,200	158,485
メキシコ・ペソ	15,127,985	-	15,361,220	233,235	17,365,706	-	16,560,809	804,897
ユーロ	351,970,660	-	357,813,120	5,842,460	387,195,424	-	386,947,320	248,104
南アフリカ・ランド	7,154,912	-	7,118,100	36,812	8,339,186	-	7,965,440	373,746
合計	1,144,682,754	-	1,151,434,810	8,143,694	1,030,239,595	-	1,029,719,059	520,536

## (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25年12月18日現在	平成26年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.4740円	2.9259円



(1万口当たり純資産額)	(24,740円)	(29,259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	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20160215	1,826,000.000	1,914,232.320	
		5.125% United States Treasury Note/Bond 20160515	1,940,000.000	2,068,214.600	
		4.875% United States Treasury Note/Bond 20160815	1,999,000.000	2,144,467.230	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20161115	2,336,000.000	2,512,928.640	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20170215	2,039,000.000	2,209,684.690	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20170515	1,795,000.000	1,952,259.950	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20170815	2,401,000.000	2,641,172.030	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20171115	1,686,000.000	1,840,960.260	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20180215	3,839,000.000	4,118,210.470	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,960,000.000	3,222,463.200	
		4% United States Treasury Note/Bond 20180815	3,173,000.000	3,483,827.080	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,488,000.000	2,714,432.880	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	3,161,000.000	3,326,699.620			
2.625% United States Treasury Note/Bond 20160229	2,195,000.000	2,254,572.300			

2.375% United States Treasury Note/Bond 20160331	2,463,000.000	2,526,865.590	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20160430	2,001,000.000	2,061,810.390	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,096,000.000	3,308,354.640	
3.25% United States Treasury Note/Bond 20160531	621,000.000	646,200.180	
3.25% United States Treasury Note/Bond 20160630	2,121,000.000	2,211,057.660	
3.25% United States Treasury Note/Bond 20160731	1,833,000.000	1,915,118.400	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	3,116,000.000	3,404,946.680	
3% United States Treasury Note/Bond 20160831	2,488,000.000	2,593,242.400	
3% United States Treasury Note/Bond 20160930	2,499,000.000	2,607,631.530	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20161031	2,319,000.000	2,428,503.180	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,357,921.200	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20161130	4,149,000.000	4,318,984.530	
3.25% United States Treasury Note/Bond 20161231	4,011,000.000	4,219,531.890	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20170131	2,884,000.000	3,031,689.640	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	5,630,000.000	6,185,512.100	
3% United States Treasury Note/Bond 20170228	2,687,000.000	2,820,597.640	
3.25% United States Treasury Note/Bond 20170331	4,635,000.000	4,898,777.850	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20170430	1,653,000.000	1,743,452.160	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,357,252.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20170531	2,835,000.000	2,966,430.600	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20170630	3,468,000.000	3,607,101.480	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20170731	1,773,000.000	1,838,441.430	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,984,656.120	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20170831	2,903,000.000	2,970,697.960	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20170930	2,831,000.000	2,898,547.660	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20171031	382,000.000	391,114.520	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,711,544.280	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20151130	1,731,000.000	1,749,037.020	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20171130	883,000.000	913,313.390	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20151231	2,515,000.000	2,562,231.700	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	924,000.000	969,045.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20160131	635,000.000	646,804.650	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20180131	255,000.000	266,633.100	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,497,906.760	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20160229	200,000.000	204,304.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	1,234,000.000	1,296,366.360	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20160331	2,649,000.000	2,713,238.250	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20180331	1,300,000.000	1,370,174.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20160430	2,295,000.000	2,345,099.850	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	260,000.000	271,902.800	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,417,000.000	3,673,377.510	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20160531	3,832,000.000	3,906,379.120	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20180531	1,322,000.000	1,371,984.820	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20160630	3,406,000.000	3,460,393.820	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,065,000.000	1,105,512.600	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20160731	2,053,000.000	2,086,422.840	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,341,000.000	1,385,413.920	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,568,031.620	
1% United States Treasury Note/Bond 20160831	4,502,000.000	4,538,736.320	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20180831	3,444,000.000	3,463,906.320	
1% United States Treasury Note/Bond 20160930	2,793,000.000	2,815,120.560	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180930	2,835,000.000	2,835,425.250	
1% United States Treasury Note/Bond 20161031	2,718,000.000	2,738,901.420	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	1,320,000.000	1,337,622.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211115	1,353,000.000	1,359,765.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20161130	3,027,000.000	3,041,529.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,165,000.000	2,163,462.850	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20161231	3,410,000.000	3,423,708.200	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,861,000.000	1,857,203.560	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170131	2,970,000.000	2,979,622.800	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,426,000.000	1,413,679.360	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,236,573.600	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170228	2,408,000.000	2,414,188.560	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190228	1,843,000.000	1,835,793.870	
1% United States Treasury Note/Bond 20170331	3,856,000.000	3,873,737.600	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190331	300,000.000	300,279.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170430	2,375,000.000	2,377,588.750	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190430	559,000.000	553,057.830	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,418,844.530	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170531	2,125,000.000	2,112,462.500	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,345,122.800	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20170630	3,906,000.000	3,889,946.340	
1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,335,824.640	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170731	5,660,000.000	5,595,193.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,784,000.000	1,729,498.800	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,477,034.580	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170831	6,410,000.000	6,349,105.000	
1% United States Treasury Note/Bond 20190831	2,562,000.000	2,495,131.800	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170930	1,913,000.000	1,891,918.740	
1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,155,460.800	

0.75% United States Treasury Note/Bond 20171031	2,648,000.000	2,626,259.920	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	869,696.880	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,077,395.200	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20171130	2,336,000.000	2,305,702.080	
1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,313,465.340	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20151215	2,822,000.000	2,821,209.840	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	1,913,000.000	1,892,224.820	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	894,000.000	872,347.320	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20160115	2,425,000.000	2,426,988.500	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180131	2,153,000.000	2,135,151.630	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	664,000.000	655,075.840	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20160215	143,000.000	143,094.380	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	3,850,000.000	3,842,146.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	3,447,000.000	3,400,534.440	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,926,947.520	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20160315	3,155,000.000	3,156,703.700	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180331	2,315,000.000	2,281,525.100	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,127,369.200	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20160415	2,037,000.000	2,034,372.270	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,571,154.500	

