

【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24年3月12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 石橋 俊朗

【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号

【事務連絡者氏名】 長谷川 英男  
連絡場所 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号

【電話番号】 03-5695-2111

【届出の対象とした募集内  
国投資信託受益証券に係る  
ファンドの名称】 DCダイワ・ターゲットイヤー2030

【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24年3月13日から平成25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2030

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

#### ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

#### ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

申込手数料には、消費税および地方消費税（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24年3月13日から平成25年3月11日まで（継続申込期間）  
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

## (11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

## (12) 【その他】

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

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

委託会社の各営業日の午後3時までに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。  
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

##### (注1) 商品分類の定義

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

##### (注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」...組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分変更型」...目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
- ・「年1回」...目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」...目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」...目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
- ・「為替ヘッジなし」...目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

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

#### < 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1兆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、2030年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

◆2030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。

#### < 2011年12月時点の基本配分比率 >

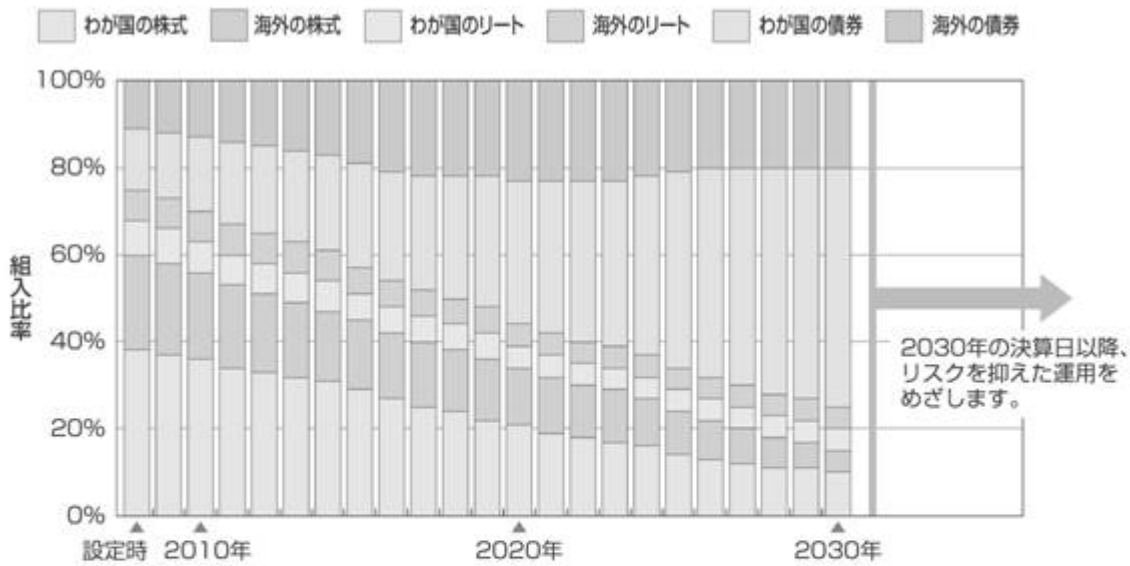
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	34%	19%	7%	7%	19%	14%

#### < 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2030	38%	22%	8%	7%	14%	11%

※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) 2011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。2010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指数の指数値及び東証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及び東証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指数の指数値及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又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、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、保証又は販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、本商品の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## 5

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

## 運用プロセス



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

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

## S&amp;P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

## 【特徴】

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

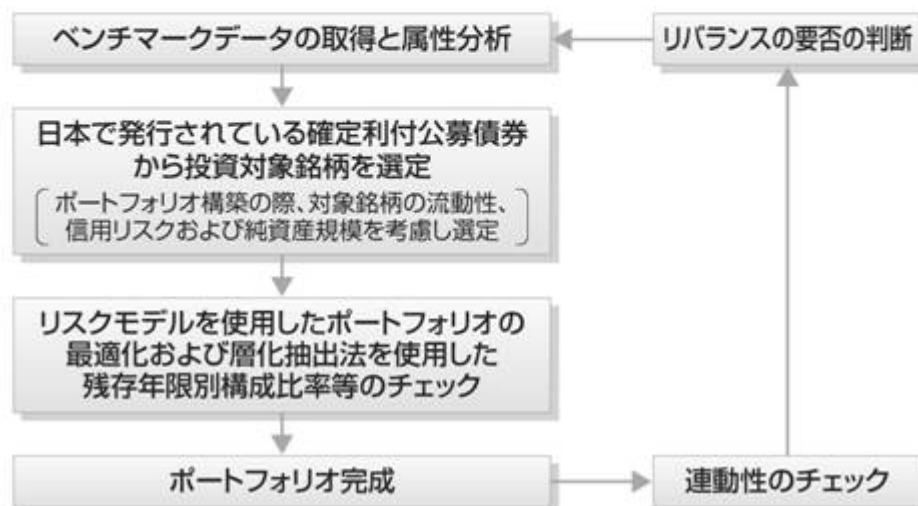
本商品は、スタンダード&プアーズ及びその関連会社（以下、S&P）によって支持、保証、販売又は販売促進されるものではありません。S&Pは、明示的にも暗示的にも、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または本商品に関する投資について、またS&P先進国REIT指数（除く日本）が市場全般的パフォーマンスに追随する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&Pの大和証券投資信託委託株式会社に対する唯一の関係は、S&P及びS&P先進国REIT指数（除く日本）の登録商標についての利用許諾を与えることです。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）に関する決定、作成及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

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

## 6

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

## 運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

・運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の信託財産の純資産総額を超えることがあります。

## NOMURA－BPI総合指数とは

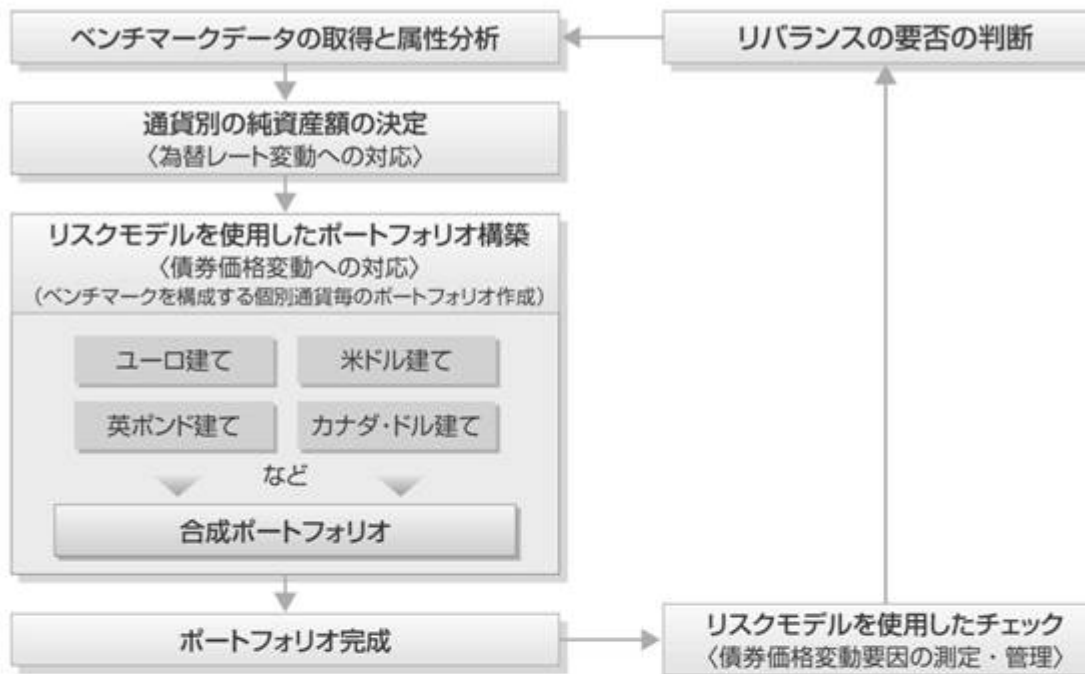
NOMURA－BPIは、野村証券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

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

## 7

海外の債券への投資にあたっては、投資成果をシティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

## 運用プロセス



ベンチマークであるシティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の主な騰落要因は、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。

## シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

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

## 8

2030年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

#### NOMURA－BPI総合短期指数とは

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

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

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

## ファンドの仕組み

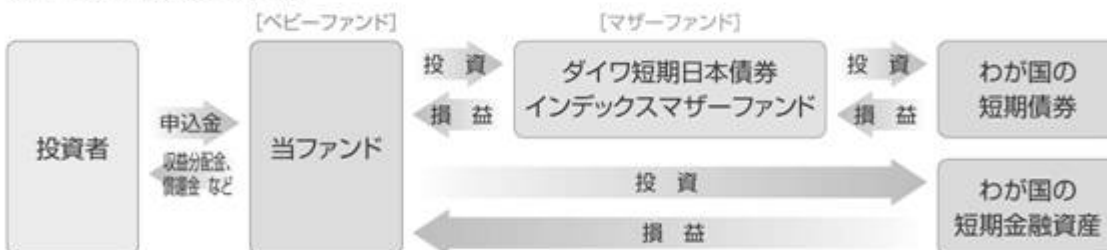
●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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

〈2030年の決算日前日まで〉



〈2030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	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。  受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
運用指図	2	損益 信託金（ 3 ）
受託会社	住友信託銀行株式会社（ 4 ） 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いません。）

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。
- 4：関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

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23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す。

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、2030年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

#### 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38%

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22%

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 8%

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 7%

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14%

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11%

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．2030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、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。）

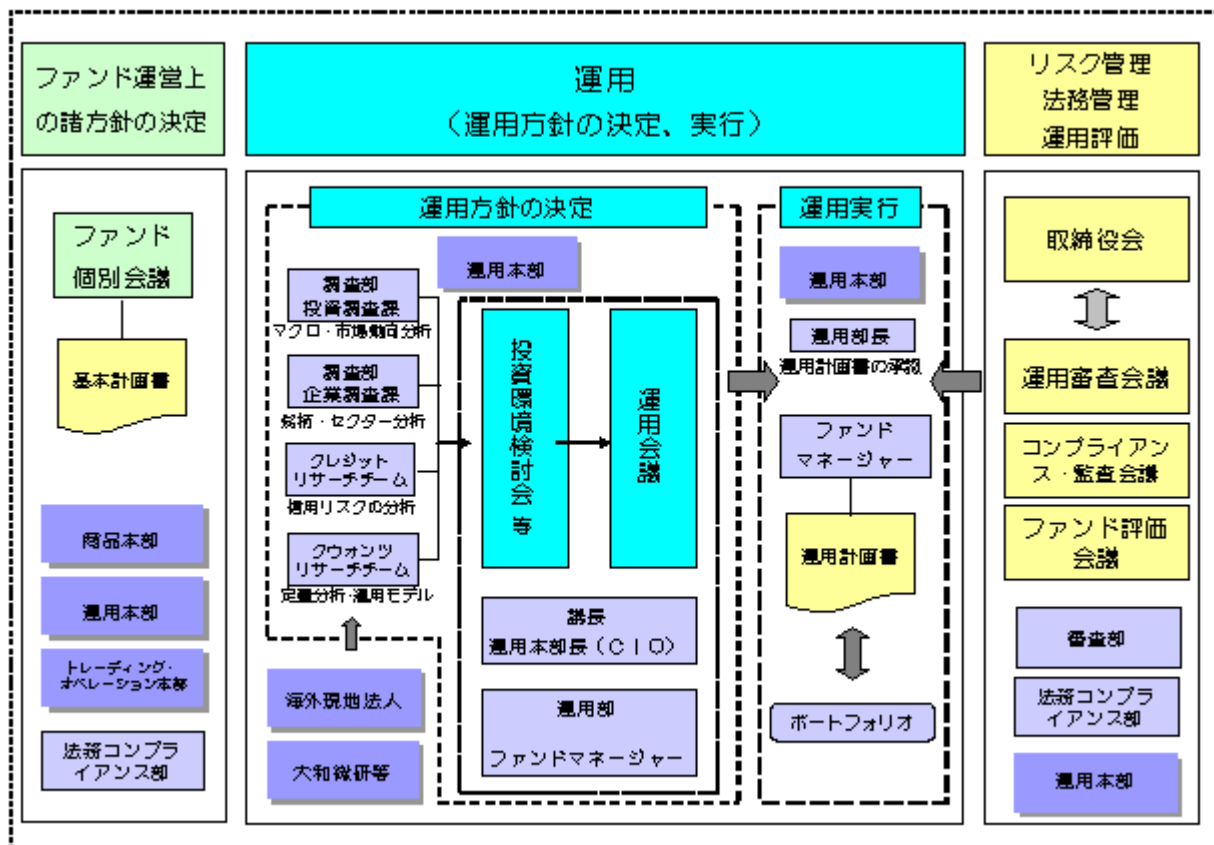
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

#### ハ．基本的な運用方針の決定

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

#### ニ．運用計画書の作成・承認

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

#### 職務権限

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

#### イ．運用本部長（ＣＩＯ）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

#### ロ．運用副本部長（1～5名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

#### ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

#### ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は20～30名程度です。

## 受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成23年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

### (4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

### (5) 【投資制限】

#### 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

#### 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

#### 外国為替予約取引（信託約款）

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

#### 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> 各マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

(注) 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

## 2. 外国株式インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第21項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー

11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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



### 3. ダイワJ - R E I Tマザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

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

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

##### 投資態度

- イ．東京証券取引所が算出・公表する「東証R E I T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R E I T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R E I T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R E I T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指数の指数値及び東証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及び東証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若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

（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指数の指数値及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又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、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、保証又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・ファンドの購入者又は公衆に対し、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、当社又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・ファンドの発行又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（登録予定を含みません。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、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注) S & P 先進国 REIT 指数（除く日本）（円ベース）とは

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

[ 特徴 ]

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

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

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

## 5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

### (1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA - BPI総合指数）の動きに連

動する投資成果をめざします。

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

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

## (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

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。）

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

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

スワップ取引

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

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

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産

総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

#### 金利先渡取引

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

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

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

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

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

(注) NOMURA - B P I 総合指数とは

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

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

## 6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資し、ベンチマーク(NOMURA - B P I 総合短期指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

### (2) 投資対象

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

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。

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。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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（組入有価証券を差し引いた額）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、投資成果をシティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（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券
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

### (3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

## 3 【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

## 〈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。

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せよう、よろしく願い申し上げます。

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〉



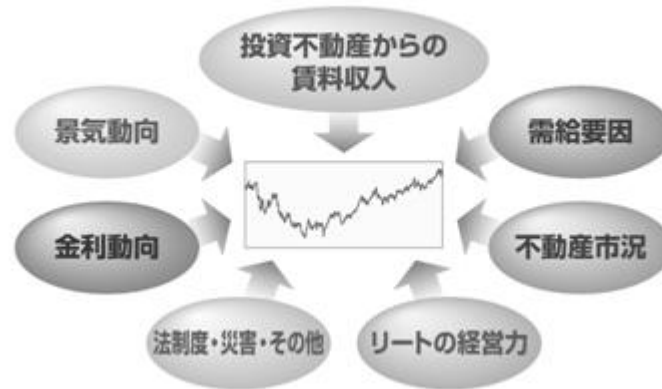
※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

ニ．組入リー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〉



※上記はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。そのため、外貨建資産を実質的に組入れた部分は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