0.25% United States Treasury Note/Bond 20160515	2,512,000.000	2,507,578.880	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	4,218,000.000	4,134,272.700	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,407,687.650	
1% United States Treasury Note/Bond 20180531	3,407,000.000	3,377,699.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,415,225.400	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20160615	3,186,000.000	3,189,600.180	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,693,000.000	1,698,146.720	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,145,469.490	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20160715	3,108,000.000	3,114,899.760	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,864,966.610	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,697,000.000	1,699,901.870	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,468,000.000	4,623,307.680	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20160815	2,989,000.000	2,994,469.870	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	2,030,209.310	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20160915	1,816,000.000	1,826,423.840	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,905,603.050	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20161015	2,870,000.000	2,872,554.300	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181031	3,611,000.000	3,590,670.070	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,336,933.200	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	4,774,000.000	5,036,570.000	

0.625% United States Treasury Note/Bond 20161115	719,000.000	719,194.130	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181130	3,359,000.000	3,338,006.250	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20151130	772,000.000	771,938.240	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,525,209.680	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20161215	144,000.000	143,948.160	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20181231	2,026,000.000	2,030,740.840	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20151231	1,438,000.000	1,437,381.660	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,067,744.680	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20170115	2,168,000.000	2,170,623.280	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	6,275,000.000	6,621,568.250	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190131	2,185,000.000	2,188,736.350	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20160131	3,057,000.000	3,058,895.340	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	2,769,000.000	2,812,030.260	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170215	2,190,000.000	2,185,116.300	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,373,000.000	2,376,891.720	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20160229	3,101,000.000	3,097,836.980	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	2,689,000.000	2,709,785.970	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20170315	1,182,000.000	1,182,224.580	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20160331	5,058,000.000	5,058,961.020	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190331	2,383,000.000	2,394,915.000	



2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,883,569.780	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170415	1,485,000.000	1,487,376.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20160430	3,122,000.000	3,122,343.420	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,412,000.000	5,587,457.040	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190430	2,975,000.000	2,988,000.750	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170515	2,237,000.000	2,238,297.460	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,804,000.000	2,865,547.800	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,241,000.000	2,238,714.180	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,749,075.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20160531	3,013,000.000	3,011,704.410	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170615	753,000.000	752,615.970	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20160630	2,858,000.000	2,859,886.280	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2,885,000.000	2,895,126.350	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,533,162.700	
7.25% United States Treasury Note/Bond 20160515	1,850,000.000	2,027,840.500	
7.5% United States Treasury Note/Bond 20161115	1,552,000.000	1,755,032.640	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20170515	1,527,000.000	1,816,473.390	
8.875% United States Treasury Note/Bond 20190215	904,000.000	1,177,875.840	
8.125% United States Treasury Note/Bond 20190815	1,582,000.000	2,053,135.420	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	885,754.560	

8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,939,997.060	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	874,672.680	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,175,821.650	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	909,757.800	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	1,012,232.210	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	958,776.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	938,000.000	1,261,534.960	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	215,000.000	289,964.050	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,347,000.000	2,018,600.730	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,436,000.000	2,006,580.240	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,606,000.000	2,142,869.740	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	780,880.790	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	108,000.000	141,555.600	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	1,019,000.000	1,359,886.070	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	255,000.000	293,387.700	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	694,000.000	893,143.300	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	353,000.000	470,976.130	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	810,000.000	1,063,181.700	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,517,000.000	2,067,382.770	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,945,639.200	

3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,944,122.450	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,992,000.000	2,580,416.880	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,130,000.000	2,977,505.700	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,807,000.000	2,396,100.070	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,646,797.560	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	2,492,000.000	2,692,132.520	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,865,000.000	3,087,467.250	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	2,990,000.000	3,144,852.100	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,731,675.090	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	3,984,000.000	3,982,127.520	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,026,000.000	2,176,207.640	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,998,000.000	4,093,232.360	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,314,000.000	3,899,119.840	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,306,976.130	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,258,438.780	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	2,993,000.000	3,370,147.930	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170715	2,583,000.000	2,579,848.740	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,334,813.900	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20160731	2,719,000.000	2,720,359.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,893,995.780	

	2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,694,000.000	6,832,030.280	
	3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	4,012,142.970	
	0.875% United States Treasury Note/Bond 20170815	1,818,000.000	1,813,654.980	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,189,000.000	1,191,544.460	
	0.5% United States Treasury Note/Bond 20160831	2,219,000.000	2,218,733.720	
	2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,307,088.680	
	1% United States Treasury Note/Bond 20170915	148,000.000	148,039.960	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,427,657.800	
	0.5% United States Treasury Note/Bond 20160930	2,222,000.000	2,220,000.200	
	2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,672,850.000	
	0.875% United States Treasury Note/Bond 20171015	1,466,000.000	1,459,974.740	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,173,794.800	
	2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,172,625.350	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	1,448,000.000	1,461,003.040	
	3% United States Treasury Note/Bond 20441115	1,436,000.000	1,510,485.320	
	0.875% United States Treasury Note/Bond 20171115	1,593,000.000	1,585,337.670	
	0.375% United States Treasury Note/Bond 20161031	145,000.000	144,427.250	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 559,975,990.970 (66,513,948,208)	
イギリス・ボ ンド		イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	

2% United Kingdom Gilt 20200722	271,000.000	280,485.000	
8.75% United Kingdom Gilt 20170825	595,000.000	723,817.500	
8% United Kingdom Gilt 20151207	186,000.000	199,782.600	
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,213,000.000	1,709,966.100	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,412,491.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,114,000.000	2,727,060.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,662,000.000	2,167,081.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,932,000.000	2,531,692.800	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,075,787.900	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	2,029,320.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,492,655.200	
4% United Kingdom Gilt 20160907	2,475,000.000	2,625,232.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,831,000.000	2,539,230.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,552,196.800	
5% United Kingdom Gilt 20180307	1,604,000.000	1,816,690.400	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,793,000.000	2,525,440.500	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,765,000.000	2,382,044.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,773,000.000	2,505,249.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20190307	1,820,000.000	2,078,440.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,178,000.000	1,572,630.000	

4% United Kingdom Gilt 20220307	1,391,000.000	1,631,503.900	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,870,000.000	2,509,727.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,428,000.000	1,597,360.800	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,144,000.000	1,617,158.400	
3.75% United Kingdom Gilt 20200907	2,155,000.000	2,443,985.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,657,000.000	2,220,711.400	
2% United Kingdom Gilt 20160122	828,000.000	842,241.600	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	1,843,000.000	2,117,238.400	
1.75% United Kingdom Gilt 20170122	1,533,000.000	1,571,325.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,182,000.000	1,541,800.800	
1% United Kingdom Gilt 20170907	2,737,000.000	2,757,253.800	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,416,000.000	2,448,374.400	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,012,000.000	2,316,214.400	
1.25% United Kingdom Gilt 20180722	3,222,000.000	3,252,609.000	
2.25% United Kingdom Gilt 20230907	2,393,000.000	2,507,146.100	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	963,000.000	1,249,107.300	
1.75% United Kingdom Gilt 20190722	2,922,000.000	2,995,634.400	
2.75% United Kingdom Gilt 20240907	2,259,000.000	2,458,017.900	
3.5% United Kingdom Gilt 20450122	576,000.000	694,540.800	
イギリス・ボンド 小計		イギリス・ボンド 76,719,245.800 (14,199,198,013)	

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% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	1,737,000.000	1,874,414.070	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	2,506,000.000	2,807,396.620	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,755,000.000	2,092,574.250	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,619,000.000	2,894,518.800	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,882,000.000	2,284,503.340	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20160615	1,636,000.000	1,695,026.880	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	2,063,000.000	2,265,256.520	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,527,000.000	3,054,283.820	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170721	1,385,000.000	1,456,369.050	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,023,000.000	1,211,958.330	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,617,000.000	1,613,636.640	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	649,000.000	661,590.600	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,360,000.000	1,408,932.800	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	783,000.000	919,782.270	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20181021	671,000.000	695,733.060	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	857,000.000	968,075.770	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	162,000.000	165,019.680		
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	763,000.000	806,002.680		
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 28,875,075.180		

			(2,786,444,755)
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	285,000.000	321,819.150
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	642,608.940
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,093,000.000	1,590,271.280
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,017,000.000	1,561,867.920
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,470,000.000	2,165,530.500
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	571,000.000	595,832.790
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	1,747,000.000	1,875,124.980
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	969,000.000	1,070,648.100
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	2,199,000.000	2,437,503.540
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,413,000.000	1,878,442.200
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,476,000.000	1,640,455.920
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20151201	1,155,000.000	1,176,875.700
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,257,000.000	1,394,364.960
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	629,000.000	638,233.720
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160901	761,000.000	783,799.560
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,572,000.000	1,698,153.000
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,595,000.000	2,007,307.500
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170301	1,327,000.000	1,342,287.040
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170901	216,000.000	218,620.080



	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,199,000.000	1,180,595.350	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160201	1,438,000.000	1,442,242.100	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180301	1,265,000.000	1,270,110.600	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160801	1,585,000.000	1,585,618.150	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180901	1,021,000.000	1,023,930.270	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,105,000.000	1,173,233.750	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170201	455,000.000	459,891.250	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190301	853,000.000	870,844.760	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160501	1,166,000.000	1,166,279.840	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	295,000.000	300,634.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170801	341,000.000	342,858.450	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	263,000.000	288,784.520	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	700,000.000	722,799.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20161101	1,014,000.000	1,015,034.280	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	166,000.000	166,863.200	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180201	98,000.000	98,401.800	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 38,147,868.700 (3,892,990,001)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	545,485.080	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	391,000.000	432,058.910	

	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	753,454.800	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	442,000.000	495,265.420	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	471,301.140	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	788,000.000	827,250.280	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	768,000.000	823,841.280	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	323,000.000	335,719.740	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	279,000.000	290,625.930	
	1.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20160401	686,000.000	691,021.520	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	197,000.000	201,077.900	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	227,000.000	224,682.330	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20180401	272,000.000	267,933.600	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	333,000.000	348,850.800	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	173,000.000	190,926.260	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	336,000.000	351,257.760	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	70,000.000	70,514.500	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 7,321,267.250 (661,769,347)	
スイス・フラン	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	660,000.000	863,346.000	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	589,000.000	857,737.140	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	1,025,000.000	1,058,763.500	

	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	203,000.000	225,356.390	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	673,000.000	737,385.910	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	514,000.000	581,565.300	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	37,000.000	41,491.430	
	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	295,000.000	330,842.500	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 4,696,488.170 (572,924,592)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,680,000.000	スウェーデン・クローナ 7,220,472.800	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,600,000.000	4,815,418.000	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,693,121.000	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	9,420,000.000	11,071,231.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,350,000.000	6,024,706.500	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	7,555,000.000	9,162,401.800	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	6,290,000.000	6,677,086.600	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	3,160,000.000	3,657,226.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 54,321,664.500 (840,899,366)	
デンマーク・ク ローネ	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	3,957,000.000	デンマーク・クローネ 6,411,131.400	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	8,385,000.000	9,359,001.600	

	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,932,000.000	19,770,130.800	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	10,227,019.050	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	6,150,000.000	7,257,676.500	
	2.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20161115	5,392,000.000	5,653,997.280	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	5,846,000.000	6,306,547.880	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	1,682,000.000	1,834,725.600	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 66,820,230.110 (1,315,690,331)	
ノルウェー・ク ローネ	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	6,185,000.000	6,677,758.950	ノルウェー・クローネ
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	5,075,000.000	5,828,383.750	ノルウェー・クローネ
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	5,808,000.000	6,693,081.120	ノルウェー・クローネ
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,149,000.000	5,364,279.690	ノルウェー・クローネ
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,597,128.900	ノルウェー・クローネ
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 29,160,632.410 (465,403,694)	
ポーランド・ズ ロチ	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,842,055.740	ポーランド・ズロチ
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,029,000.000	2,213,192.620	ポーランド・ズロチ
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	1,912,000.000	2,196,773.280	ポーランド・ズロチ
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290425	627,000.000	846,638.100	ポーランド・ズロチ

	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20201025	2,470,000.000	2,862,927.600	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20160425	2,871,000.000	2,990,175.210	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20211025	1,950,000.000	2,359,012.500	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20161025	2,615,000.000	2,751,398.400	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20170425	1,177,000.000	1,252,634.020	
	4% POLAND GOVERNMENT BOND 20231025	3,083,000.000	3,448,767.120	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20180425	1,720,000.000	1,812,690.800	
	2.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20180725	1,376,000.000	1,393,901.760	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20160125	1,936,000.000	1,897,880.160	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20160725	577,000.000	560,238.150	
	3.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20190725	1,061,000.000	1,108,002.300	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	558,000.000	591,401.880	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 31,127,689.640 (1,076,706,785)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	2,137,000.000	2,159,502.610	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	1,210,000.000	1,225,512.200	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	1,417,000.000	1,525,372.160	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,016,197.700	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	521,750.880	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	801,630.360	