#### ロ．カンントリー・リスク

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

#### その他

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

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

### (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

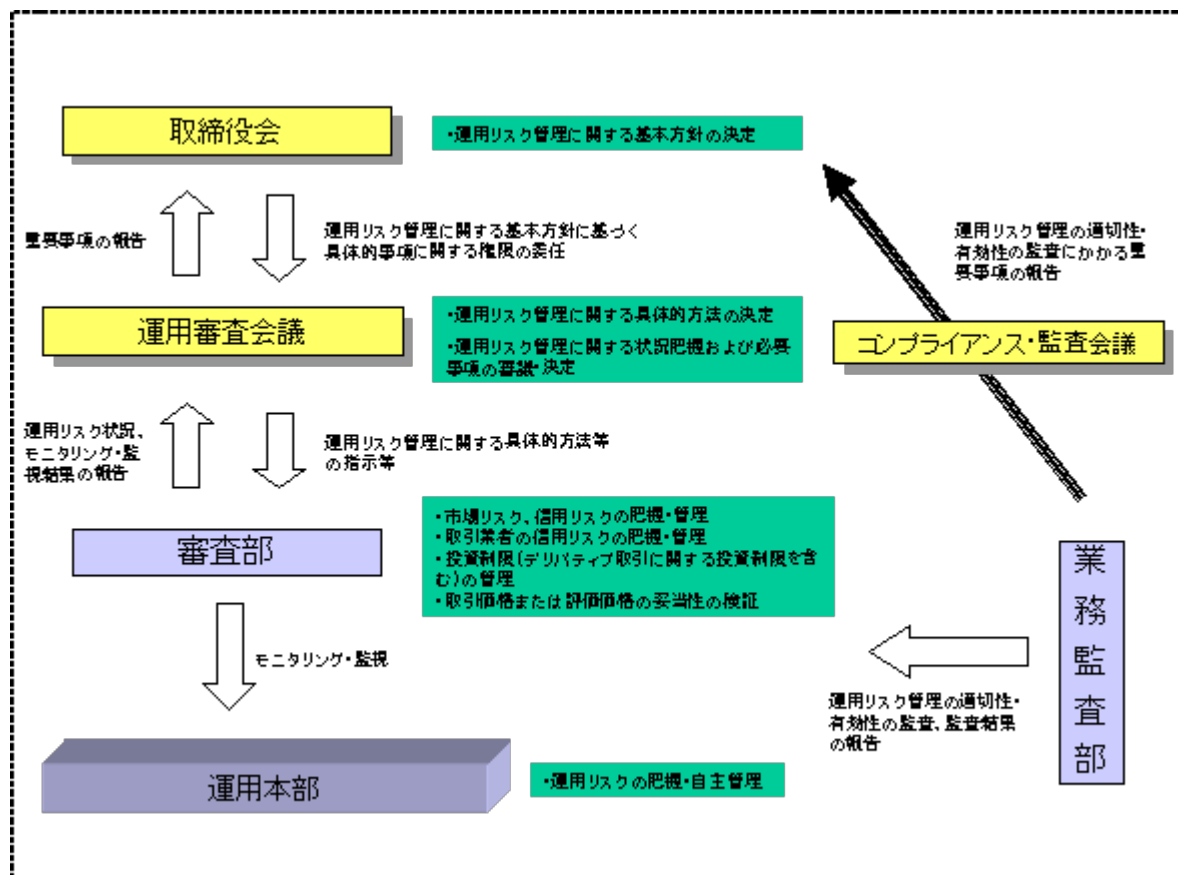
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

### (3) その他の留意点

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

用はありません。

#### (4) リスク管理体制



#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問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23計算期間まで	年率0.6825%（税抜0.65%）
第24計算期間以降	年率0.2625%（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23計算期間まで >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.315% （税抜0.3%）	年率0.315% （税抜0.3%）	年率0.0525% （税抜0.05%）

< 第24計算期間以降 >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.1155% （税抜0.11%）	年率0.1155% （税抜0.11%）	年率0.0315% （税抜0.03%）

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

### (4) 【その他の手数料等】

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（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25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成25年1月1日から平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

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

#### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

期間ごとの税率は、上記イ．の表と同じです。

#### ハ．損益通算について

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

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

#### < 注1 > 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相

当する金額は含まれません。)が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

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

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

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

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

- ( ) 上記は、平成23年12月末現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成23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	23,084,711	99.84
内 日本	23,084,711	99.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	36,200	0.16
純資産総額	23,120,911	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23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	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	19,701,576	0.3930 7,744,435	0.4003 7,886,540	34.11
2	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	5,339,562	0.7945 4,242,357	0.8192 4,374,169	18.92
3	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	3,876,747	1.1261 4,365,975	1.1265 4,367,155	18.89
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	1,865,916	1.7221 3,213,414	1.7184 3,206,390	13.87
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	1,798,401	0.8776 1,578,456	0.9052 1,627,912	7.04
6	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	1,707,583	0.9496 1,621,533	0.9502 1,622,545	7.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.84%
合計	99.84%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【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)	2,735,746	2,735,746	0.6530	0.6530
第2計算期間末 (平成21年12月18日)	7,830,771	7,830,771	0.7362	0.7362
第3計算期間末 (平成22年12月20日)	19,887,419	19,887,419	0.7670	0.7670
平成22年12月末日	19,959,466	-	0.7671	-
平成23年1月末日	20,667,657	-	0.7757	-
2月末日	21,340,513	-	0.7938	-
3月末日	22,145,249	-	0.7787	-
4月末日	22,104,517	-	0.7823	-
5月末日	21,516,317	-	0.7705	-
6月末日	20,959,804	-	0.7677	-
7月末日	20,741,775	-	0.7529	-
8月末日	21,553,155	-	0.7157	-
9月末日	21,381,107	-	0.6969	-
10月末日	22,345,706	-	0.7219	-
11月末日	22,299,023	-	0.6889	-
第4計算期間末 (平成23年12月19日)	22,353,895	22,353,895	0.6876	0.6876
12月末日	23,120,911	-	0.6972	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	34.7
第2計算期間	12.7
第3計算期間	4.2
第4計算期間	10.4

## (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	8,866,423	5,677,066
第2計算期間	8,210,996	1,763,695
第3計算期間	15,967,619	676,450
第4計算期間	11,508,725	4,926,400

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況（平成23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	80,421,475,960	97.15
内 日本	80,421,475,960	97.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,361,795,934	2.85
純資産総額	82,783,271,894	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	2,446,080,000	2.95
内 日本	2,446,080,000	2.95

(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23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	1,039,400	2,683.71 2,789,456,540	2,565.00 2,666,061,000	3.22
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	6,036,200	335.26 2,023,744,060	327.00 1,973,837,400	2.38
3	キヤノン	日本	株式	電気機器	501,700	3,383.08 1,697,295,177	3,410.00 1,710,797,000	2.07
4	本田技研	日本	株式	輸送用機器	682,500	2,372.63 1,619,322,245	2,348.00 1,602,510,000	1.94

5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	367,000	3,763.51 1,381,210,000	3,935.00 1,444,145,000	1.74
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	603,300	2,123.02 1,280,821,291	2,144.00 1,293,475,200	1.56
7	武田薬品	日本	株式	医薬品	316,900	3,661.21 1,160,239,501	3,380.00 1,071,122,000	1.29
8	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	10,220,800	112.83 1,153,303,062	104.00 1,062,963,200	1.28
9	ファナック	日本	株式	電気機器	84,200	11,147.00 938,577,975	11,780.00 991,876,000	1.20
10	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	6,572	146,324.88 961,647,167	141,500.00 929,938,000	1.12
11	三菱商事	日本	株式	卸売業	580,900	1,740.48 1,011,048,602	1,555.00 903,299,500	1.09
12	三井物産	日本	株式	卸売業	687,600	1,275.85 877,277,002	1,197.00 823,057,200	0.99
13	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	362,700	2,705.09 981,138,647	2,267.00 822,240,900	0.99
14	日立	日本	株式	電気機器	1,814,000	390.57 708,503,400	404.00 732,856,000	0.89
15	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	2,000	369,674.01 739,348,021	362,000.00 724,000,000	0.87
16	小松製作所	日本	株式	機械	401,900	1,733.42 696,661,950	1,799.00 723,018,100	0.87
17	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	332,900	2,150.37 715,859,712	2,145.00 714,070,500	0.86
18	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	1,018,700	665.68 678,138,112	692.00 704,940,400	0.85
19	ソニー	日本	株式	電気機器	506,300	1,530.96 775,128,200	1,382.00 699,706,600	0.85
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	140,500	4,556.48 640,186,300	4,900.00 688,450,000	0.83
21	三菱地所	日本	株式	不動産業	559,000	1,237.10 691,541,600	1,150.00 642,850,000	0.78
22	K D D I	日本	株式	情報・通信業	1,244	623,918.01 776,154,011	495,000.00 615,780,000	0.74
23	パナソニック	日本	株式	電気機器	926,700	752.65 697,488,996	654.00 606,061,800	0.73
24	三菱電機	日本	株式	電気機器	808,000	685.59 553,959,610	738.00 596,304,000	0.72
25	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	187,400	2,893.01 542,151,644	3,130.00 586,562,000	0.71
26	信越化学	日本	株式	化学	151,500	3,907.91 592,049,500	3,790.00 574,185,000	0.69
27	東芝	日本	株式	電気機器	1,706,000	323.77 552,360,000	315.00 537,390,000	0.65
28	国際石油開発帝石	日本	株式	鉱業	1,101	507,515.36 558,774,416	485,000.00 533,985,000	0.65

29	東京海上HD	日本	株式	保険業	303,000	1,906.64 577,712,190	1,705.00 516,615,000	0.62
30	伊藤忠	日本	株式	卸売業	634,400	815.44 517,319,500	782.00 496,100,800	0.60

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.15%
合計	97.15%

(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	0.12%
鉱業	0.73%
建設業	2.34%
食料品	3.61%
繊維製品	0.94%
パルプ・紙	0.41%
化学	5.92%
医薬品	5.02%
石油・石炭製品	0.88%
ゴム製品	0.76%
ガラス・土石製品	1.15%
鉄鋼	1.82%
非鉄金属	1.13%
金属製品	0.67%
機械	4.90%
電気機器	13.37%
輸送用機器	9.26%
精密機器	1.33%
その他製品	1.62%
電気・ガス業	3.15%
陸運業	4.11%
海運業	0.39%
空運業	0.29%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	6.58%
卸売業	5.27%
小売業	4.28%
銀行業	9.05%
証券、商品先物取引業	0.93%
保険業	2.09%
その他金融業	0.77%
不動産業	2.12%
サービス業	1.90%
合計	97.15%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。



## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2012年3月	買建	336	2,473,335,6552	446,080,000	2.95%

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

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

## (参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（平成23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	42,737,105,997	96.67
内 香港	551,924,687	1.25
内 シンガポール	323,963,786	0.73
内 イスラエル	125,700,842	0.28
内 ノルウェー	183,084,488	0.41
内 スウェーデン	617,177,539	1.40
内 デンマーク	214,365,167	0.48
内 イギリス	4,695,582,383	10.62
内 アイルランド	58,286,315	0.13
内 オランダ	500,641,842	1.13
内 ベルギー	202,599,879	0.46
内 フランス	1,785,857,690	4.04
内 ドイツ	1,596,979,987	3.61
内 スイス	1,753,050,120	3.97
内 ポルトガル	37,558,787	0.08
内 スペイン	663,706,490	1.50
内 イタリア	459,789,789	1.04
内 フィンランド	171,253,489	0.39
内 オーストリア	51,317,511	0.12
内 ギリシャ	16,345,944	0.04
内 カナダ	2,491,971,369	5.64
内 アメリカ	24,576,283,013	55.59
内 オーストラリア	1,644,250,633	3.72
内 ニュージーランド	15,414,247	0.03

投資証券		790,170,801	1.79
内 香港		20,484,000	0.05
内 シンガポール		8,096,584	0.02
内 イギリス		48,576,131	0.11
内 オランダ		5,617,302	0.01
内 フランス		56,930,608	0.13
内 アメリカ		531,189,858	1.20
内 オーストラリア		119,276,318	0.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		681,514,171	1.54
純資産総額		44,208,790,969	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）	659,814,363	1.49
内 アメリカ	659,814,363	1.49
為替予約取引（買建）	71,527,500	0.16
内 日本	71,527,500	0.16

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

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

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

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

## (2) 投資資産（平成23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	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	133,055	5,987.92 796,723,766	6,628.88 882,006,932	2.00
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	25,400	29,049.33 737,853,973	31,494.02 799,948,332	1.81
3	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	32,100	14,066.27 451,527,447	14,473.63 464,603,626	1.05
4	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	54,218	7,576.46 410,781,815	8,354.71 452,976,090	1.02
5	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	205,800	1,933.08 397,840,669	2,022.79 416,291,170	0.94
6	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	93,850	4,192.38 393,455,145	4,432.18 415,960,468	0.94
7	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	289,200	1,165.71 337,145,864	1,404.76 406,257,113	0.92

8	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	生活必需品	74,137	4,861.08 360,386,051	5,206.24 385,975,593	0.87
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	74,200	4,882.92 362,317,532	5,121.51 380,016,131	0.86
10	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	159,595	2,181.38 348,138,043	2,345.41 374,316,635	0.85
11	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	208,263	1,508.15 314,093,093	1,687.73 351,492,838	0.80
12	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,900	45,350.79 312,920,992	49,940.17 344,587,214	0.78
13	COCA-COLA CO	アメリカ	株式	生活必需品	56,300	5,153.15 290,125,758	5,454.23 307,073,622	0.69
14	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	1,409,037	203.43 286,650,795	214.34 302,013,117	0.68
15	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	136,772	1,878.43 256,927,105	2,158.06 295,162,511	0.67
16	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	492,300	582.87 286,949,682	589.46 290,193,718	0.66
17	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	47,100	5,788.52 272,639,311	6,149.23 289,628,921	0.66
18	BP PLC	イギリス	株式	エネルギー	518,800	525.72 272,746,794	552.08 286,421,428	0.65
19	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	イギリス	株式	エネルギー	99,600	2,565.13 255,487,157	2,847.88 283,649,217	0.64
20	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	64,100	4,037.75 258,819,948	4,403.24 282,247,844	0.64
21	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	104,220	2,220.25 231,394,914	2,598.07 270,770,939	0.61
22	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	139,800	1,833.10 256,268,666	1,908.51 266,810,677	0.60
23	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	19,300	11,708.90 225,981,847	13,155.97 253,910,395	0.57
24	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	141,002	1,637.80 230,933,456	1,765.40 248,924,980	0.56
25	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	78,200	2,857.72 223,474,047	3,113.48 243,474,683	0.55
26	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	81,821	2,680.47 219,319,161	2,933.13 239,991,646	0.54
27	WAL-MART STORES INC	アメリカ	株式	生活必需品	50,700	4,522.13 229,272,285	4,663.62 236,445,666	0.53
28	BHP BILLITON LTD	オーストラリア	株式	素材	86,500	2,767.61 239,398,922	2,729.64 236,113,860	0.53
29	TOTAL SA	フランス	株式	エネルギー	57,250	3,752.45 214,828,026	3,953.37 226,330,493	0.51
30	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	43,700	4,956.70 216,608,206	5,172.81 226,052,217	0.51

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.67%
投資証券	1.79%
合計	98.46%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	12.52%
素材	7.14%
資本財・サービス	9.82%
一般消費財・サービス	9.30%
生活必需品	11.37%
ヘルスケア	10.70%
金融	15.73%
情報技術	11.81%
電気通信サービス	4.34%
公益事業	3.94%
合計	96.67%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 2012年3月	買建	27	657,521,227	659,814,363	1.49%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2012年1月	買建	300,000	35,936,100	35,937,000	0.08%
		スイス・フラン買/円売 2012年1月	買建	200,000	16,540,000	16,538,000	0.04%
		カナダ・ドル買/円売 2012年1月	買建	250,000	19,053,250	19,052,500	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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考) ダイワJ - R E I T マザーファンド

(1) 投資状況（平成23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	17,872,728,970	97.78