4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,630,010.550	
4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	1,427,000.000	1,432,294.170	
4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	238,000.000	240,739.380	
4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	2,461,000.000	2,450,048.550	
4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,520,964.400	
3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	1,595,000.000	1,571,441.850	
3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	829,202.500	
3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	698,083.070	
4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	580,987.980	
3.314% MALAYSIAN GOVERNMENT 20171031	399,000.000	393,713.250	
3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	444,000.000	432,091.920	
3.172% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160715	953,000.000	946,691.140	
3.26% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180301	533,000.000	523,048.890	
3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	401,000.000	380,448.750	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	477,000.000	439,321.770	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	547,769.360	
3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	648,239.520	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	233,000.000	235,309.030	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	488,000.000	485,647.840	
3.394% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170315	340,000.000	337,552.000	

	4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	850,521.080	
	3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	192,000.000	189,972.480	
マレーシア・リングット 小計			マレーシア・リングット 24,614,065.390 (842,293,318)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5% Mexican Bonos 20191211	769,000.000	764,808.950	
	8% Mexican Bonos 20231207	8,233,000.000	9,353,511.300	
	10% Mexican Bonos 20241205	15,850,000.000	20,520,995.000	
	8% Mexican Bonos 20151217	12,987,000.000	13,595,181.210	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	8,568,000.000	9,397,296.720	
	7.25% Mexican Bonos 20161215	10,474,000.000	11,188,117.320	
	7.75% Mexican Bonos 20171214	13,756,000.000	15,009,309.160	
	10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	9,400,401.220	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	10,451,397.000	
	8.5% Mexican Bonos 20181213	6,960,000.000	7,852,063.200	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	11,584,039.180	
	8% Mexican Bonos 20200611	12,728,000.000	14,393,204.240	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	13,441,000.000	14,112,646.770	
	6.25% Mexican Bonos 20160616	11,839,000.000	12,322,859.930	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	14,891,000.000	16,528,861.090	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	14,299,000.000	14,846,651.700	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	6,878,000.000	7,642,902.380	
	5% Mexican Bonos 20170615	9,290,000.000	9,511,009.100	
	4.75% Mexican Bonos 20180614	9,384,000.000	9,377,712.720	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	2,101,000.000	2,329,483.750	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 220,182,451.940 (1,794,486,984)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	232,000.000	235,106.480	
	0.25% Austria Government Bond 20191018	347,000.000	348,578.850	
	6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	315,209.410	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	774,000.000	1,171,673.460	

6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,797,980.360	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,170,510.440	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,113,000.000	1,665,493.200	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,659,685.200	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,705,000.000	2,828,424.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,857,000.000	3,009,955.590	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,911,000.000	2,913,415.050	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	1,033,000.000	1,070,704.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	1,552,000.000	1,647,882.560	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,353,638.300	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	1,975,557.500	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,329,134.360	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	2,019,729.360	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	2,211,000.000	2,548,509.150	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,745,000.000	3,036,457.050	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	3,090,522.240	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,872,576.230	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,408,473.250	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	2,247,000.000	2,606,520.000	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	1,974,341.820	



2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	2,072,000.000	2,324,929.040	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,547,000.000	2,908,572.120	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	2,065,000.000	2,475,790.450	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,607,609.800	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,707,000.000	1,913,888.400	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,922,000.000	3,239,855.160	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,376,000.000	1,750,904.960	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	2,426,000.000	2,643,175.520	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,850,000.000	2,016,444.500	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,981,820.070	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,707,000.000	1,932,972.660	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,105,000.000	1,225,699.150	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	285,000.000	364,438.050	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,705,000.000	1,852,942.850	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,654,000.000	1,717,596.300	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20151211	428,000.000	428,308.160	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160311	1,103,000.000	1,107,059.040	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160610	655,000.000	658,058.850	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20160916	1,030,000.000	1,031,174.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20161216	35,000.000	35,053.200	

2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160226	927,000.000	949,674.420	
2.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160408	1,642,000.000	1,700,750.760	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20161014	997,000.000	1,020,200.190	
0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170224	1,717,000.000	1,746,051.640	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170407	1,848,000.000	1,871,229.360	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20171013	149,000.000	151,237.980	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180223	890,000.000	905,592.800	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180413	1,392,000.000	1,404,458.400	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20181012	1,209,000.000	1,255,679.490	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190222	523,000.000	544,866.630	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190412	1,113,000.000	1,136,206.050	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,161,428.060	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	915,205.620	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	2,115,778.200	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,141,000.000	3,250,616.070	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	4,073,938.680	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	2,925,000.000	3,196,791.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,507,000.000	4,182,052.050	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,113,000.000	3,266,085.230	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,075,000.000	3,622,380.750	

4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,800,000.000	2,841,930.000	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,913,306.500	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	3,522,000.000	3,677,566.740	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,222,000.000	3,201,213.180	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	3,288,000.000	3,579,020.880	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,123,000.000	4,081,667.310	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	2,396,000.000	2,686,323.320	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,561,893.880	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	2,218,000.000	2,573,101.800	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,365,000.000	3,715,367.700	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	2,610,000.000	3,056,858.100	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,590,000.000	4,204,213.100	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,095,000.000	1,754,244.750	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,965,941.980	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,506,234.160	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,377,000.000	5,210,161.950	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	2,988,000.000	3,525,332.040	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,653,000.000	3,141,258.120	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	1,940,000.000	2,190,163.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180525	2,114,000.000	2,182,176.500	

3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	378,000.000	497,637.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	2,747,000.000	2,997,938.450	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181125	984,000.000	1,018,626.960	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	2,623,000.000	2,970,757.340	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190525	1,764,000.000	1,828,615.320	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161125	1,401,000.000	1,408,411.290	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	1,291,000.000	1,490,098.020	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,014,000.000	2,182,148.860	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	1,470,000.000	1,489,786.200	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160225	1,756,000.000	1,803,412.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160725	2,838,000.000	2,952,711.960	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170225	2,315,000.000	2,404,428.450	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170725	1,868,000.000	1,916,754.800	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	1,087,359.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,925,814.870	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,195,000.000	1,812,683.550	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	1,398,000.000	1,486,241.760	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,291,000.000	1,620,876.320	
4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	1,405,000.000	1,567,530.400	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,388,196.720	

4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,347,000.000	1,585,324.710	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,353,850.020	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,739,000.000	2,669,417.170	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,775,000.000	2,110,723.500	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170115	1,465,000.000	1,541,370.450	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,628,635.660	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	600,000.000	724,044.000	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180115	1,477,000.000	1,532,431.810	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160415	1,185,000.000	1,185,426.600	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,105,000.000	1,210,781.650	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115	1,170,000.000	1,226,043.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170415	317,000.000	320,750.110	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	466,000.000	617,501.260	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	900,000.000	1,005,381.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	348,000.000	349,193.640	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	2,131,498.600	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,678,475.400	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,722,000.000	3,928,390.400	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	454,000.000	475,955.440	
0.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180115	1,743,000.000	1,740,542.370	

5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,654,000.000	3,488,629.920	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	3,118,000.000	4,461,109.680	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,880,000.000	2,646,551.200	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170801	2,528,000.000	2,820,742.400	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190201	4,052,000.000	4,591,037.560	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,241,230.700	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,368,000.000	3,073,521.920	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,589,000.000	2,949,440.580	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	3,122,173.320	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20160801	3,007,000.000	3,159,966.090	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170201	2,280,000.000	2,439,258.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180201	2,480,000.000	2,756,693.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,674,000.000	2,191,450.140	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,341,000.000	2,889,051.510	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180801	2,928,000.000	3,298,889.760	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190301	2,708,000.000	3,097,410.400	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	3,598,000.000	4,119,602.060	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,403,000.000	3,053,972.700	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,022,000.000	2,635,535.460	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,959,744.000	

4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,000,000.000	2,300,380.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,361,000.000	2,893,665.210	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,448,297.920	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,687,000.000	3,245,896.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20160415	2,034,000.000	2,119,448.340	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20160915	986,000.000	1,056,163.760	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	1,089,000.000	1,344,043.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170501	2,315,000.000	2,534,022.150	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,088,000.000	1,388,668.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170601	2,626,000.000	2,879,225.180	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	659,000.000	842,445.830	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20171101	1,295,000.000	1,394,468.950	
2.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20151201	549,000.000	560,633.310	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	791,000.000	990,197.530	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,594,000.000	1,931,258.520	
2.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20160515	1,027,000.000	1,051,165.310	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180601	2,341,000.000	2,546,095.010	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,585,000.000	2,019,828.900	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,678,347.440	
2.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20161115	421,000.000	437,663.180	

3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20181201	2,111,000.000	2,315,809.220	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	553,000.000	630,325.990	
1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20161215	318,000.000	323,348.760	
2.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190501	1,100,000.000	1,168,090.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	1,376,000.000	1,592,238.400	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	653,000.000	720,076.160	
1.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170515	547,000.000	552,300.430	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,027,000.000	1,069,805.360	
1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	446,000.000	454,242.080	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,706,000.000	2,603,287.760	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	934,699.500	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,791,000.000	2,843,803.530	
3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,276,239.600	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	1,377,000.000	1,721,952.270	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,140,513.000	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,702,819.580	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,798,088.760	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,218,000.000	1,459,297.980	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160328	735,000.000	760,945.500	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	1,174,000.000	1,781,392.380	



4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20210928	1,656,000.000	2,080,449.360	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170628	1,202,000.000	1,308,160.640	
4.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20260328	801,000.000	1,093,148.730	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220928	1,070,000.000	1,368,669.100	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320328	864,000.000	1,196,510.400	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190928	1,123,000.000	1,273,616.760	
2.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20230622	1,338,000.000	1,509,317.520	
1.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180622	1,052,000.000	1,096,436.480	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20450622	571,000.000	815,764.860	
2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20240622	1,692,000.000	1,958,506.920	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20340622	394,000.000	486,148.720	
4.6% IRISH TREASURY 20160418	1,018,000.000	1,079,955.480	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	759,000.000	878,770.200	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	684,000.000	805,642.560	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	570,000.000	718,257.000	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,262,000.000	1,732,322.160	
5% IRISH TREASURY 20201018	859,000.000	1,074,651.950	
5.5% IRISH TREASURY 20171018	579,000.000	664,738.320	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	613,705.680	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	622,000.000	735,259.980	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	313,000.000	334,859.920	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,239,000.000	1,492,524.180	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	1,095,000.000	1,787,061.900	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,580,000.000	1,806,603.600	
3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	1,248,000.000	1,503,216.000	

3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	1,212,000.000	1,467,974.400	
4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	994,000.000	1,065,329.440	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	933,000.000	1,427,732.580	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	711,000.000	795,217.950	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	1,302,000.000	1,539,172.320	
4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	929,000.000	1,328,144.850	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	1,137,000.000	1,218,716.190	
3.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20220420	554,000.000	682,766.220	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20221122	872,000.000	1,068,200.000	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20620126	546,000.000	954,615.480	
1.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190618	738,000.000	798,988.320	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20440620	290,000.000	403,587.200	
1.75% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20231020	675,000.000	741,312.000	
2.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340523	220,000.000	261,212.600	
1.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20181019	307,000.000	320,167.230	
1.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20241021	383,000.000	415,857.570	
3.875% Finland Government Bond 20170915	474,000.000	524,599.500	
4.375% Finland Government Bond 20190704	550,000.000	655,688.000	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	878,939.250	
3.375% Finland Government Bond 20200415	738,000.000	866,279.160	

1.75% Finland Government Bond 20160415	625,000.000	639,775.000	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	553,099.590	
1.875% Finland Government Bond 20170415	799,000.000	835,274.600	
2.75% Finland Government Bond 20280704	270,000.000	329,062.500	
1.625% Finland Government Bond 20220915	725,000.000	792,845.500	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	484,663.740	
2.625% Finland Government Bond 20420704	293,000.000	377,299.030	
1.125% Finland Government Bond 20180915	425,000.000	443,772.250	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	597,955.150	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,108,000.000	3,016,969.600	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20171031	382,000.000	379,662.160	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,398,000.000	2,026,540.800	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,860,601.140	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,963,000.000	2,404,478.700	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,181,000.000	1,217,079.550	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	2,135,000.000	2,279,069.800	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	1,538,652.320	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	2,206,000.000	2,464,035.820	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,777,000.000	2,248,793.500	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,774,005.740	

4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	2,055,095.000	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	893,000.000	1,169,044.160	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,420,583.110	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,135,000.000	1,432,914.800	
4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	2,032,547.530	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160430	1,609,000.000	1,669,659.300	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	3,170,082.050	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,265,000.000	1,758,476.500	
4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20161031	1,932,000.000	2,065,037.520	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,580,281.220	
4.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180131	2,000,000.000	2,229,920.000	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,758,000.000	2,276,047.440	
3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160730	1,689,000.000	1,765,173.900	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,089,000.000	1,337,923.620	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	806,000.000	1,067,023.100	
3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20181031	1,564,000.000	1,737,040.960	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	795,000.000	1,108,786.500	
2.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170430	1,488,000.000	1,538,993.760	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190430	1,836,000.000	1,979,079.480	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	2,219,000.000	2,619,773.590	