内 日本	17,872,728,970	97.78
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	405,627,201	2.22
純資産総額	18,278,356,171	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23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 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	8,199,879.56 3,526 2,890,895,349	630,000.00 2,221,380,000	12.15	
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	780,929.74 2,981 2,327,951,564	600,000.00 1,788,600,000	9.79	
3	日本リテールファンド	日本	投資証券	117,960.58 11,459 1,351,710,333	114,000.00 1,306,326,000	7.15	
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	83,185.00 12,819 1,066,348,605	87,300.00 1,119,098,700	6.12	
5	森トラスト総合リート	日本	投資証券	766,921.66 1,475 1,131,209,466	628,000.00 926,300,000	5.07	
6	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	145,144.38 5,973 866,947,404	148,500.00 886,990,500	4.85	
7	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	196,107.07 4,358 854,634,643	181,300.00 790,105,400	4.32	
8	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	672,097.97 1,182 794,419,811	624,000.00 737,568,000	4.04	
9	野村不動産オフィスF	日本	投資証券	452,986.31 1,860 842,554,549	395,500.00 735,630,000	4.02	
10	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	574,979.09 1,187 682,500,190	518,000.00 614,866,000	3.36	
11	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	693,046.93 902 625,128,339	667,000.00 601,634,000	3.29	
12	オリックス不動産投資	日本	投資証券	344,482.47 1,734 597,332,616	317,500.00 550,545,000	3.01	
13	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	477,046.67 958 457,010,715	478,000.00 457,924,000	2.51	
14	東急リアル・エステート	日本	投資証券	415,947.92 1,032 429,258,262	386,500.00 398,868,000	2.18	
15	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	214,175.73 2,412 516,591,866	163,200.00 393,638,400	2.15	
16	ケネディクス不動産投資法人	日本	投資証券	244,234.49 1,746 426,433,426	224,000.00 391,104,000	2.14	
17	福岡リート投資法人	日本	投資証券	510,954.42 750 383,215,819	507,000.00 380,250,000	2.08	
18	森ヒルズリート	日本	投資証券	261,886.15 1,411 369,521,372	251,800.00 355,289,800	1.94	

19	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	343,000.77 1,150 394,450,897	302,500.00 347,875,000	1.90
20	トップリート投資法人	日本	投資証券	418,472.00 945 395,456,040	345,500.00 326,497,500	1.79
21	野村不レジデンシャル	日本	投資証券	364,836.27 901 328,717,485	331,500.00 298,681,500	1.63
22	グローバル・ワン不動産投資法人	日本	投資証券	602,895.55 591 356,311,272	502,000.00 296,682,000	1.62
23	プレミアム投資法人	日本	投資証券	279,329.24 1,181 329,887,834	249,800.00 295,013,800	1.61
24	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	29,616.96 8,111 240,223,186	34,300.00 278,207,300	1.52
25	産業ファンド	日本	投資証券	393,569.28 571 224,728,062	379,500.00 216,694,500	1.19
26	積水ハウス・S I 投資法人	日本	投資証券	306,946.58 701 215,169,557	293,300.00 205,603,300	1.12
27	M I D リート投資法人	日本	投資証券	196,603.19 1,119 219,998,981	182,400.00 204,105,600	1.12
28	阪急リート投資法人	日本	投資証券	358,504.54 520 186,422,367	326,500.00 169,780,000	0.93
29	平和不動産リート	日本	投資証券	41,449.72 4,241 175,788,267	36,900.00 156,492,900	0.86
30	いちご不動産投資法人	日本	投資証券	29,997.13 5,137 154,095,307	30,450.00 156,421,650	0.86

(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	97.78%
合計	97.78%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成23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	493,171,065	97.68
内 香港	9,197,200	1.82
内 シンガポール	15,787,938	3.13
内 イスラエル	117,313	0.02
内 イギリス	27,728,329	5.49
内 オランダ	7,137,748	1.41
内 ベルギー	3,292,713	0.65
内 フランス	25,381,436	5.03
内 ドイツ	838,632	0.17
内 イタリア	481,625	0.10
内 ギリシャ	73,518	0.01
内 カナダ	15,172,582	3.01
内 アメリカ	327,788,393	64.92
内 オーストラリア	58,112,147	11.51
内 ニュージーランド	2,061,491	0.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,721,972	2.32
純資産総額	504,893,037	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23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	3,347 31,010,133	9,265.05 10,010,133	10,092.98 33,781,218	6.69
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	1,600 15,748,258	9,842.66 15,748,258	10,510.44 16,816,717	3.33
3	HCP INC	アメリカ	投資証券	4,700 13,431,295	2,857.72 13,431,295	3,246.42 15,258,185	3.02
4	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	3,400 13,982,316	4,112.44 13,982,316	4,441.28 15,100,373	2.99
5	WESTFIELD GROUP	オースト ラリア	投資証券	24,000 15,304,973	637.70 15,304,973	614.76 14,754,298	2.92
6	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	1,050 14,043,002	13,374.28 14,043,002	13,741.87 14,428,973	2.86
7	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	3,279 12,829,593	3,912.65 12,829,593	4,299.02 14,096,493	2.79
8	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	1,700 11,888,934	6,993.49 11,888,934	7,776.33 13,219,765	2.62
9	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	2,164 11,961,107	5,527.31 11,961,107	5,979.76 12,940,202	2.56

10	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	5,246 10,627,894	2,025.90 9,236.28	2,221.03 11,651,533	2.31
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	1,100 10,159,918	1,026.16 8,209,344	1,146.66 9,173,320	1.82
12	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	8,000 8,209,344	3,768.83 7,914,554	4,247.71 8,920,199	1.77
13	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	2,100 7,914,554	1,052.59 7,343,987	1,162.21 8,108,760	1.61
14	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	6,977 7,343,987	275.50 7,163,000	284.50 7,397,000	1.47
15	LINK REIT	香港	投資証券	26,000 7,163,000	262.67 7,354,995	257.14 7,199,920	1.43
16	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	28,000 7,354,995	801.52 7,173,684	754.80 6,755,487	1.34
17	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	8,950 7,173,684	197.80 6,527,400	198.59 6,553,510	1.30
18	WESTFIELD RETAIL TRUST	オーストラリア	投資証券	33,000 6,527,400	4,908.50 5,890,204	5,219.46 6,263,356	1.24
19	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	1,200 5,890,204	1,157.54 5,440,478	1,284.26 6,036,045	1.20
20	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	4,700 5,440,478	3,709.75 5,564,629	3,949.96 5,924,954	1.17
21	MACERICH CO	アメリカ	投資証券	1,500 5,564,629	571.85 5,918,680	547.65 5,668,193	1.12
22	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	10,350 5,918,680	4,713.37 4,713,376	5,189.14 5,189,145	1.03
23	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	1,000 4,713,376	6,635.88 4,645,120	7,090.66 4,963,466	0.98
24	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	700 4,645,120	248.43 4,968,736	245.27 4,905,440	0.97
25	GPT GROUP	オーストラリア	投資証券	20,000 4,968,736	1,757.70 4,394,254	1,961.38 4,903,451	0.97
26	UDR INC	アメリカ	投資証券	2,500 4,394,254	9,792.90 3,917,163	10,928.68 4,371,476	0.87
27	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	400 3,917,163	2,568.52 3,852,794	2,740.33 4,110,503	0.81
28	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	1,500 3,852,794	67.64 3,957,385	66.46 3,887,957	0.77
29	DEXUS PROPERTY GROUP	オーストラリア	投資証券	58,500 3,957,385	4,278.03 3,422,426	4,847.08 3,877,671	0.77
30	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	800 3,422,426			

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.68%
合計	97.68%

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



## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

(1) 投資状況(平成23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		7,580,262,690	62.54
	内 日本	7,580,262,690	62.54
地方債証券		1,055,737,771	8.71
	内 日本	1,055,737,771	8.71
特殊債券		1,359,499,920	11.22
	内 日本	1,359,499,920	11.22
社債券		1,645,210,555	13.57
	内 日本	1,645,210,555	13.57
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		479,974,482	3.96
純資産総額		12,120,685,418	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23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	305 10年国債	日本	国債証券	172,000,000	103.78 178,516,080	104.63 977,360	1.300000 2019/12/20	1.48
2	312 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.95 173,321,800	102.86 877,300	1.200000 2020/12/20	1.44
3	95 5年国債	日本	国債証券	155,000,000	101.07 156,669,350	101.26 960,750	0.600000 2016/03/20	1.29
4	289 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	105.70 147,992,600	106.18 652,000	1.500000 2017/12/20	1.23

5	288 10年国債	日本	国債証券	127,000,000	106.78 135,615,630	107.22 169,400	1.700000 2017/09/20	1.12
6	86 5年国債	日本	国債証券	130,000,000	101.15 131,495,080	101.15 150,504,100	0.600000 2014/09/20	1.08
7	97 5年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.15 130,203,800	100.39 1513,500	0.400000 2016/06/20	1.08
8	5 政保中部空港	日本	特殊債券	121,000,000	100.84 122,027,411	100.79 1966,669	0.800000 2013/03/28	1.01
9	310 10年国債	日本	国債証券	120,000,000	100.52 120,633,600	101.46 1754,400	1.000000 2020/09/20	1.00
10	87 5年国債	日本	国債証券	120,000,000	100.86 121,033,200	100.91 1092,000	0.500000 2014/12/20	1.00
11	318 10年国債	日本	国債証券	120,000,000	99.39 119,268,020	100.35 1426,000	1.000000 2021/09/20	0.99
12	299 10年国債	日本	国債証券	112,000,000	104.26 116,780,160	105.04 1653,760	1.300000 2019/03/20	0.97
13	303 10年国債	日本	国債証券	110,000,000	104.74 115,220,600	105.57 136,900	1.400000 2019/09/20	0.96
14	92 5年国債	日本	国債証券	114,000,000	100.01 114,020,520	100.16 188,100	0.300000 2015/09/20	0.94
15	378 東北電力	日本	社債券	100,000,000	113.12 113,126,600	112.63 1635,100	3.850000 2016/04/25	0.93
16	309 10年国債	日本	国債証券	109,000,000	101.73 110,893,750	102.53 1765,330	1.100000 2020/06/20	0.92
17	272 10年国債	日本	国債証券	105,000,000	104.18 109,391,100	104.22 1431,000	1.400000 2015/09/20	0.90
18	293 大阪府公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.52 107,520,000	107.68 1682,800	2.100000 2016/08/30	0.89
19	26 公営企業	日本	特殊債券	100,000,000	106.73 106,734,800	107.06 1069,600	1.780000 2017/03/24	0.88
20	2 政保地方公営機	日本	特殊債券	100,000,000	106.14 106,143,400	106.86 1867,900	1.600000 2018/11/16	0.88
21	18 - 2 北九州市債	日本	地方債証券	100,000,000	106.52 106,528,000	106.78 1787,500	1.790000 2016/12/20	0.88
22	27 国際協力銀行	日本	特殊債券	100,000,000	106.34 106,344,000	106.68 1680,600	1.770000 2017/03/17	0.88
23	18 - 4 札幌市公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.46 106,460,000	106.64 1643,200	1.800000 2016/09/20	0.88
24	21 - 2 埼玉県公債	日本	地方債証券	100,000,000	105.74 105,745,000	106.59 1590,500	1.570000 2019/05/27	0.88
25	77 5年国債	日本	国債証券	105,000,000	101.54 106,623,800	101.48 1561,350	1.000000 2013/09/20	0.88
26	56 政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	104.90 104,904,800	105.48 1486,100	1.400000 2018/04/20	0.87
27	296 10年国債	日本	国債証券	99,000,000	105.70 104,643,000	106.38 1319,170	1.500000 2018/09/20	0.87
28	2 成田国際空港	日本	特殊債券	100,000,000	104.38 104,388,500	104.50 1507,800	1.660000 2015/12/18	0.86

29	6 2 4 東京都公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.21 104,215,000	104.22 104,226,300	1.500000 2015/06/19	0.86
30	1 7 ソニー	日本	社債券	100,000,000	103.89 103,896,000	103.86 103,867,200	1.570000 2015/06/19	0.86

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	62.54%
地方債証券	8.71%
特殊債券	11.22%
社債券	13.57%
合計	96.04%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

#### (1) 投資状況 (平成23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	103,883,243,937	97.31
内 ユーロ	42,086,719,630	39.42
内 シンガポール	405,788,234	0.38
内 マレーシア	564,600,994	0.53
内 ノルウェー	314,472,233	0.29
内 スウェーデン	645,128,477	0.60
内 デンマーク	912,821,501	0.86
内 イギリス	9,070,108,137	8.50
内 スイス	473,278,291	0.44
内 ポーランド	749,300,871	0.70
内 カナダ	3,157,906,493	2.96
内 アメリカ	43,117,581,351	40.39
内 メキシコ	845,776,679	0.79
内 オーストラリア	1,539,761,046	1.44

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,876,077,849	2.69
純資産総額	106,759,321,786	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)	1,480,554,372	1.39
内 日本	1,480,554,372	1.39

(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23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	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	7,436,000	113.00 653,264,658	113.78 785,352	3.375000 2019/11/15	0.62
2	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,999,000	115.52 628,563,638	116.10 751,693	3.750000 2018/11/15	0.59
3	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,947,000	108.55 586,256,990	109.32 436,556	2.750000 2019/02/15	0.55
4	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,144,000	111.15 530,919,374	111.95 726,218	3.125000 2019/05/15	0.50
5	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,842,000	114.79 521,354,121	115.64 223,579	3.625000 2019/08/15	0.49
6	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,630,000	114.97 503,222,587	115.85 087,268	3.625000 2020/02/15	0.47
7	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	3,780,000	104.28 472,265,471	105.04 707,042	2.000000 2016/01/22	0.45
8	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,259,000	113.96 465,940,668	114.90 775,554	3.500000 2020/05/15	0.44
9	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,554,000	128.27 454,122,283	129.36 995,351	4.375000 2039/11/15	0.43
10	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	2,814,000	132.26 445,908,426	133.24 212,451	4.750000 2038/12/07	0.42
11	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,202,000	133.31 435,481,438	134.36 927,918	4.625000 2040/02/15	0.41
12	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,929,000	106.68 408,803,717	107.74 846,291	2.625000 2020/08/15	0.39
13	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,180,000	100.24 403,683,823	100.23 619,394	0.375000 2013/06/30	0.38
14	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,635,000	111.55 401,956,808	111.78 803,602	3.250000 2017/03/31	0.38
15	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,930,000	104.74 401,432,400	104.57 773,099	2.250000 2014/05/31	0.38

16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,752,000	102.50 387,340,396	104.89 345,244	3.000000 2015/10/25	0.37
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,585,000	105.13 379,595,368	109.12 972,685	4.250000 2023/10/25	0.37
18	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,184,000	118.35 384,979,388	119.41 410,944	3.875000 2040/08/15	0.36
19	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	2,873,000	112.27 386,449,386	112.43 999,946	5.000000 2014/09/07	0.36
20	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,417,000	110.42 379,188,327	111.45 704,614	3.125000 2021/05/15	0.36
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,622,000	103.98 379,299,321	104.50 189,990	3.000000 2014/07/12	0.36
22	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,430,000	106.36 367,418,382	110.14 483,165	4.250000 2019/04/25	0.36
23	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,658,000	104.68 379,070,568	104.66 012,729	1.875000 2015/06/30	0.36
24	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,509,000	106.46 373,173,376	107.53 928,048	2.625000 2020/11/15	0.35
25	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,256,000	110.84 363,480,374	114.24 632,627	3.500000 2019/07/04	0.35
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,841,000	92.61 358,263,396	96.09 713,774	2.500000 2020/10/25	0.35
27	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,437,000	106.71 368,077,362	106.58 635,829	2.625000 2014/12/31	0.34
28	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	3,025,000	155.25 365,107,365	156.11 130,201	8.000000 2021/11/15	0.34
29	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,076,000	114.88 364,024,571	115.84 069,675	3.625000 2021/02/15	0.34
30	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,644,000	101.34 365,887,366	101.26 577,079	1.375000 2013/01/15	0.34

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.31%
合計	97.31%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
----	----	-----	-----------	----	----	----	----------

為替予約取引	日本	スイス・フラン買/円売 2012年2月	買建	44,000	3,623,800	3,638,360	0.00%
		ユーロ買/円売 2012年1月	買建	1,555,446	161,906,400	156,633,436	0.15%
		米ドル買/円売 2012年2月	買建	4,055,146	315,493,205	315,044,272	0.30%
		豪ドル買/円売 2012年2月	買建	129,000	10,114,839	10,161,330	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2012 年1月	買建	93,494	7,033,359	7,125,151	0.01%
		ユーロ買/円売 2012年2月	買建	4,086,554	412,571,338	411,393,367	0.39%
		ポーランド・ズロチ買/円 売 2012年2月	買建	411,000	9,378,273	9,333,810	0.01%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2012年1月	買建	497,000	6,949,782	6,729,380	0.01%
		英ポンド買/円売 2012年1 月	買建	695,316	84,427,464	83,291,957	0.08%
		豪ドル買/円売 2012年1月	買建	146,000	11,373,775	11,542,760	0.01%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2012年2月	買建	429,000	5,844,633	5,808,660	0.01%
		メキシコ・ペソ買/円売 2012年2月	買建	1,901,000	10,518,161	10,531,540	0.01%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2012年2月	買建	664,000	7,469,191	7,470,000	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2012 年2月	買建	506,506	38,491,706	38,580,588	0.04%
		英ポンド買/円売 2012年2 月	買建	932,000	112,173,340	111,560,400	0.10%
米ドル買/円売 2012年1月	買建	3,752,854	292,279,260	291,709,361	0.27%		

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

[次へ](#)

## （参考情報）

2011年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	6,972円
純資産総額	23百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	1.2%
3か月間	0.0%
6か月間	-9.2%
1年間	-9.1%
3年間	5.4%
5年間	-
設定来	-30.3%



※上記の「基準価額の騰落率」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 08年12月	第2期 09年12月	第3期 10年12月	第4期 11年12月				
分配金	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
国内株式・先物	1,301	34.1%	日本円	60.4%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.1%
外国株式・先物	1,189	18.6%	米ドル	21.2%	最終利回り(%)	TOPIX先物 2403月	日本	1.0%
国内債券	270	18.1%	ユーロ	8.6%	修正デュレーション	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.8%
外国債券	627	13.5%	英ポンド	3.6%	残存年数	キャノン	日本	0.7%
外国リート	237	7.2%	豪ドル	1.8%	債券格付別構成	本田技研	日本	0.7%
国内リート	34	6.9%	カナダ・ドル	1.7%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.9%
			スイス・フラン	0.8%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.7%
			シンガポール・ドル	0.4%	A	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.5%
			香港ドル	0.4%	BBB	日本リテールファンド	日本	0.5%
コール・ローン、その他		2.9%	その他	1.1%	BB以下・無格付	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.4%
合計	3,658	-	合計	100.0%	合計	合計		7.3%

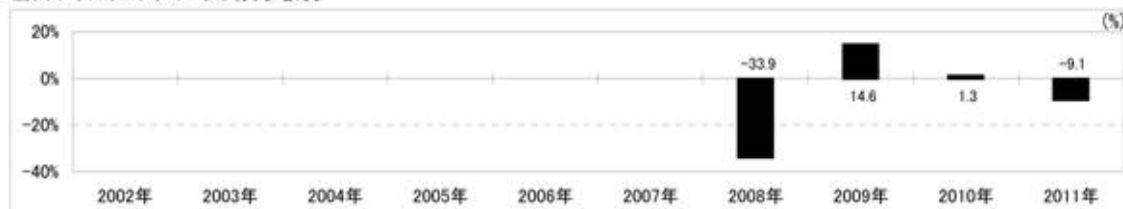
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.6%保有しております。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&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、2011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できます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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できます。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行いません。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行いません。

### 2 【換金（解約）手続等】

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

#### < 一部解約 >

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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



- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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。

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

##### （注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

##### （注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・ お電話によるお問合わせ先（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24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発送します。
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半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。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発送します。
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半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、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。

#### 反対者の買取請求権

前 1. から5. までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 1. の規定にしたがい重大な信託約款の変更等を行なう場合には、書面決議において当該解約または重大な信託約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、前 1. の2. または前 1. の2. に規定する書面に付記します。

#### 運用報告書

委託会社は、毎計算期末に、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。

#### 公告

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金にかかる請求権

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

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

#### 償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成21年12月19日から平成22年12月20日まで）及び第4期計算期間（平成22年12月21日から平成23年12月19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2030

## DCダイワ・ターゲットイヤー2030

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 平成22年12月20日現在	第4期 平成23年12月19日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	101,273	107,841
親投資信託受益証券	19,845,492	22,319,435
流動資産合計	19,946,765	22,427,276
資産合計	19,946,765	22,427,276
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	4,489	5,543
未払委託者報酬	54,262	67,110
その他未払費用	595	728
流動負債合計	59,346	73,381
負債合計	59,346	73,381
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 25,927,827	<sup>1</sup> 32,510,152
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 6,040,408	<sup>2</sup> 10,156,257
（分配準備積立金）	538,972	452,022
元本等合計	19,887,419	22,353,895
純資産合計	19,887,419	22,353,895
負債純資産合計	19,946,765	22,427,276

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	第4期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	5
有価証券売買等損益	635,612	2,139,057
営業収益合計	635,612	2,139,052
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	7,364	11,048
委託者報酬	89,240	133,858
その他費用	941	1,456
営業費用合計	97,545	146,362
営業利益又は営業損失（ ）	538,067	2,285,414
経常利益又は経常損失（ ）	538,067	2,285,414
当期純利益又は当期純損失（ ）	538,067	2,285,414
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	9,982	38,857
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,805,887	6,040,408
剰余金増加額又は欠損金減少額	173,665	1,149,329
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	173,665	1,149,329
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,936,271	3,018,621
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,936,271	3,018,621
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,040,408	10,156,257



## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第3期 自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	第4期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券  同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  平成22年12月18日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を平成22年12月20日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	計算期間末日の取扱い  平成22年12月18日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を平成22年12月20日としており、平成23年12月18日が休日のため、当計算期間末日を平成23年12月19日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	第3期 平成22年12月20日現在	第4期 平成23年12月19日現在
1. 1 期首元本額	10,636,658円	25,927,827円
期中追加設定元本額	15,967,619円	11,508,725円
期中一部解約元本額	676,450円	4,926,400円
2. 計算期間末日における受益権の総数	25,927,827口	32,510,152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6,040,408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10,156,257円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第3期 自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	第4期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（528,085円）、投資信託約款に規定される収益調整金（16,729円）及び分配準備積立金（10,887円）より分配対象額は555,701円（1万口当たり214.33円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（244,747円）及び分配準備積立金（452,022円）より分配対象額は696,769円（1万口当たり214.32円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第3期 自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	第4期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19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。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。	同左
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。	同左
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。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第3期 平成22年12月20日現在	第4期 平成23年12月19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。	同左
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	(1)有価証券 同左  (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。	同左
--	---	----

## （追加情報）

第3期 自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	第4期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
第3期計算期間（平成21年12月19日から平成22年12月20日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第3期 平成22年12月20日現在	第4期 平成23年12月19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	602,496	2,120,342
合計	602,496	2,120,342

## （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3期 平成22年12月20日現在	第4期 平成23年12月19日現在
該当事項はありません。	同左

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	第4期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	同左

## （1口当たり情報）

	第3期 平成22年12月20日現在	第4期 平成23年12月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7670円 (7,670円)	0.6876円 (6,876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	18,988,128	7,460,435	
	外国株式インデックスマザーファンド	5,332,261	4,235,948	
	ダイワJ-REITマザーファンド	1,648,624	1,565,533	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,808,284	1,587,130	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	3,824,343	4,306,975	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,836,845	3,163,414	
親投資信託受益証券 合計		33,438,485	22,319,435	
合計		33,438,485	22,319,435	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### (参考)

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

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

	平成22年12月20日現在		平成23年12月19日現在	
	金額（円）		金額（円）	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		1,520,761,148		1,419,458,317
株式	3	95,226,792,640		79,045,150,660
派生商品評価勘定		28,242,197		-
未収入金		5,784,954		-
未収配当金		7,657,300		11,031,700
前払金		-		48,035,000
流動資産合計		96,789,238,239		80,523,675,677
資産合計		96,789,238,239		80,523,675,677
負債の部				
流動負債				
派生商品評価勘定		-		59,772,024
前受金		32,450,000		-
未払金		-		314,125
未払解約金		64,159,000		18,257,000
流動負債合計		96,609,000		78,343,149
負債合計		96,609,000		78,343,149
純資産の部				
元本等				
元本	1	200,751,042,931		204,724,819,772
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	104,058,413,692		124,279,487,244
元本等合計		96,692,629,239		80,445,332,528
純資産合計		96,692,629,239		80,445,332,528
負債純資産合計		96,789,238,239		80,523,675,677

## 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21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式  同左
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引	先物取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。	受取配当金 同左

## (貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	199,333,931,814円	200,751,042,931円
同期中における追加設定元本額	16,521,838,104円	19,578,777,632円
同期中における一部解約元本額	15,104,726,987円	15,605,000,791円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
適格機関投資家専用投信1号	1,827,424,107円	2,077,517,619円
トピックス・インデックスファンド	11,079,533,919円	10,487,562,820円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	37,545,648,211円	34,573,693,019円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	1,053,039,091円	874,459,631円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	401,494,692円	420,852,938円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	6,608,755,882円	6,729,476,076円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	397,976,611円	394,142,678円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	8,907,734,943円	8,791,510,227円
DCダイワ日本株式インデックス	55,286,356,912円	60,468,426,315円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,838,255,630円	2,411,426,571円
ダイワ・ライフ・バランス50	221,259,862円	1,001,108,441円
ダイワ・ライフ・バランス70	186,410,930円	766,514,528円
年金ダイワ日本株式インデックス	1,302,232,805円	1,753,058,736円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	16,553,954円	19,141,760円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	14,800,089円	18,988,128円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	929,880円	1,562,824円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	500,282,197円	479,797,970円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	3,445,366,649円	3,619,442,756円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	2,075,331,030円	2,126,251,104円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	115,778,941円	119,251,952円

ダイワ世界分散バランスファンド 30VA	797,303,991円	813,328,821円
ダイワ世界分散バランスファンド 30VA(国内株式型)	366,639,733円	383,210,607円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	4,105,741,641円	4,221,969,163円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	605,191,818円	618,316,360円
ダイワ・バランスファンド35V A	35,280,799,677円	33,146,326,670円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド50VA	2,401,053,032円	2,581,360,950円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド75VA	5,566,223,626円	5,432,629,290円
ダイワ・バランスファンド25V A(適格機関投資家専用)	2,979,207,170円	3,021,942,080円
ダイワ国内バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	533,316,921円	576,398,066円
ダイワ国内バランスファンド30 VA(適格機関投資家専用)	446,817,143円	703,050,666円
ダイワライフスタイル25	177,412,030円	208,989,454円
ダイワライフスタイル50	502,842,713円	594,279,914円
ダイワライフスタイル75	416,552,293円	462,369,640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)	13,746,774,808円	14,826,461,998円
計	200,751,042,931円	204,724,819,772円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	200,751,042,931口	204,724,819,772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104,058,413,692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124,279,487,244円であり ます。
4. 3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。
	株式 436,050,000円	株式 443,700,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19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。	同左

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、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。	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。	同左
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。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19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	同左
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>



## （追加情報）

自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間（平成21年12月19日から平成22年12月20日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成22年12月20日現在	平成23年12月19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	5,321,960,998	4,261,033,491
合計	5,321,960,998	4,261,033,491

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年9月22日から平成22年12月20日まで、及び平成23年9月21日から平成23年12月19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22年12月20日 現在				平成23年12月19日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,411,458,000	-	1,440,000,000	28,542,000	1,461,930,000	-	1,402,380,000	59,550,000
合計	1,411,458,000	-	1,440,000,000	28,542,000	1,461,930,000	-	1,402,380,000	59,550,000

## （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## （1口当たり情報）

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.4817円 (4,817円)	0.3929円 (3,929円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	39,000	175	6,825,000	
日本水産	111,100	260	28,886,000	
マルハニチロホールディングス	197,000	135	26,595,000	
サカタのタネ	14,100	1,062	14,974,200	
ホクト	9,200	1,695	15,594,000	
ショーボンドHD	8,200	1,686	13,825,200	
ミライト・ホールディングス	25,000	575	14,375,000	
住石ホールディングス	55,600	66	3,669,600	
日鉄鉱業	24,000	303	7,272,000	
三井松島	66,000	136	8,976,000	
国際石油開発帝石	1,101	471,500	519,121,500	
日本海洋掘削	3,000	2,248	6,744,000	
関東天然瓦斯	10,000	384	3,840,000	
石油資源開発	13,200	2,932	38,702,400	
東急建設	31,030	189	5,864,670	
コムシスホールディングス	46,600	782	36,441,200	
ミサワホーム	10,300	617	6,355,100	
高松コンストラクションGP	7,500	1,200	9,000,000	
東建コーポレーション	3,320	2,570	8,532,400	
大成建設	467,000	188	87,796,000	
大林組	276,000	320	88,320,000	
清水建設	281,000	307	86,267,000	
長谷工コーポレーション	583,500	51	29,758,500	
鹿島建設	431,000	226	97,406,000	
不動テトラ	72,700	142	10,323,400	
鉄建建設	68,000	87	5,916,000	
安藤建設	49,000	95	4,655,000	
太平工業	16,000	417	6,672,000	
西松建設	123,000	128	15,744,000	
前田建設	60,000	271	16,260,000	
奥村組	86,000	306	26,316,000	
東鉄工業	12,000	622	7,464,000	
イチケン	16,000	125	2,000,000	
戸田建設	97,000	268	25,996,000	
熊谷組	78,000	66	5,148,000	
北野建設	30,000	177	5,310,000	
三井ホーム	11,000	382	4,202,000	
矢作建設	14,200	391	5,552,200	
大東建託	34,000	6,630	225,420,000	
NIPPON	20,000	742	14,840,000	
前田道路	26,000	805	20,930,000	
日本道路	26,000	202	5,252,000	
東亜建設	85,000	127	10,795,000	
東洋建設	145,000	67	9,715,000	
五洋建設	120,500	222	26,751,000	
福田組	21,000	228	4,788,000	
住友林業	60,600	662	40,117,200	
日本基礎技術	18,400	229	4,213,600	
日成ビルド工業	37,000	179	6,623,000	
エス・パイ・エル	56,000	179	10,024,000	

巴コーポレーション	19,800	274	5,425,200
パナホーム	31,000	530	16,430,000
大和ハウス	225,000	907	204,075,000
ライト工業	22,900	385	8,816,500
積水ハウス	256,000	674	172,544,000
ユアテック	15,000	370	5,550,000
四電工	10,000	328	3,280,000
中電工	15,200	808	12,281,600
関電工	48,000	354	16,992,000
きんでん	60,000	615	36,900,000
東京エネシス	15,000	426	6,390,000
トーエネック	16,000	406	6,496,000
日本電設工業	17,000	730	12,410,000
協和エクシオ	29,900	721	21,557,900
新日本空調	12,900	419	5,405,100
日本工営	30,000	275	8,250,000
日本電話施設	20,000	250	5,000,000
九電工	17,000	458	7,786,000
三機工業	25,000	386	9,650,000
日揮	85,000	1,773	150,705,000
中外炉工業	32,000	265	8,480,000
太平電業	15,000	588	8,820,000
高砂熱学	27,500	654	17,985,000
三晃金属	17,000	220	3,740,000
NEC ネットズアイ	7,800	1,128	8,798,400
朝日工業社	12,000	330	3,960,000
大気社	14,000	1,615	22,610,000
ダイダン	15,000	510	7,650,000
日比谷総合設	11,900	758	9,020,200
東芝プラントシステム	15,000	738	11,070,000
日本製粉	55,000	332	18,260,000
日清製粉G本社	82,000	920	75,440,000
昭和産業	43,000	237	10,191,000
鳥越製粉	8,300	692	5,743,600
協同飼料	62,000	89	5,518,000
中部飼料	9,900	473	4,682,700
日本配合飼料	43,000	109	4,687,000
日本甜菜糖	60,000	148	8,880,000
三井製糖	35,000	268	9,380,000
ネクスト	8,300	288	2,390,400
日本M&Aセンター	20	421,500	8,430,000
アコーディア・ゴルフ	356	56,500	20,114,000
パソナグループ	93	72,800	6,770,400
テンプホールディングス	13,900	680	9,452,000
森永製菓	86,000	178	15,308,000
中村屋	25,000	376	9,400,000
江崎グリコ	34,000	847	28,798,000
名糖産業	5,500	971	5,340,500
不二家	66,000	160	10,560,000
山崎製パン	65,000	1,014	65,910,000
モロゾフ	23,000	266	6,118,000
カルビー	5,100	3,600	18,360,000
森永乳業	75,000	289	21,675,000
ヤクルト	48,000	2,341	112,368,000
明治ホールディングス	27,300	3,140	85,722,000