	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	1,411,000.000	1,533,855.770	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	448,000.000	456,310.400	
ユーロ 小計			ユーロ 490,773,623.070 (71,888,520,307)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20170915	7,233,000.000	7,456,499.700	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20181221	6,869,000.000	7,028,979.010	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	9,010,000.000	8,890,797.700	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	13,703,000.000	16,169,951.090	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	5,819,374.000	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	9,910,000.000	9,459,590.500	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	9,393,000.000	7,142,437.200	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,751,198.660	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	2,839,000.000	2,809,417.620	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	4,547,000.000	4,487,889.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	2,777,000.000	2,707,241.760	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	1,365,000.000	1,303,534.050	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	2,348,000.000	2,300,453.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	1,115,000.000	1,054,756.550	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 84,382,119.840 (860,697,623)	
国債証券 合計			167,711,973,324	

		[167,711,973,324]	
合計		167,711,973,324	[167,711,973,324]

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 231銘柄	100%	39.7%
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	100%	8.5%
オーストラリア・ドル	国債証券 18銘柄	100%	1.7%
カナダ・ドル	国債証券 35銘柄	100%	2.3%
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%	0.3%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.5%
デンマーク・クローネ	国債証券 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%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券 28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 271銘柄	100%	42.8%
南アフリカ・ランド	国債証券 14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26年12月30日

資産総額	122,356,674円
負債総額	40,841円
純資産総額（ - ）	122,315,833円
発行済数量	97,906,301口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2493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26年12月30日

資産総額	134,422,933,430円
負債総額	7,202,117,780円
純資産総額（ - ）	127,220,815,650円
発行済数量	154,630,316,965口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8227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26年12月30日

資産総額	83,021,217,824円
負債総額	92,959,616円
純資産総額（ - ）	82,928,258,208円
発行済数量	40,841,740,455口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0305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26年12月30日

資産総額	178,398,627,909円
負債総額	508,360,200円

純資産総額( - )	177,890,267,709円
発行済数量	73,350,785,100口
1単位当たり純資産額( / )	2.4252円

## (参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成26年12月30日

資産総額	2,257,343,083円
負債総額	30,299,016円
純資産総額( - )	2,227,044,067円
発行済数量	1,030,089,923口
1単位当たり純資産額( / )	2.1620円

## (参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

## 純資産額計算書

平成26年12月30日

資産総額	14,868,460,088円
負債総額	89,177,760円
純資産総額( - )	14,779,282,328円
発行済数量	12,137,590,846口
1単位当たり純資産額( / )	1.2176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26年12月30日

資産総額	171,940,384,606円
負債総額	130,867,122円
純資産総額( - )	171,809,517,484円
発行済数量	58,275,809,928口
1単位当たり純資産額( / )	2.9482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け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

## 第三部 【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26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年間に於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、リスクマネジメント会議および執行役員会議

###### ・ファンド評価会議

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。

- ・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

- ・リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

- ・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、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26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	21	184,914
追加型株式投資信託	538	11,205,522
株式投資信託 合計	559	11,390,437
単位型公社債投資信託	1	9,185
追加型公社債投資信託	17	3,265,047
公社債投資信託 合計	18	3,274,233
総合計	577	14,664,670

## 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55期事業年度（平成25年4月1日から平成26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56期事業年度に係る中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	14,380,327	15,186,222
有価証券	9,427,636	15,003,765
前払金	207	453
前払費用	142,919	157,453
未収入金	521,825	-
未収委託者報酬	7,183,011	8,265,950
未収収益	106,914	103,432
貯蔵品	9,551	14,492
繰延税金資産	491,727	674,141
その他	8,445	597
流動資産計	32,272,567	39,406,511
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	254,258	252,417
器具備品（純額）	26,257	23,555
リース資産（純額）	222,274	224,362
	5,726	4,499
無形固定資産	3,194,512	2,991,462
ソフトウェア	3,132,238	2,910,918

ソフトウェア仮勘定		50,423		68,693
電話加入権		11,850		11,850
投資その他の資産		15,113,434		15,077,046
投資有価証券		8,342,934		8,338,733
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		136,315		129,405
従業員に対する長期貸付金		92,527		68,396
差入保証金		1,000,820		997,594
長期前払費用		7,376		6,484
投資不動産(純額)	1	402,340	1	398,402
貸倒引当金		9,950		3,040
固定資産計		18,562,205		18,320,926
資産合計		50,834,773		57,727,438

(単位:千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26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	1,227
預り金	56,491	53,677
未払金	6,795,899	8,998,456
未払収益分配金	10,333	7,931
未払償還金	113,002	77,698
未払手数料	3,764,501	4,277,412
その他未払金	2	2,908,061
未払費用	3,383,551	3,463,796
未払法人税等	588,040	1,530,565
未払消費税等	189,139	530,831
賞与引当金	841,300	955,600
流動負債計	11,855,648	15,534,154
<b>固定負債</b>		
リース債務	4,494	3,272
退職給付引当金	1,935,442	1,959,451
役員退職慰労引当金	67,410	80,280
繰延税金負債	1,740,407	1,789,543
固定負債計	3,747,753	3,832,547
負債合計	15,603,402	19,366,702
<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	7,722,723	10,821,849
利益剰余金合計	8,097,020	11,196,146
株主資本合計	34,767,020	37,866,146
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	464,350	494,589
評価・換算差額等合計	464,350	494,589
純資産合計	35,231,371	38,360,735
負債・純資産合計	50,834,773	57,727,438

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	73,498,726	84,771,977
その他営業収益	526,465	788,473
営業収益計	74,025,191	85,560,451
営業費用		
支払手数料	41,213,272	47,520,063
広告宣伝費	604,864	668,841
公告費	949	533
受益証券発行費	-	25
調査費	8,116,701	8,246,807
調査費	824,915	741,792
委託調査費	7,291,786	7,505,015
委託計算費	807,090	735,588
営業雑経費	1,280,599	1,322,711
通信費	206,564	249,081
印刷費	404,023	477,092
協会費	53,643	54,190
諸会費	11,281	11,711
その他営業雑経費	605,086	530,634
営業費用計	52,023,478	58,494,570
一般管理費		

給料	5,264,128	5,708,541
役員報酬	249,180	243,000
給料・手当	3,782,533	3,785,717
賞与	391,114	724,223
賞与引当金繰入額	841,300	955,600
福利厚生費	809,254	793,740
交際費	55,806	37,951
寄付金	636	-
旅費交通費	196,147	191,623
租税公課	206,178	222,767
不動産賃借料	887,968	1,182,703
退職給付費用	469,713	373,920
役員退職慰労引当金繰入額	38,970	33,750
固定資産減価償却費	1,181,438	963,183
諸経費	1,094,627	1,354,169
一般管理費計	10,204,869	10,862,351
営業利益	11,796,843	16,203,530