雪印メグミルク	19,100	1,464	27,962,400
プリマハム	58,000	117	6,786,000
日本ハム	70,000	946	66,220,000
伊藤ハム	53,000	303	16,059,000
丸大食品	41,000	273	11,193,000
米 久	9,700	717	6,954,900
S Foods	6,000	632	3,792,000
スタジオアリス	4,900	1,198	5,870,200
シミック	3,600	1,259	4,532,400
システナ	131	52,900	6,929,900
NECフィールドディング	6,600	954	6,296,400
新日鉄ソリューションズ	5,900	1,586	9,357,400
総合警備保障	30,400	804	24,441,600
日本駐車場開発	1,237	3,530	4,366,610
カカクコム	13,600	2,840	38,624,000
新日本科学	17,000	191	3,247,000
エムスリー	67	337,000	22,579,000
ディー・エヌ・エー	38,300	2,250	86,175,000
博報堂DYHLDGS	10,460	4,270	44,664,200
ぐるなび	7,400	829	6,134,600
サッポロホールディングス	158,000	300	47,400,000
アサヒグループホールディング	168,900	1,689	285,272,100
キリンHD	363,000	916	332,508,000
宝ホールディングス	82,000	480	39,360,000
オエノンホールディングス	35,000	188	6,580,000
養命酒	11,000	712	7,832,000
三国コカ・コ・ラ	8,400	685	5,754,000
コカ・コーラウエスト	30,700	1,329	40,800,300
コカコーラセントラルジャパン	11,300	1,002	11,322,600
ダイドードリンコ	4,200	3,055	12,831,000
伊藤園	26,100	1,304	34,034,400
キーコーヒー	9,100	1,384	12,594,400
日清オイリオグループ	35,000	314	10,990,000
不二製油	22,100	1,093	24,155,300
J-オイルミルズ	35,000	212	7,420,000
ローソン	24,600	4,575	112,545,000
サンエー	2,500	3,035	7,587,500
キリン堂	5,000	500	2,500,000
カワチ薬品	6,000	1,518	9,108,000
エービーシー・マート	11,300	2,857	32,284,100
アスクル	8,100	1,135	9,193,500
ゲオホールディングス	137	77,800	10,658,600
ポイント	6,920	3,275	22,663,000
伊藤忠食品	1,600	2,697	4,315,200
くらコーポレーション	5,300	980	5,194,000
キャンドゥ	77	82,400	6,344,800
エレマテック	6,200	1,266	7,849,200
パル	2,650	2,950	7,817,500
エディオン	32,000	624	19,968,000
サーラコーポレーション	16,000	465	7,440,000
あみやき亭	19	186,200	3,537,800
ひらまつ	58	62,800	3,642,400
双日	550,100	118	64,911,800
ゲンキー	1,400	1,734	2,427,600
アルフレッサホールディングス	20,700	3,110	64,377,000

ハニーズ	8,530	1,159	9,886,270
キッコーマン	76,000	865	65,740,000
味の素	238,000	915	217,770,000
キューピー	43,600	1,080	47,088,000
ハウス食品	31,000	1,451	44,981,000
カゴメ	34,100	1,502	51,218,200
焼津水産化工	8,500	702	5,967,000
アリアケジャパン	9,200	1,431	13,165,200
ニチレイ	103,000	367	37,801,000
横浜冷凍	19,200	611	11,731,200
東洋水産	39,000	1,863	72,657,000
日清食品HD	34,300	2,967	101,768,100
永谷園	10,000	864	8,640,000
フジッコ	10,000	943	9,430,000
ロックフィールド	4,900	1,258	6,164,200
日本たばこ産業	2,000	364,000	728,000,000
わらべや日洋	5,300	972	5,151,600
片倉工業	12,000	703	8,436,000
グンゼ	67,000	219	14,673,000
昭栄	16,200	544	8,812,800
アルペン	4,900	1,363	6,678,700
アルコニックス	2,900	1,488	4,315,200
ビックカメラ	288	41,350	11,908,800
DCMホールディングス	41,900	586	24,553,400
MonotaRO	6,400	815	5,216,000
あいホールディングス	13,400	338	4,529,200
J. フロントリテイリング	196,000	351	68,796,000
ドトール・日レスHD	13,800	986	13,606,800
マツモトキヨシHLDS	14,600	1,536	22,425,600
ココカラファイン	8,700	2,013	17,513,100
三越伊勢丹HD	160,600	778	124,946,800
東洋紡績	366,000	104	38,064,000
ユニチカ	241,000	42	10,122,000
富士紡ホールディングス	41,000	160	6,560,000
日清紡ホールディングス	55,000	655	36,025,000
倉敷紡績	83,000	145	12,035,000
ダイワボウHD	85,000	176	14,960,000
シキボウ	70,000	103	7,210,000
日東紡績	66,000	289	19,074,000
トヨタ紡織	29,000	777	22,533,000
クリエイトSDH	3,800	1,567	5,954,600
バイタルKSKHD	17,100	560	9,576,000
UKCホールディングス	4,500	707	3,181,500
TOKAIホールディングス	50,800	370	18,796,000
日本毛織	29,000	527	15,283,000
ダイドーリミテッド	11,100	654	7,259,400
野村不動産HLDS	38,600	1,124	43,386,400
ヒューリック	24,300	828	20,120,400
帝国繊維	7,000	510	3,570,000
ブックオフコーポレーション	6,000	688	4,128,000
日本コークス工業	80,500	97	7,808,500
JFE商事HLDS	49,000	310	15,190,000
あさひ	5,200	1,605	8,346,000
サークルKサンクス	16,700	1,237	20,657,900
日本調剤	1,220	2,590	3,159,800

コスモス薬品	3,900	3,805	14,839,500
シップヘルスケアHD	10,300	1,674	17,242,200
セブン&アイ・HLDGS	332,900	2,096	697,758,400
ツルハホールディングス	7,200	4,315	31,068,000
サンマルクホールディングス	2,500	2,963	7,407,500
トリドール	9,900	752	7,444,800
帝人	353,000	233	82,249,000
東レ	614,000	540	331,560,000
クラレ	133,600	1,070	142,952,000
旭化成	491,000	447	219,477,000
サカイオーベックス	43,000	116	4,988,000
稲葉製作所	5,300	913	4,838,900
三協・立山HLDGS	123,000	102	12,546,000
トーカロ	5,100	1,579	8,052,900
SUMCO	55,000	566	31,130,000
住江織物	35,000	134	4,690,000
日本バイリン	11,000	330	3,630,000
芦森工業	39,000	105	4,095,000
アツギ	65,000	91	5,915,000
セーレン	21,900	454	9,942,600
小松精練	15,000	332	4,980,000
ワコールホールディングス	51,000	993	50,643,000
ホギメディカル	5,300	3,215	17,039,500
レナウン	34,900	140	4,886,000
TSIホールディングス	45,200	359	16,226,800
ITホールディングス	26,500	918	24,327,000
グリー	35,300	2,469	87,155,700
コーエーテクモHD	16,900	625	10,562,500
三菱総合研究所	4,400	1,380	6,072,000
ボルテージ	2,000	948	1,896,000
特種東海製紙	64,000	168	10,752,000
ドワンゴ	51	124,000	6,324,000
マクロミル	10,400	800	8,320,000
ティーガイア	57	142,700	8,133,900
GMOペイメントゲートウェイ	23	321,500	7,394,500
ザッパラス	63	74,300	4,680,900
インターネットイニシアティブ	49	273,000	13,377,000
ソネットエンタテインメント	46	272,200	12,521,200
SRAホールディングス	5,100	780	3,978,000
JBSホールディングス	17,600	229	4,030,400
王子製紙	367,000	380	139,460,000
三菱製紙	176,000	71	12,496,000
北越紀州製紙	52,500	512	26,880,000
中越パルプ	48,000	128	6,144,000
大王製紙	37,000	523	19,351,000
日本製紙G本社	42,500	1,591	67,617,500
レンゴー	65,000	549	35,685,000
トーモク	23,000	199	4,577,000
ザ・パック	4,800	1,150	5,520,000
昭和電工	525,000	157	82,425,000
住友化学	580,000	284	164,720,000
住友精化	19,000	327	6,213,000
日産化学	66,500	720	47,880,000
ラサ工業	46,000	122	5,612,000
クレハ	60,000	356	21,360,000

テイカ	18,000	279	5,022,000
石原産業	154,000	89	13,706,000
日本曹達	53,000	335	17,755,000
東ソー	235,000	209	49,115,000
トクヤマ	139,000	251	34,889,000
セントラル硝子	80,000	353	28,240,000
東亜合成	103,000	316	32,548,000
ダイソー	38,000	240	9,120,000
関東電化	24,000	276	6,624,000
電気化学	182,000	281	51,142,000
イビデン	53,700	1,617	86,832,900
信越化学	151,500	3,650	552,975,000
日本カ-バイド	46,000	109	5,014,000
堺化学	27,000	285	7,695,000
エア・ウォーター	69,000	986	68,034,000
大陽日酸	110,000	531	58,410,000
日本化学工業	52,000	129	6,708,000
日本パ-カラライジング	20,000	934	18,680,000
高压ガス	12,000	451	5,412,000
チタン工業	13,000	384	4,992,000
四国化成	12,000	414	4,968,000
戸田工業	14,000	636	8,904,000
ステラケミファ	4,900	2,293	11,235,700
保土谷化学	24,000	234	5,616,000
日本触媒	63,000	803	50,589,000
大日精化	30,000	322	9,660,000
カネカ	104,000	406	42,224,000
協和発酵キリン	115,000	918	105,570,000
三菱瓦斯化学	145,000	430	62,350,000
三井化学	367,000	242	88,814,000
J S R	76,600	1,378	105,554,800
東京応化工業	14,700	1,525	22,417,500
三菱ケミカルH L D G S	527,500	420	221,550,000
日本合成化学	20,000	420	8,400,000
ダイセル	110,000	434	47,740,000
住友ベ-クライト	73,000	430	31,390,000
積水化学	174,000	616	107,184,000
日本ゼオン	80,000	623	49,840,000
アイカ工業	21,300	1,024	21,811,200
宇部興産	359,000	200	71,800,000
積水樹脂	12,000	710	8,520,000
タキロン	22,000	265	5,830,000
旭有機材	32,000	199	6,368,000
日立化成	36,500	1,341	48,946,500
大倉工業	22,000	240	5,280,000
積水化成品	24,000	282	6,768,000
日本化薬	59,000	749	44,191,000
イーピーエス	52	149,500	7,774,000
パナソニック電工I S	2,100	1,959	4,113,900
フェイス	464	8,100	3,758,400
野村総合研究所	43,900	1,709	75,025,100
ケネディクス	1,094	11,200	12,252,800
電通	76,900	2,251	173,101,900
インテージ	2,400	1,396	3,350,400
シンプレクスホールディング	202	27,150	5,484,300

日本精化	8,900	497	4,423,300
A D E K A	36,800	722	26,569,600
日油	66,000	374	24,684,000
ミヨシ油脂	66,000	104	6,864,000
ハリマ化成	7,300	600	4,380,000
花 王	223,700	2,007	448,965,900
第一工業製薬	20,000	215	4,300,000
三洋化成	27,000	487	13,149,000
武田薬品	316,900	3,225	1,022,002,500
アステラス製薬	187,400	3,025	566,885,000
大日本住友製薬	61,200	847	51,836,400
塩野義製薬	134,100	965	129,406,500
田辺三菱製薬	84,400	1,210	102,124,000
わかもと製薬	22,000	234	5,148,000
あすか製薬	12,000	463	5,556,000
日本新薬	18,000	895	16,110,000
中外製薬	98,300	1,248	122,678,400
科研製薬	32,000	1,021	32,672,000
エーザイ	103,800	3,065	318,147,000
ロート製薬	36,000	961	34,596,000
小野薬品	40,800	4,025	164,220,000
久光製薬	26,100	3,150	82,215,000
持田製薬	29,000	844	24,476,000
参天製薬	28,200	2,969	83,725,800
扶桑薬品	40,000	204	8,160,000
日本ケミファ	17,000	284	4,828,000
ツムラ	23,500	2,210	51,935,000
日医工	15,300	1,792	27,417,600
テ ル モ	62,700	3,695	231,676,500
みらかホールディングス	22,100	2,928	64,708,800
キッセイ薬品工業	16,000	1,525	24,400,000
生化学工業	17,700	803	14,213,100
栄研化学	7,100	991	7,036,100
日水製薬	3,000	670	2,010,000
鳥居薬品	6,400	1,392	8,908,800
東和薬品	4,700	3,210	15,087,000
沢井製薬	5,700	7,750	44,175,000
ゼリア新薬工業	13,000	1,271	16,523,000
第一三共	284,700	1,456	414,523,200
キョーリン製薬HD	20,000	1,348	26,960,000
大幸薬品	6,500	785	5,102,500
大塚ホールディングス	165,500	2,140	354,170,000
大正製薬HD	20,200	5,680	114,736,000
大日本塗料	77,000	79	6,083,000
日本ペイント	79,000	547	43,213,000
関西ペイント	94,000	687	64,578,000
中国塗料	25,000	473	11,825,000
藤倉化成	13,000	366	4,758,000
太陽ホールディングス	7,000	1,915	13,405,000
D I C	326,000	127	41,402,000
サカタインクス	15,000	323	4,845,000
東洋インキSCホールディング	75,000	278	20,850,000
アルプス技研	5,900	719	4,242,100
サニックス	18,300	219	4,007,700
オリエンタルランド	22,700	7,950	180,465,000



ダスキン	23,500	1,490	35,015,000
パーク24	42,000	1,032	43,344,000
明光ネットワークジャパン	10,100	655	6,615,500
ファルコSDホールディングス	6,200	852	5,282,400
フジ・メディア・HD	828	112,100	92,818,800
ラウンドワン	29,200	470	13,724,000
リゾートトラスト	13,400	1,088	14,579,200
オービック	2,460	14,250	35,055,000
ヤフー	5,840	23,900	139,576,000
ビー・エム・エル	5,300	1,856	9,836,800
ワタベウェディング	5,200	659	3,426,800
トレンドマイクロ	35,700	2,379	84,930,300
もしもしホットライン	16,300	715	11,654,500
東急コミュニティー	2,000	2,351	4,702,000
リソー教育	1,065	4,460	4,749,900
日本オラクル	14,000	2,594	36,316,000
アルファシステムズ	4,200	1,165	4,893,000
フューチャーアーキテクト	141	30,850	4,349,850
ユー・エス・エス	10,730	6,800	72,964,000
オービックビジネスC	2,050	3,625	7,431,250
伊藤忠テクノソリューションズ	9,600	3,350	32,160,000
テー・オー・ダブリュー	4,100	474	1,943,400
大塚商会	6,300	5,270	33,201,000
総合メディカル	1,700	2,535	4,309,500
セントラルスポーツ	4,200	977	4,103,400
電通国際情報S	7,600	761	5,783,600
ウェザーニューズ	2,800	2,109	5,905,200
富士フイルムHLDGS	181,000	1,767	319,827,000
コニカミノルタHLDGS	216,000	569	122,904,000
資生堂	140,600	1,370	192,622,000
ライオン	95,000	450	42,750,000
高砂香料	30,000	352	10,560,000
マンダム	9,000	1,938	17,442,000
ミルボン	4,800	2,395	11,496,000
ファンケル	22,400	1,049	23,497,600
コーセー	13,100	1,819	23,828,900
ドクターシーラボ	52	397,500	20,670,000
ポーラ・オルビスHD	9,000	2,015	18,135,000
エステー	6,900	953	6,575,700
コニシ	6,100	1,003	6,118,300
長谷川香料	10,900	1,127	12,284,300
小林製薬	11,000	3,900	42,900,000
荒川化学工業	9,500	679	6,450,500
日本高純度化学	32	214,800	6,873,600
アース製薬	5,400	2,911	15,719,400
イハラケミカル	16,000	275	4,400,000
大成ラミック	2,500	2,389	5,972,500
クミアイ化学	23,000	284	6,532,000
日本農薬	22,000	315	6,930,000
昭和シェル石油	78,300	529	41,420,700
コスモ石油	231,000	212	48,972,000
ニチレキ	14,000	363	5,082,000
東燃ゼネラル石油	119,000	865	102,935,000
ユシロ化学	6,600	837	5,524,200
AOCホールディングス	21,400	462	9,886,800

出光興産	9,800	8,080	79,184,000
J Xホールディングス	936,400	450	421,380,000
横浜ゴム	103,000	424	43,672,000
東洋ゴム	65,000	176	11,440,000
ブリヂストン	264,500	1,686	445,947,000
住友ゴム	64,900	891	57,825,900
オカモト	30,000	298	8,940,000
アキレス	74,000	103	7,622,000
フコク	3,500	685	2,397,500
ニッタ	8,500	1,336	11,356,000
東海ゴム工業	15,500	869	13,469,500
三ツ星ベルト	23,000	377	8,671,000
バンドー化学	31,000	292	9,052,000
鬼怒川ゴム	20,000	655	13,100,000
旭硝子	416,000	639	265,824,000
日本板硝子	370,000	143	52,910,000
有沢製作所	17,800	288	5,126,400
日本山村硝子	39,000	190	7,410,000
日本電気硝子	163,000	733	119,479,000
オハラ	6,200	756	4,687,200
住友大阪セメント	177,000	215	38,055,000
太平洋セメント	503,000	141	70,923,000
東海カーボン	77,000	404	31,108,000
日本カーボン	43,000	216	9,288,000
東洋炭素	5,000	3,235	16,175,000
ノリタケ	43,000	219	9,417,000
TOTO	132,000	582	76,824,000
日本碍子	111,000	871	96,681,000
日本特殊陶業	72,000	930	66,960,000
MARUWA	2,400	3,615	8,676,000
品川リフラクトリーズ	25,000	213	5,325,000
黒崎播磨	22,000	231	5,082,000
フジミインコーポレーテッド	8,800	845	7,436,000
ニチアス	37,000	413	15,281,000
新日本製鐵	2,225,000	185	411,625,000
住友金属工業	1,578,000	134	211,452,000
神戸製鋼所	1,179,000	118	139,122,000
日新製鋼	309,000	109	33,681,000
合同製鐵	53,000	186	9,858,000
J F Eホールディングス	201,600	1,384	279,014,400
東京製鐵	45,300	632	28,629,600
共英製鋼	9,500	1,382	13,129,000
大和工業	19,400	2,047	39,711,800
大阪製鐵	5,800	1,318	7,644,400
淀川製鋼所	60,000	327	19,620,000
東洋鋼板	22,000	259	5,698,000
丸一鋼管	25,500	1,658	42,279,000
大同特殊鋼	140,000	472	66,080,000
日本金属工業	88,000	64	5,632,000
日本冶金工	76,500	120	9,180,000
山陽特殊製鋼	43,000	403	17,329,000
愛知製鋼	47,000	357	16,779,000
日立金属	54,000	804	43,416,000
日本金属	26,000	136	3,536,000
大平洋金属	64,000	371	23,744,000

日本電工	34,000	347	11,798,000
栗本鉄工所	53,000	152	8,056,000
日本製鋼所	134,000	507	67,938,000
三菱製鋼	53,000	200	10,600,000
日本精線	7,000	381	2,667,000
日本軽金属	208,000	99	20,592,000
三井金属	240,000	195	46,800,000
東邦亜鉛	56,000	279	15,624,000
三菱マテリアル	532,000	203	107,996,000
住友鉱山	219,000	962	210,678,000
DOWAホールディングス	105,000	471	49,455,000
古河機金	166,000	63	10,458,000
大阪チタニウム	8,800	3,360	29,568,000
東邦チタニウム	15,300	1,275	19,507,500
住友軽金属	222,000	71	15,762,000
古河スカイ	37,000	173	6,401,000
古河電工	276,000	176	48,576,000
住友電工	299,200	802	239,958,400
フジクラ	137,000	224	30,688,000
昭和電線HLDGS	141,000	70	9,870,000
タツタ電線	18,000	322	5,796,000
日立電線	81,000	158	12,798,000
リョービ	47,000	282	13,254,000
アサヒHD	11,600	1,503	17,434,800
東洋製罐	61,500	1,026	63,099,000
ホッカンホールディングス	21,000	218	4,578,000
コロナ	4,800	1,284	6,163,200
横河ブリッジHLDGS	21,000	487	10,227,000
駒井ハルテック	30,000	176	5,280,000
三和ホールディングス	89,000	229	20,381,000
文化シャツタ-	29,000	256	7,424,000
住生活グループ	110,300	1,423	156,956,900
日本フィルコン	10,700	387	4,140,900
ノーリツ	17,000	1,382	23,494,000
長府製作所	8,200	1,904	15,612,800
リンナイ	13,400	5,240	70,216,000
ユニプレス	12,600	2,102	26,485,200
日東精工	17,000	210	3,570,000
岡 部	17,100	391	6,686,100
東 プ レ	15,900	719	11,432,100
高周波熱錬	12,900	544	7,017,600
東京製鋼	66,000	151	9,966,000
パイオラックス	3,700	1,719	6,360,300
日本発条	61,100	669	40,875,900
三浦工業	12,500	2,146	26,825,000
タ ク マ	32,000	321	10,272,000
ツ ガ ミ	24,000	465	11,160,000
オークマ	54,000	516	27,864,000
東芝機械	49,000	369	18,081,000
ア マ ダ	124,000	463	57,412,000
アイダエンジニア	23,600	344	8,118,400
牧野フライス	45,000	488	21,960,000
オーエスジー	37,600	907	34,103,200
旭ダイヤモンド	22,300	972	21,675,600
森精機製作所	45,800	686	31,418,800

ディスコ	8,800	3,975	34,980,000
日東工器	5,100	1,700	8,670,000
豊田自動織機	72,400	2,024	146,537,600
大阪機工	56,000	86	4,816,000
津田駒工業	33,000	156	5,148,000
島精機製作所	11,600	1,304	15,126,400
日阪製作所	12,000	826	9,912,000
ナブテスコ	35,700	1,443	51,515,100
三井海洋開発	7,300	1,258	9,183,400
S M C	25,200	12,080	304,416,000
新川	13,200	381	5,029,200
ホソカワミクロン	17,000	367	6,239,000
ユニオンツール	5,900	1,333	7,864,700
オイレス工業	9,500	1,442	13,699,000
サト - ホールディングス	9,600	928	8,908,800
ワイエイシイ	5,100	626	3,192,600
小松製作所	401,900	1,798	722,616,200
住友重機械	221,000	421	93,041,000
日立建機	44,700	1,281	57,260,700
日 工	14,000	270	3,780,000
巴工業	2,900	1,302	3,775,800
井関農機	94,000	165	15,510,000
T O W A	10,900	370	4,033,000
丸山製作所	32,000	167	5,344,000
北川鉄工所	51,000	133	6,783,000
クボタ	388,000	616	239,008,000
東洋エンジニア	50,000	269	13,450,000
三菱化工機	38,000	128	4,864,000
月島機械	13,000	620	8,060,000
帝国電機製作所	3,300	1,282	4,230,600
新東工業	18,600	638	11,866,800
アイチ コーポレーション	15,700	298	4,678,600
小森コーポレーション	30,600	488	14,932,800
住友精密	13,000	497	6,461,000
荏原製作所	144,000	265	38,160,000
西島製作所	10,500	1,003	10,531,500
千代田化工建	75,000	769	57,675,000
ダイキン工業	103,000	2,099	216,197,000
オルガノ	16,000	567	9,072,000
ト - ヨ - カネツ	57,000	142	8,094,000
栗田工業	46,500	1,955	90,907,500
椿本チエイン	43,000	400	17,200,000
日 機 装	27,000	628	16,956,000
木村化工機	12,600	305	3,843,000
新興プランテック	18,800	629	11,825,200
アネスト岩田	15,000	304	4,560,000
ダイフク	40,500	388	15,714,000
加藤製作所	24,000	214	5,136,000
タダノ	40,000	470	18,800,000
フジテック	21,000	425	8,925,000
シーケーディ	25,700	536	13,775,200
平和	16,000	1,335	21,360,000
理想科学工業	5,900	1,076	6,348,400
S A N K Y O	24,100	3,830	92,303,000
日本金銭機械	8,700	597	5,193,900

マースエンジニアリング	4,800	1,319	6,331,200
ダイコク電機	7,500	720	5,400,000
ア マ ノ	23,500	684	16,074,000
J U K I	56,000	175	9,800,000
サンデン	46,000	212	9,752,000
ブラザー工業	104,500	940	98,230,000
マックス	12,000	926	11,112,000
モリタホールディングス	12,000	405	4,860,000
グローリー	24,100	1,569	37,812,900
大和冷機工業	9,000	388	3,492,000
セガサミーホールディングス	86,700	1,640	142,188,000
日本ピストンリング	39,000	149	5,811,000
リ ケ ン	30,000	291	8,730,000
T P R	8,800	882	7,761,600
ホシザキ電機	15,100	1,815	27,406,500
大豊工業	6,600	660	4,356,000
日本精工	182,000	481	87,542,000
N T N	191,000	296	56,536,000
ジェイテクト	78,500	708	55,578,000
不 二 越	84,000	323	27,132,000
ミネベア	128,000	316	40,448,000
日本トムソン	29,000	429	12,441,000
T H K	54,800	1,492	81,761,600
ユーシン精機	4,400	1,395	6,138,000
前澤給装工業	3,600	1,031	3,711,600
イーグル工業	11,000	594	6,534,000
日本ピラ - 工業	9,000	512	4,608,000
キッツ	34,700	307	10,652,900
日 立	1,814,000	403	731,042,000
東 芝	1,706,000	314	535,684,000
三菱電機	808,000	704	568,832,000
富士電機	248,000	212	52,576,000
東洋電機製造	16,000	289	4,624,000
安川電機	99,000	637	63,063,000
シンフォニア テクノロジー	55,000	159	8,745,000
明 電 舎	87,000	262	22,794,000
オリジン電気	17,000	220	3,740,000
デンヨー	8,000	1,026	8,208,000
日立工機	23,400	578	13,525,200
三桜工業	11,100	503	5,583,300
マキタ	52,800	2,418	127,670,400
東芝テック	50,000	264	13,200,000
芝浦メカトロニクス	19,000	204	3,876,000
マブチモーター	10,700	3,260	34,882,000
日本電産	43,600	6,500	283,400,000
高岳製作所	41,000	169	6,929,000
ダイヘン	51,000	268	13,668,000
第一精工	2,600	2,177	5,660,200
日新電機	18,000	422	7,596,000
大崎電気	12,000	725	8,700,000
オムロン	89,800	1,551	139,279,800
日東工業	12,000	839	10,068,000
I D E C	11,900	767	9,127,300
エルピーダメモリ	112,700	364	41,022,800
ジーエス・ユアサ コーポ	160,000	408	65,280,000

メルコホールディングス	4,800	2,067	9,921,600
日本電気	1,120,000	157	175,840,000
富士通	780,000	396	308,880,000
沖電気	329,000	68	22,372,000
岩崎通信機	66,000	69	4,554,000
電気興業	29,000	339	9,831,000
サンケン電気	46,000	250	11,500,000
アイホン	5,100	1,431	7,298,100
ルネサスエレクトロニクス	25,100	470	11,797,000
セイコーエプソン	55,600	1,001	55,655,600
ワコム	167	120,000	20,040,000
アルバック	16,700	960	16,032,000
アクセル	4,000	1,571	6,284,000
ナナオ	7,700	1,520	11,704,000
日本信号	20,400	447	9,118,800
京三製作所	18,000	304	5,472,000
能美防災	12,000	516	6,192,000
日本無線	17,000	177	3,009,000
パナソニック	926,700	649	601,428,300
シャープ	393,000	695	273,135,000
アンリツ	39,000	833	32,487,000
富士通ゼネラル	22,000	426	9,372,000
日立国際電気	21,000	627	13,167,000
ソニー	506,300	1,319	667,809,700
T D K	42,700	3,355	143,258,500
帝国通信工業	37,000	119	4,403,000
ミツミ電機	33,300	570	18,981,000
タムラ製作所	32,000	185	5,920,000
アルプス電気	67,500	520	35,100,000
パイオニア	119,300	335	39,965,500
日本電波工業	7,500	938	7,035,000
ローランド ディー・ジー	5,200	851	4,425,200
フオスタ - 電機	9,200	1,045	9,614,000
クラリオン	62,000	126	7,812,000
S M K	30,000	244	7,320,000
ヨコオ	8,000	386	3,088,000
東光	47,000	141	6,627,000
ホシデン	25,000	524	13,100,000
ヒロセ電機	13,900	6,690	92,991,000
日本航空電子	19,000	526	9,994,000
T O A	10,000	469	4,690,000
ユニデン	27,000	257	6,939,000
アルパイン	17,100	820	14,022,000
スミダコーポレーション	5,800	505	2,929,000
アイコム	5,200	1,932	10,046,400
船井電機	8,400	1,658	13,927,200
横河電機	89,100	695	61,924,500
新電元工業	29,000	312	9,048,000
山武	20,400	1,595	32,538,000
日本光電工業	16,000	1,785	28,560,000
堀場製作所	14,800	2,272	33,625,600
アドバンテスト	63,100	757	47,766,700
エスベック	10,800	456	4,924,800
パナソニック電工 S U N X	9,100	380	3,458,000
キーエンス	17,800	18,270	325,206,000

日置電機	4,500	1,326	5,967,000
シスメックス	27,900	2,480	69,192,000
メガチップス	7,600	1,164	8,846,400
日本電産コパル電子	9,100	457	4,158,700
デンソー	199,700	2,032	405,790,400
コーセル	11,700	1,065	12,460,500
日立メディコ	6,000	752	4,512,000
オプテックス	5,900	983	5,799,700
千代田インテグレ	3,900	949	3,701,100
東光電気	10,000	307	3,070,000
スタンレー電気	54,100	1,082	58,536,200
岩崎電気	39,000	163	6,357,000
ウシオ電機	48,400	1,135	54,934,000
日本セラミック	4,800	1,403	6,734,400
新神戸電機	6,000	1,703	10,218,000
日本デジタル研究所	8,500	712	6,052,000
古河電池	8,000	354	2,832,000
図研	7,500	542	4,065,000
日本電子	36,000	192	6,912,000
カシオ	81,000	467	37,827,000
ファナック	84,200	11,830	996,086,000
日本シイエムケイ	21,700	247	5,359,900
エンプラス	4,700	1,447	6,800,900
ローム	39,600	3,425	135,630,000
浜松ホトニクス	30,900	2,662	82,255,800
新光電気工業	30,100	537	16,163,700
京セラ	67,200	6,270	421,344,000
太陽誘電	40,600	594	24,116,400
村田製作所	84,600	3,990	337,554,000
ユーシン	12,600	635	8,001,000
双葉電子工業	13,900	1,209	16,805,100
日東電工	69,800	2,802	195,579,600
北陸電気工業	44,000	106	4,664,000
東海理化電機	19,200	1,114	21,388,800
ニチコン	26,400	810	21,384,000
日本ケミコン	52,000	257	13,364,000
K O A	10,200	663	6,762,600
三井造船	329,000	117	38,493,000
日立造船	331,500	97	32,155,500
佐世保重工業	49,000	125	6,125,000
三菱重工業	1,353,000	320	432,960,000
川崎重工業	597,000	191	114,027,000
I H I	558,000	180	100,440,000
日本車輜	32,000	285	9,120,000
近畿車輜	17,000	231	3,927,000
日産自動車	1,018,700	682	694,753,400
いすゞ自動車	516,000	347	179,052,000
トヨタ自動車	1,039,400	2,487	2,584,987,800
日野自動車	117,000	445	52,065,000
三菱自動車工業	1,814,000	90	163,260,000
エフテック	4,200	846	3,553,200
武蔵精密工業	7,700	1,606	12,366,200
トヨタ車体	14,700	1,117	16,419,900
日産車体	23,000	733	16,859,000
関東自動車	12,900	620	7,998,000