(単位:千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成24年4月1日	(自	平成25年4月1日
	至	平成25年3月31日)	至	平成26年3月31日)
営業外収益				
受取配当金	1	257,704	1	144,660
有価証券利息		11,102		13,966
受取利息		10,598		9,117
時効成立分配金・償還金		21,305		44,877
投資有価証券売却益		279,443		64,122
有価証券償還益		101,052		63,228
その他		44,912		34,445
営業外収益計		726,118		374,418
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		19,392		16,985
投資有価証券売却損		36,469		3,171
有価証券償還損		33,338		18,848
投資不動産管理費用		16,271		16,864
貯蔵品廃棄損		9,990		9,503
その他		13,120		9,343
営業外費用計		128,584		74,716
経常利益		12,394,377		16,503,232
特別利益				



投資有価証券売却益		39,827		-
固定資産売却益		31		-
その他		16,466		-
特別利益計		56,325		-
特別損失				
固定資産除却損	2	129,816	2	888
本社移転関連費用		1,099,913		-
その他		14,428		-
特別損失計		1,244,158		888
税引前当期純利益		11,206,544		16,502,343
法人税、住民税及び事業税		4,286,691		6,525,874
法人税等調整額		109,902		150,022
法人税等合計		4,176,789		6,375,851
当期純利益		7,029,755		10,126,492

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,715,116	8,089,414	34,759,414
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,022,149	△7,022,149	△7,022,149
当期純利益	-	-	-	7,029,755	7,029,755	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	7,606	7,606	7,606
当期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,722,723	8,097,020	34,767,020

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33,879	53,783	87,663	34,847,077
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△7,022,149
当期純利益	-	-	-	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	430,470	△53,783	376,686	376,686
当期変動額合計	430,470	△53,783	376,686	384,293
当期末残高	464,350	-	464,350	35,231,371

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,722,723	8,097,020	34,767,020
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027,366	△7,027,366	△7,027,366
当期純利益	-	-	-	10,126,492	10,126,492	10,126,492
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099,125	3,099,125	3,099,125
当期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	10,821,849	11,196,146	37,866,146

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	464,350	-	464,350	35,231,371
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△7,027,366
当期純利益	-	-	-	10,126,492
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	30,238	-	30,238	30,238
当期変動額合計	30,238	-	30,238	3,129,364
当期末残高	494,588	-	494,588	38,360,735

## 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. 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)

定額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 8～47年

器具備品 4～20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、当事業年度より有形固定資産（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。

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。

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年間）に基づく定額法によっております。

（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。

３．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。

４．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「貯蔵品廃棄損」は重要性が増したため当事業年度より区分掲記することとしました。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23,111千円は、「貯蔵品廃棄損」9,990千円、「その他」13,120千円として組替えております。

## （貸借対照表関係）

## 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
建物	15,528千円	18,230千円
器具備品	250,072千円	249,761千円
リース資産	409千円	1,636千円
投資建物	724,130千円	729,348千円
投資器具備品	23,691千円	24,180千円

## 2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
未払金	2,883,398千円	4,508,988千円

## 3 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（平成26年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719,900千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次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)
受取配当金	185,280千円	-

## 2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)
建物	546千円	-
器具備品	128,892千円	888千円
無形固定資産(その他)	377千円	-
計	129,816千円	888千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

平成26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	10,126百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,882円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月26日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券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、「証券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、証券投資信託、株式であります。証券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。

未払手数料は証券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。

## (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、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、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。

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。

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25年3月31日現在)

(単位:千円)

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

(\*) 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。

当事業年度(平成26年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	15,186,222	15,186,222	-
(2) 未収委託者報酬	8,265,950	8,265,950	-
(3) 未収入金	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	22,283,329	22,283,329	-
資産計	45,735,503	45,735,503	-
(1) 未払手数料	4,277,412	4,277,412	-
(2) その他未払金	4,635,414	4,635,414	-
(3) 未払費用(*)	2,678,610	2,678,610	-
負債計	11,591,437	11,591,437	-

(\*) 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、(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。

## &lt;注2&gt;時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
(1) 其他有価証券 非上場株式	1,059,169	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	1,000,820	997,594

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。

## &lt;注3&gt;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25年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,380,327	-	-	-
未収委託者報酬	7,183,011	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 其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	-

当事業年度（平成26年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	15,186,222	-	-	-
未収委託者報酬	8,265,950	-	-	-
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	-	1,498,464	3,978,251	97,038
合計	23,452,173	1,498,464	3,978,251	97,038

## (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。

当事業年度(平成26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25年3月31日現在)

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

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

当事業年度(平成26年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	113,247	55,101	58,145
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	5,625,179	4,873,552	751,626
小計	5,738,426	4,928,653	809,772

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	16,544,903	16,586,202	41,299
小計	16,544,903	16,586,202	41,299
合計	22,283,329	21,514,856	768,472

(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24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他			
証券投資信託の受益証券	24,501,921	64,122	3,171
合計	24,501,921	64,122	3,171

### 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（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。

当事業年度において、該当事項はありません。

#### (退職給付関係)

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

#### 2. 退職給付債務に関する事項

退職給付債務	1,935,442千円
退職給付引当金	1,935,442千円

#### 3. 退職給付費用に関する事項

勤務費用	301,777千円
その他	167,935千円
退職給付費用	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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

### 2. 確定給付制度

#### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

期首における退職給付債務	1,935,442千円
勤務費用	201,327千円
退職給付の支払額	177,317千円
期末における退職給付債務	1,959,451千円

#### (2)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

積立型制度の退職給付債務	-
年金資産	-
非積立型制度の退職給付債務	1,959,451千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,959,451千円
退職給付引当金	1,959,451千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,959,451千円

#### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	201,327千円
確定給付制度に係る退職給付費用	201,327千円

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172,593千円でありました。

#### (表示方法の変更)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を当事業年度より適用し（ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。）、（退職給付関係）注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、（退職給付関係）の注記の組替えは行っておりません。