新明和工業	38,000	313	11,894,000
日信工業	15,100	1,038	15,673,800
トピー工業	66,000	189	12,474,000
ティラド	32,000	239	7,648,000
曙ブレーキ	42,900	319	13,685,100
タチエス	10,300	1,199	12,349,700
N O K	38,700	1,281	49,574,700
フタバ産業	24,000	425	10,200,000
カヤバ工業	58,000	340	19,720,000
シロキ工業	18,000	215	3,870,000
市光工業	39,000	127	4,953,000
大同メタル工業	12,000	813	9,756,000
プレス工業	40,000	356	14,240,000
カルソニックカンセイ	50,000	428	21,400,000
太平洋工業	18,000	358	6,444,000
ケーヒン	17,500	1,214	21,245,000
河西工業	12,000	391	4,692,000
アイシン精機	66,200	2,106	139,417,200
富士機工	15,000	205	3,075,000
マ ッ ダ	688,000	132	90,816,000
ダイハツ	74,000	1,335	98,790,000
愛知機械	21,000	271	5,691,000
今仙電機製作所	5,800	861	4,993,800
本田技研	682,500	2,247	1,533,577,500
スズキ	169,000	1,558	263,302,000
富士重工業	257,000	447	114,879,000
ヤマハ発動機	132,200	969	128,101,800
ショーワ	20,200	415	8,383,000
小糸製作所	40,000	1,027	41,080,000
T B K	13,000	354	4,602,000
エクセディ	11,200	2,118	23,721,600
ミツバ	16,000	556	8,896,000
豊田合成	23,300	1,190	27,727,000
愛三工業	10,100	587	5,928,700
ヨ ロ ズ	4,700	1,638	7,698,600
エフ・シー・シー	13,100	1,487	19,479,700
新家工業	31,000	118	3,658,000
シマノ	30,000	3,590	107,700,000
タカタ	14,700	1,485	21,829,500
テイ・エス テック	17,300	1,087	18,805,100
小野建	5,900	607	3,581,300
佐鳥電機	5,100	455	2,320,500
カップクリエイト	6,350	1,800	11,430,000
伯東	3,100	727	2,253,700
ナガイレーベン	10,500	976	10,248,000
三菱食品	8,100	2,053	16,629,300
良品計画	8,800	3,600	31,680,000
三城ホールディングス	13,400	591	7,919,400
松田産業	7,000	1,160	8,120,000
メディパルHD	87,300	785	68,530,500
アズワン	5,000	1,544	7,720,000
シモジマ	7,500	979	7,342,500
ドウシシャ	4,000	2,145	8,580,000
コジマ	10,200	508	5,181,600
コーナン商事	7,800	1,230	9,594,000



黒田電気	9,100	798	7,261,800
ネットワンシステムズ	181	188,800	34,172,800
ワタミ	9,700	1,820	17,654,000
ドン・キホーテ	15,500	2,620	40,610,000
メガネトップ	12,500	840	10,500,000
西松屋チェーン	19,100	569	10,867,900
ゼンショーホールディングス	30,000	1,017	30,510,000
幸楽苑	6,000	1,180	7,080,000
サイゼリヤ	12,200	1,253	15,286,600
ガリバーインターナショナル	2,720	3,010	8,187,200
ユナイテッドアローズ	8,900	1,473	13,109,700
ハイデイ日高	3,800	1,215	4,617,000
シークス	5,000	975	4,875,000
京都きもの友禅	5,200	890	4,628,000
コロワイド	28,000	523	14,644,000
田中商事	5,200	401	2,085,200
壱番屋	3,300	2,257	7,448,100
マクニカ	3,700	1,629	6,027,300
トップカルチャー	6,300	358	2,255,400
スギホールディングス	14,100	2,250	31,725,000
島津製作所	96,000	628	60,288,000
J M S	16,000	238	3,808,000
ブイ・テクノロジー	15	328,000	4,920,000
スター精密	14,300	694	9,924,200
東京計器	41,000	148	6,068,000
日本電産トーソク	4,700	848	3,985,600
東京精密	14,800	1,469	21,741,200
ニコン	140,200	1,671	234,274,200
トプコン	21,500	356	7,654,000
オリンパス	95,000	915	86,925,000
理研計器	7,500	546	4,095,000
大日本スクリーン	78,000	589	45,942,000
キャノン電子	7,300	1,948	14,220,400
タムロン	7,400	1,893	14,008,200
HOYA	195,700	1,599	312,924,300
エー・アンド・デイ	11,600	262	3,039,200
キャノン	501,700	3,395	1,703,271,500
リコー	245,000	650	159,250,000
日本電産コパル	8,600	846	7,275,600
日本電産サンキョー	20,000	483	9,660,000
シチズンホールディングス	101,000	430	43,430,000
リズム時計	56,000	140	7,840,000
パラマウントベッドHD	6,600	2,059	13,589,400
SHOBI	5,200	449	2,334,800
SRIスポーツ	4,900	846	4,145,400
バンダイナムコHLDGS	86,100	1,079	92,901,900
フランスベッドHLDGS	75,000	125	9,375,000
パイロットコーポレーション	72	155,500	11,196,000
エイベックス・グループHD	15,900	947	15,057,300
トッパン・フォームズ	18,100	566	10,244,600
フジシールインターナショナル	9,600	1,271	12,201,600
タカラトミー	26,500	535	14,177,500
廣済堂	14,100	197	2,777,700
レック	3,200	1,100	3,520,000
プロネクサス	13,500	382	5,157,000

大建工業	38,000	225	8,550,000
きもと	8,400	512	4,300,800
凸版印刷	246,000	553	136,038,000
大日本印刷	246,000	738	181,548,000
共同印刷	37,000	179	6,623,000
日本写真印刷	16,900	958	16,190,200
藤森工業	6,700	1,065	7,135,500
宝印刷	7,600	559	4,248,400
前澤化成工業	7,900	773	6,106,700
アシックス	75,700	854	64,647,800
ツツミ	4,700	1,800	8,460,000
ジェイエスピー	5,600	1,064	5,958,400
ニチハ	10,000	800	8,000,000
ローランド	11,900	669	7,961,100
エフピコ	3,700	5,170	19,129,000
小松ウオール工業	5,200	797	4,144,400
ヤマハ	61,900	697	43,144,300
河合楽器	39,000	140	5,460,000
クリナップ	12,700	464	5,892,800
ピジョン	7,400	2,966	21,948,400
天馬	10,100	709	7,160,900
兼松日産農林	26,000	148	3,848,000
リンテック	15,800	1,367	21,598,600
信越ポリマー	17,700	323	5,717,100
東リ	32,000	137	4,384,000
イトーキ	32,300	168	5,426,400
任天堂	46,300	10,590	490,317,000
三菱鉛筆	7,300	1,364	9,957,200
タカラスタンダード	38,000	561	21,318,000
コクヨ	43,200	543	23,457,600
ナカバヤシ	32,000	191	6,112,000
ニフコ	18,500	2,067	38,239,500
グローブライド	69,000	90	6,210,000
岡村製作所	30,000	527	15,810,000
日本バルカー	34,000	194	6,596,000
伊藤忠	634,400	767	486,584,800
丸紅	701,000	462	323,862,000
スクロール	15,100	274	4,137,400
高島	23,000	192	4,416,000
F & A アクアホールディングス	8,400	739	6,207,600
三陽商会	60,000	192	11,520,000
長瀬産業	42,700	815	34,800,500
蝶理	46,000	85	3,910,000
豊田通商	88,600	1,312	116,243,200
オンワードホールディングス	53,000	534	28,302,000
三共生興	17,700	252	4,460,400
兼松	166,000	70	11,620,000
美津濃	42,000	378	15,876,000
ファミリーマート	24,200	3,035	73,447,000
三井物産	687,600	1,160	797,616,000
日本紙パルプ	35,000	271	9,485,000
東京エレクトロン	68,400	3,835	262,314,000
日立ハイテクノロジーズ	24,300	1,571	38,175,300
カメイ	13,000	729	9,477,000
東都水産	32,000	134	4,288,000

スターゼン	29,000	227	6,583,000
セイコーHD	55,000	168	9,240,000
山 善	31,000	540	16,740,000
住友商事	468,200	1,013	474,286,600
日本ユニシス	23,800	492	11,709,600
内田洋行	29,000	207	6,003,000
三菱商事	580,900	1,520	882,968,000
第一実業	22,000	310	6,820,000
キャノンマーケティングJPN	27,200	882	23,990,400
西華産業	28,000	210	5,880,000
菱洋エレクトロ	7,900	840	6,636,000
ユアサ商事	85,000	111	9,435,000
神鋼商事	20,000	176	3,520,000
阪和興業	80,000	327	26,160,000
カナデン	10,000	515	5,150,000
菱電商事	13,000	431	5,603,000
ニプロ	32,200	629	20,253,800
岩谷産業	86,000	252	21,672,000
すてきナイスグループ	43,000	154	6,622,000
昭光通商	56,000	127	7,112,000
極東貿易	20,000	209	4,180,000
イワキ	12,000	195	2,340,000
兼松エレクトロニクス	3,300	778	2,567,400
三愛石油	18,000	318	5,724,000
稲畑産業	21,000	452	9,492,000
ゴールドウイン	21,000	288	6,048,000
ユニ・チャーム	45,900	3,695	169,600,500
デザート	23,000	402	9,246,000
ヤマトインタ・ナショナル	6,600	352	2,323,200
東邦ホールディングス	27,100	1,019	27,614,900
サンゲツ	14,200	1,936	27,491,200
ミツウロコグループ	16,500	428	7,062,000
シナネン	18,000	340	6,120,000
伊藤忠エネクス	23,900	425	10,157,500
サンリオ	20,200	3,735	75,447,000
リョーサン	12,200	1,595	19,459,000
新光商事	8,000	598	4,784,000
トーヨー	13,000	303	3,939,000
三信電気	10,200	590	6,018,000
東陽テクニカ	11,000	765	8,415,000
モスフード サービス	10,200	1,509	15,391,800
加賀電子	7,200	793	5,709,600
三益半導体	8,400	625	5,250,000
木曽路	10,300	1,443	14,862,900
千 趣 会	14,800	517	7,651,600
ケーヨー	16,000	470	7,520,000
アデランス	13,500	936	12,636,000
上新電機	15,000	841	12,615,000
日本瓦斯	12,300	1,120	13,776,000
マルエツ	22,000	281	6,182,000
ロイヤルホールディングス	13,900	920	12,788,000
島 忠	17,800	1,730	30,794,000
チヨダ	10,900	1,307	14,246,300
ライフコーポレーション	6,200	1,399	8,673,800
カ ス ミ	17,700	485	8,584,500

リンガーハット	8,000	1,038	8,304,000
MR MAX	15,600	304	4,742,400
AOKIホールディングス	8,200	1,166	9,561,200
オークワ	13,000	1,194	15,522,000
コメリ	11,200	2,276	25,491,200
青山商事	22,300	1,342	29,926,600
しまむら	9,300	7,440	69,192,000
CFSコーポレーション	11,500	333	3,829,500
高島屋	113,000	574	64,862,000
松屋	21,300	442	9,414,600
エイチ・ツー・オーリテイリング	43,000	599	25,757,000
ニッセンHD	16,500	354	5,841,000
パルコ	16,900	574	9,700,600
丸井グループ	109,300	570	62,301,000
クレディセゾン	67,100	1,517	101,790,700
原信ナルスHLDGS	4,900	1,250	6,125,000
ダイエー	57,350	278	15,943,300
イズミヤ	33,000	408	13,464,000
イオン	280,900	1,055	296,349,500
ユニー	62,500	681	42,562,500
イズミ	23,800	1,255	29,869,000
東武ストア	17,000	258	4,386,000
平和堂	14,600	951	13,884,600
フジ	8,800	1,811	15,936,800
ヤオコー	3,500	2,593	9,075,500
ゼビオ	9,900	1,770	17,523,000
ケーズホールディングス	19,900	3,020	60,098,000
Paltac	6,800	1,453	9,880,400
新生銀行	648,000	77	49,896,000
あおぞら銀行	251,000	208	52,208,000
三菱UFJフィナンシャルG	6,036,200	325	1,961,765,000
りそなホールディングス	697,600	339	236,486,400
三井住友トラストHD	1,567,000	228	357,276,000
三井住友フィナンシャルG	603,300	2,160	1,303,128,000
第四銀行	102,000	245	24,990,000
北越銀行	84,000	151	12,684,000
西日本シティ銀行	272,000	217	59,024,000
札幌北洋ホール	122,500	273	33,442,500
千葉銀行	315,000	496	156,240,000
横浜銀行	512,000	367	187,904,000
常陽銀行	305,000	333	101,565,000
群馬銀行	180,000	414	74,520,000
武蔵野銀行	12,400	2,543	31,533,200
千葉興業銀行	15,200	401	6,095,200
筑波銀行	39,500	267	10,546,500
東京都民銀行	16,900	896	15,142,400
七十七銀行	132,000	330	43,560,000
青森銀行	61,000	229	13,969,000
秋田銀行	62,000	217	13,454,000
山形銀行	52,000	367	19,084,000
岩手銀行	5,700	3,225	18,382,500
東邦銀行	74,000	217	16,058,000
東北銀行	67,000	118	7,906,000
みちのく銀行	49,000	141	6,909,000
ふくおかフィナンシャルG	324,000	330	106,920,000

静岡銀行	240,000	797	191,280,000
十六銀行	104,000	246	25,584,000
スルガ銀行	78,000	690	53,820,000
八十二銀行	143,000	447	63,921,000
山梨中央銀行	52,000	312	16,224,000
大垣共立銀行	101,000	247	24,947,000
福井銀行	70,000	234	16,380,000
北國銀行	93,000	265	24,645,000
清水銀行	3,200	2,865	9,168,000
滋賀銀行	77,000	515	39,655,000
南都銀行	76,000	420	31,920,000
百五銀行	71,000	305	21,655,000
京都銀行	142,000	665	94,430,000
三重銀行	35,000	172	6,020,000
ほくほくフィナンシャルG	547,000	148	80,956,000
広島銀行	230,000	360	82,800,000
山陰合同銀行	46,000	569	26,174,000
中国銀行	63,000	1,049	66,087,000
鳥取銀行	29,000	148	4,292,000
伊予銀行	81,000	757	61,317,000
百十四銀行	91,000	345	31,395,000
四国銀行	60,000	281	16,860,000
阿波銀行	70,000	520	36,400,000
鹿児島銀行	49,000	532	26,068,000
大分銀行	54,000	222	11,988,000
宮崎銀行	54,000	192	10,368,000
肥後銀行	59,000	447	26,373,000
佐賀銀行	54,000	192	10,368,000
十八銀行	55,000	190	10,450,000
沖縄銀行	5,900	3,360	19,824,000
琉球銀行	15,800	947	14,962,600
八千代銀行	4,500	1,886	8,487,000
みずほフィナンシャルG	10,220,800	104	1,062,963,200
紀陽ホールディングス	301,000	117	35,217,000
山口フィナンシャルG	79,000	726	57,354,000
芙蓉総合リース	7,700	2,632	20,266,400
興銀リース	11,900	1,660	19,754,000
東京センチュリーリース	21,500	1,446	31,089,000
SBIホールディングス	8,792	5,650	49,674,800
日本証券金融	38,000	342	12,996,000
長野銀行	37,000	153	5,661,000
名古屋銀行	78,000	237	18,486,000
愛知銀行	3,200	4,305	13,776,000
第三銀行	60,000	159	9,540,000
中京銀行	44,000	197	8,668,000
東日本銀行	29,000	160	4,640,000
大光銀行	31,000	243	7,533,000
愛媛銀行	48,000	223	10,704,000
トマト銀行	46,000	126	5,796,000
みなと銀行	74,000	145	10,730,000
京葉銀行	61,000	379	23,119,000
関西アーバン銀行	117,000	126	14,742,000
栃木銀行	41,000	277	11,357,000
北日本銀行	3,900	1,829	7,133,100
東和銀行	72,000	92	6,624,000