#### (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的主要原因別内訳

（単位：千円）

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	837,121	833,243
退職給付引当金	693,199	698,348
未払事業税	154,219	335,386
賞与引当金	280,855	287,721
連結法人間取引(譲渡損)	264,269	141,925
投資有価証券評価損	128,953	128,953
繰延資産	157,330	121,437
出資金評価損	114,425	116,888
未払社会保険料	43,411	38,787
器具備品	33,316	33,316
役員退職慰労引当金	24,920	28,611
その他	29,627	24,709
繰延税金資産小計	2,761,651	2,789,330
評価性引当額	1,323,069	1,200,725
繰延税金資産合計	1,438,582	1,588,604
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428,233	2,428,233
その他有価証券評価差額金	257,138	273,883
その他	1,888	1,888
繰延税金負債合計	2,687,261	2,704,006
繰延税金負債の純額	1,248,679	1,115,401

## 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。

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について前事業年度の38.01%から35.64%に変更されております。

この変更による影響は軽微であります。

## (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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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)	1,719,900	-	-

## 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24年4月1日 至 平成25年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(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	971,157
									未収入金	511,559

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

## 当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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	25,994,992	未払手数料	3,216,077
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	678,054	未払費用	393,881

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	978,984	長期差入保証金	971,157
-------------	------------	--------	-----	--------	---	---------	---------	---------	---------	---------

(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、名古屋証券取引所に上場)

(1 株当たり情報)

前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
1株当たり純資産額	13,506.24円	1株当たり純資産額	14,705.91円
1株当たり当期純利益	2,694.91円	1株当たり当期純利益	3,882.07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 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(千円)	7,029,755	10,126,492
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。

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  
(平成26年9月30日)

資産の部



流動資産		
現金・預金		20,257,586
有価証券		5,207,068
未収委託者報酬		9,365,956
貯蔵品		15,509
繰延税金資産		495,241
その他		296,277
流動資産計		35,637,638
固定資産		
有形固定資産	1	283,555
無形固定資産		
ソフトウェア		2,634,889
その他		90,103
無形固定資産合計		2,724,992
投資その他の資産		
投資有価証券		6,866,175
関係会社株式		5,129,895
その他	1	1,589,226
投資その他の資産合計		13,585,297
固定資産計		16,593,845
資産合計		52,231,483

(単位:千円)

当中間会計期間  
(平成26年9月30日)

## 負債の部

流動負債		
リース債務		1,227
未払金		6,923,613
未払費用		3,196,727
未払法人税等		1,144,931
賞与引当金		796,000
その他	3	848,229
流動負債計		12,910,729
固定負債		
リース債務		2,658

退職給付引当金	1,996,246
役員退職慰労引当金	92,730
繰延税金負債	1,845,611
固定負債計	3,937,247
負債合計	16,847,976
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	7,668,191
利益剰余金合計	8,042,489
株主資本合計	34,712,489
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	671,018
評価・換算差額等合計	671,018
純資産合計	35,383,507
負債・純資産合計	52,231,483

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間	
	(自 平成26年4月1日	
	至 平成26年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		44,022,288
その他営業収益		472,415
営業収益計		44,494,704
営業費用		
支払手数料		24,490,036
その他営業費用		5,489,326
営業費用計		29,979,363
一般管理費	1	5,507,021
営業利益		9,008,319
営業外収益	2	1,299,244

営業外費用	1, 3	34,669
経常利益		10,272,894
特別利益		-
特別損失	4	12,947
税引前中間純利益		10,259,946
法人税、住民税及び事業税		3,150,039
法人税等調整額		137,269
中間純利益		6,972,636

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	10,821,849	11,196,146	37,866,146
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,126,294	△ 10,126,294	△ 10,126,294
中間純利益	-	-	-	6,972,636	6,972,636	6,972,636
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 3,153,657	△ 3,153,657	△ 3,153,657
当中間期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,668,191	8,042,489	34,712,489

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	494,589	494,589	38,360,735
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,126,294
中間純利益	-	-	6,972,636
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	176,428	176,428	176,428
当中間期変動額合計	176,428	176,428	△ 2,977,228
当中間期末残高	671,018	671,018	35,383,507

## 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

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。

## 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．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）

定額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	5～47年
器具備品	3～20年

## (2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

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

## (3) 長期前払費用

定額法によっております。

## (4) 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。

## 3．引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

役員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。

## (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。

## (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中間会計期間未要支給額を計上しております。

#### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### (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方式によっております。

##### (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。

#### (中間貸借対照表関係)

##### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成26年9月30日現在)
有形固定資産	279,523千円
投資その他の資産	756,255千円

##### 2 保証債務

当中間会計期間(平成26年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,805,580千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)

##### 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
有形固定資産	16,065千円
無形固定資産	490,092千円
投資その他の資産	2,726千円

##### 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
受取配当金	1,177,840千円
投資有価証券売却益	73,930千円
時効成立分配金・償還金	14,749千円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間	
	（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）	
時効成立後支払分配金・償還金	12,351千円	
貯蔵品廃棄損	7,356千円	
投資不動産管理費用	6,818千円	

## 4 特別損失の主要項目

	当中間会計期間	
	（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）	
関係会社株式評価損	11,174千円	

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26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 株式数（千株）	当中間会計期間 増加株式数（千株）	当中間会計期間 減少株式数（千株）	当中間会計期間末 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 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3 月31日	平成26年 6月26日

(金融商品関係)

当中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

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)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	20,257,586	20,257,586	-
(2) 未収委託者報酬	9,365,956	9,365,956	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	11,047,833	11,047,833	-
資産計	40,671,376	40,671,376	-
(1) 未払金	6,923,613	6,923,613	-
(2) 未払費用(*)	2,760,751	2,760,751	-
負債計	9,684,365	9,684,365	-

(\*) 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

##### 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	1,025,409
子会社株式	5,129,895
差入保証金	997,068

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26年4月1日 至 平成26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 5,129,895千円）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。

当中間会計期間において、子会社株式について11,174千円減損処理を行っております。

## 2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	105,492	55,101	50,390
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	5,646,254	4,624,425	1,021,828
小計	5,751,746	4,679,527	1,072,219
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	5,296,087	5,325,705	29,618
小計	5,296,087	5,325,705	29,618
合計	11,047,833	10,005,232	1,042,601

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額 1,025,409千円）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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26年9月30日）

## 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. 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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26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 ( 自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日 )	
1株当たり純資産額	13,564.56円
1株当たり中間純利益金額	2,673.01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いません。

(注) 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。

当中間会計期間 ( 自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日 )	
中間純利益(千円)	6,972,636
普通株式に係る中間純利益(千円)	6,972,636
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すことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に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26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26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】

該当事項はありません。

#### <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26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 5月26日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成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26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) 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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成27年1月30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25年12月19日から平成26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26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 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

平成26年11月25日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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に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26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26年4月1日から平成26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) 1. 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。

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。