福島銀行	135,000	41	5,535,000
リコーリース	6,300	1,672	10,533,600
イオン クレジットサービス	37,200	1,183	44,007,600
アコム	17,470	1,375	24,021,250
ジャックス	52,000	240	12,480,000
オリコ	131,000	70	9,170,000
日立キャピタル	16,900	1,045	17,660,500
オリックス	41,750	6,310	263,442,500
三菱UFJリース	20,660	2,897	59,852,020
ジャフコ	11,400	1,256	14,318,400
トモニホールディングス	61,500	324	19,926,000
大和証券G本社	798,000	240	191,520,000
野村ホールディングス	1,735,200	245	425,124,000
岡三証券グループ	67,000	232	15,544,000
丸三証券	32,600	226	7,367,600
東洋証券	39,000	103	4,017,000
東海東京HD	90,000	210	18,900,000
水戸証券	47,000	95	4,465,000
いちよし証券	21,200	347	7,356,400
松井証券	53,100	375	19,912,500
NKSJホールディングス	168,000	1,482	248,976,000
マネックスG	850	11,870	10,089,500
カブドットコム証券	39,100	226	8,836,600
極東証券	10,000	400	4,000,000
岩井コスモホールディング	15,600	232	3,619,200
フィデアホール	53,300	194	10,340,200
池田泉州HD	320,800	112	35,929,600
MS&AD	238,700	1,415	337,760,500
SONY FH	77,500	1,138	88,195,000
第一生命	4,291	77,300	331,694,300
東京海上HD	303,000	1,739	526,917,000
T&Dホールディングス	293,900	713	209,550,700
三井不動産	355,000	1,132	401,860,000
三菱地所	559,000	1,197	669,123,000
平和不動産	93,500	156	14,586,000
東京建物	162,000	233	37,746,000
ダイビル	25,400	474	12,039,600
サンケイビル	18,800	300	5,640,000
東急不動産	166,000	292	48,472,000
京阪神ビルディング	8,900	333	2,963,700
住友不動産	192,000	1,390	266,880,000
東宝不動産	13,200	393	5,187,600
大京	129,000	150	19,350,000
テーオーシー	32,200	342	11,012,400
レオパレス21	70,900	154	10,918,600
空港施設	14,600	301	4,394,600
住友不動産販売	3,100	2,995	9,284,500
ゴールドクレスト	8,050	1,178	9,482,900
東栄住宅	6,000	751	4,506,000
東急リバブル	9,400	597	5,611,800
飯田産業	9,000	574	5,166,000
アーネストワン	13,100	786	10,296,600
タカラレーベン	12,000	462	5,544,000
イオンモール	36,300	1,665	60,439,500
タクトホーム	38	61,700	2,344,600

エヌ・ティ・ティ都市開発	531	51,200	27,187,200
東武鉄道	468,000	381	178,308,000
相鉄ホールディングス	133,000	234	31,122,000
東京急行	474,000	378	179,172,000
京浜急行	210,000	678	142,380,000
小田急電鉄	262,000	729	190,998,000
京王電鉄	231,000	534	123,354,000
京成電鉄	136,000	563	76,568,000
富士急行	25,000	442	11,050,000
東日本旅客鉄道	140,500	4,835	679,317,500
西日本旅客鉄道	70,600	3,270	230,862,000
東海旅客鉄道	701	643,000	450,743,000
西日本鉄道	101,000	373	37,673,000
近畿鉄道	725,000	296	214,600,000
阪急阪神HLDGS	540,000	319	172,260,000
南海電鉄	166,000	330	54,780,000
京阪電鉄	178,000	365	64,970,000
名古屋鉄道	278,000	200	55,600,000
日本通運	319,000	290	92,510,000
ヤマトホールディングス	163,800	1,252	205,077,600
山九	96,000	276	26,496,000
日新	31,000	177	5,487,000
丸全昭和運輸	30,000	242	7,260,000
センコー	33,000	303	9,999,000
日本梱包運輸	25,700	765	19,660,500
福山通運	47,000	448	21,056,000
セイノーホールディングス	62,000	555	34,410,000
神奈川中央交通	15,000	414	6,210,000
日立物流	16,400	1,276	20,926,400
日本郵船	652,000	187	121,924,000
商船三井	432,000	272	117,504,000
川崎汽船	273,000	132	36,036,000
NSユニテッド海運	60,000	112	6,720,000
乾汽船	13,800	265	3,657,000
飯野海運	43,200	334	14,428,800
第一中央汽船	72,000	100	7,200,000
全日本空輸	1,091,000	220	240,020,000
国際航業HLDGS	14,000	200	2,800,000
三菱倉庫	60,000	818	49,080,000
三井倉庫	41,000	274	11,234,000
住友倉庫	59,000	354	20,886,000
渋沢倉庫	24,000	210	5,040,000
ヤマタネ	58,000	109	6,322,000
東陽倉庫	18,000	165	2,970,000
日本トランスシティ	20,000	249	4,980,000
安田倉庫	8,100	457	3,701,700
東洋埠頭	37,000	119	4,403,000
上組	88,000	648	57,024,000
郵船ロジスティクス	7,100	956	6,787,600
近鉄エクスプレス	7,300	2,270	16,571,000
東京放送HD	48,200	946	45,597,200
日本テレビ放送網	6,860	11,260	77,243,600
テレビ朝日	195	122,300	23,848,500
スカパーJSA THD	626	38,050	23,819,300
テレビ東京HD	6,400	994	6,361,600

アイ・ティー・シーネットワーク	10,700	480	5,136,000
イー・アクセス	716	17,690	12,666,040
NECモバイルリング	2,300	2,437	5,605,100
日本電信電話	367,000	3,860	1,416,620,000
KDDI	1,244	486,000	604,584,000
光通信	7,300	1,902	13,884,600
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,572	136,100	894,449,200
GMOインターネット	28,100	289	8,120,900
ゼンリン	13,000	661	8,593,000
昭文社	5,700	580	3,306,000
角川グループHLDGS	7,500	2,661	19,957,500
中部電力	271,300	1,434	389,044,200
関西電力	335,900	1,148	385,613,200
中国電力	118,800	1,320	156,816,000
北陸電力	86,900	1,402	121,833,800
東北電力	210,700	753	158,657,100
四国電力	77,900	2,117	164,914,300
九州電力	187,800	1,080	202,824,000
北海道電力	86,300	1,088	93,894,400
沖縄電力	7,400	3,330	24,642,000
電源開発	54,000	1,956	105,624,000
東京瓦斯	1,014,000	351	355,914,000
大阪瓦斯	824,000	304	250,496,000
東邦瓦斯	222,000	484	107,448,000
北海道瓦斯	39,000	261	10,179,000
西部瓦斯	145,000	205	29,725,000
静岡瓦斯	32,000	501	16,032,000
松竹	54,000	722	38,988,000
東宝	57,500	1,341	77,107,500
エイチ・アイ・エス	9,200	1,999	18,390,800
東映	36,000	344	12,384,000
NTTデータ	495	241,800	119,691,000
共立メンテナンス	4,700	1,377	6,471,900
建設技術研究所	6,800	530	3,604,000
アインファーマシーズ	4,400	3,515	15,466,000
東京テアトル	59,000	103	6,077,000
よみうりランド	23,000	239	5,497,000
東京都競馬	82,000	105	8,610,000
常磐興産	55,000	81	4,455,000
カナモト	12,000	554	6,648,000
東京ドーム	82,000	180	14,760,000
DTS	9,600	868	8,332,800
スクウェア・エニックス・HD	27,800	1,532	42,589,600
カプコン	15,600	1,799	28,064,400
日本空港ビルデング	26,300	979	25,747,700
トランス・コスモス	11,100	906	10,056,600
乃村工藝社	21,000	223	4,683,000
SCSK	17,400	1,221	21,245,400
藤田観光	34,000	256	8,704,000
日本管財	3,200	1,381	4,419,200
トーカイ	3,500	1,647	5,764,500
セコム	81,700	3,455	282,273,500
アイネス	13,200	515	6,798,000
丹青社	14,000	197	2,758,000
メイテック	13,800	1,423	19,637,400



TKC	7,000	1,551	10,857,000
アサツー ディ・ケイ	15,100	2,015	30,426,500
富士ソフト	11,900	1,312	15,612,800
応用地質	9,900	865	8,563,500
船井総合研究所	7,900	540	4,266,000
NSD	19,500	598	11,661,000
コナミ	36,500	2,274	83,001,000
ベネッセホールディングス	25,600	3,565	91,264,000
イオンディライト	9,900	1,545	15,295,500
ニチイ学館	18,100	886	16,036,600
ダイセキ	13,900	1,322	18,375,800
元気寿司	4,700	933	4,385,100
トラスコ中山	10,200	1,387	14,147,400
ヤマダ電機	38,750	5,440	210,800,000
オートバックスセブン	9,000	3,530	31,770,000
アークランドサカモト	5,700	1,445	8,236,500
ニトリホールディングス	15,650	7,030	110,019,500
愛眼	13,100	345	4,519,500
吉野家ホールディングス	211	103,800	21,901,800
加藤産業	12,100	1,464	17,714,400
イエローハット	7,500	1,229	9,217,500
富士エレクトロニクス	4,100	1,038	4,255,800
JBC Cホールディングス	9,300	515	4,789,500
サガミチェーン	13,000	521	6,773,000
日伝	3,100	2,617	8,112,700
因幡電機産業	8,500	2,144	18,224,000
住金物産	33,000	181	5,973,000
プレナス	9,200	1,241	11,417,200
ミニストップ	5,400	1,401	7,565,400
アークス	11,000	1,412	15,532,000
バロー	16,200	1,151	18,646,200
ミスミグループ本社	29,600	1,674	49,550,400
ベルク	3,900	1,114	4,344,600
大庄	6,500	976	6,344,000
タキヒヨー	14,000	416	5,824,000
ファーストリテイリング	18,700	13,250	247,775,000
ソフトバンク	362,700	2,310	837,837,000
スズケン	31,000	2,058	63,798,000
サンドラッグ	15,000	2,289	34,335,000
ベルーナ	10,800	573	6,188,400
合計	123,238,820		79,045,150,660

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

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

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

「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22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	108,215,328	243,926,774
コール・ローン	96,508,522	123,472,335
株式	46,077,552,880	41,136,751,524
投資証券	698,292,991	763,792,723
派生商品評価勘定	1,132,978	-
未収入金	87,324,755	2,230,434
未収配当金	71,757,785	88,923,834
差入委託証拠金	297,528,516	293,608,652
流動資産合計	47,438,313,755	42,652,706,276
資産合計	47,438,313,755	42,652,706,276
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	22,146,049
未払金	-	34,987,580
未払解約金	71,204,000	5,200,000
流動負債合計	71,204,000	62,333,629
負債合計	71,204,000	62,333,629
純資産の部		
元本等		
元本	1 51,935,045,476	53,616,195,771
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 4,567,935,721	11,025,823,124
元本等合計	47,367,109,755	42,590,372,647
純資産合計	47,367,109,755	42,590,372,647
負債純資産合計	47,438,313,755	42,652,706,276

## 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21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式及び新株予約権証券  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、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。  (2) 投資証券	(1) 株式及び新株予約権証券  同左  (2) 投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	同左
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	(1)先物取引  同左
	(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	(2)為替予約取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。	受取配当金 同左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準	外貨建取引等の処理基準

	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。	同左
--	---	----

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	53,003,580,601円	51,935,045,476円
同期中における追加設定元本額	6,903,669,170円	7,979,337,291円
同期中における一部解約元本額	7,972,204,295円	6,298,186,996円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスV A	1,951,307,322円	1,939,789,425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)	106,451,372円	104,533,081円
ダイワ国内重視バランスファンド 50 V A (一般投資家私募)	1,521,552,523円	1,411,957,538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)	212,021,267円	195,834,213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)	4,838,797,589円	4,661,298,341円
DCダイワ外国株式インデックス ダイワ・ライフ・バランス30	13,232,762,133円	15,968,028,450円
ダイワ・ライフ・バランス50	485,373,123円	621,697,754円
ダイワ・ライフ・バランス70	78,700,039円	344,430,292円
ダイワ・ライフ・バランス70	54,972,137円	217,399,756円
大和DC海外株式インデックス ファンド	1,407,778,990円	1,575,006,024円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	5,211,807円	6,577,928円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	4,352,480円	5,332,261円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	327,669円	510,144円
ダイワ世界分散バランスファンド 15 V A	128,427,020円	123,847,179円
ダイワ世界分散バランスファンド 20 V A	1,840,222,919円	1,859,829,310円
ダイワ世界分散バランスファンド 25 V A	42,989,680円	41,866,940円

ダイワ世界分散バランスファンド 30VA	429,636,353円	415,146,585円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	6,516,884,341円	6,393,548,567円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	1,600,953,620円	1,560,652,613円
ダイワ・バランスファンド35V A	14,008,798,910円	12,410,007,067円
ダイワ・バランスファンド25V A(適格機関投資家専用)	676,137,540円	632,371,434円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	2,648,806,031円	2,966,271,831円
ダイワライフスタイル25	22,874,047円	26,318,532円
ダイワライフスタイル50	65,194,736円	75,960,384円
ダイワライフスタイル75	54,511,828円	57,980,122円
計	51,935,045,476円	53,616,195,771円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	51,935,045,476口	53,616,195,771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4,567,935,721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11,025,823,124円であり ます。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年12月19日 至平成22年12月20日	自平成22年12月21日 至平成23年12月19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。	同左
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。	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、配当金等の受取りま たは支払いを目的として、投資 信託約款に従って為替予約取引 を利用しております。

3. 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。	同左
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。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19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。	同左
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。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

## (追加情報)

自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間（平成21年12月19日から平成22年12月20日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
--	---------------	---------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	2,008,749,876	479,246,792
投資証券	4,096,194	19,535,725
合計	2,012,846,070	498,782,517

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年12月1日から平成22年12月20日まで、及び平成23年12月1日から平成23年12月19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22年12月20日 現在				平成23年12月19日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買 建	571,552,718	-	572,685,696	1,132,978	658,689,570	-	636,558,021	22,131,549
合計	571,552,718	-	572,685,696	1,132,978	658,689,570	-	636,558,021	22,131,549

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種 類	平成22年12月20日 現在				平成23年12月19日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	-	-	-	-	33,515,500	-	33,501,000	14,500
アメリカ・ドル	-	-	-	-	23,364,600	-	23,361,000	3,600
ユーロ	-	-	-	-	10,150,900	-	10,140,000	10,900
合計	-	-	-	-	33,515,500	-	33,501,000	14,500

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9120円 (9,120円)	0.7944円 (7,944円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	FIRST SOLAR INC	1,500	31.910	47,865.000	
	AVON PRODUCTS	11,900	16.720	198,968.000	
	ABBOTT LABS	41,300	54.890	2,266,957.000	
	ALCOA	30,200	8.810	266,062.000	
	VERISK ANALYTICS INC-CL A	3,400	39.400	133,960.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	9,500	41.530	394,535.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	4,800	41.620	199,776.000	
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	6,629	25.420	168,509.180	
	AFLAC INC	12,800	40.910	523,648.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,900	43.680	170,352.000	
	HANSEN NATURAL CORPORATIO	2,200	95.890	210,958.000	
	ADOBE SYSTEMS	13,200	28.200	372,240.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,900	129.890	246,791.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,800	45.260	126,728.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,400	12.420	129,168.000	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,800	54.290	97,722.000	
	GARMIN LTD	3,200	38.000	121,600.000	
	AETNA INC	10,300	40.390	416,017.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	5,600	82.540	462,224.000	
	ALTERA CORPORATION	8,800	34.090	299,992.000	
	BEAM INC	3,600	49.150	176,940.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL	19,600	53.100	1,040,760.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,251	19.210	81,661.710		
WR BERKLEY CORP	3,100	33.130	102,703.000		
AUTOZONE INC	700	326.000	228,200.000		
DOLLAR TREE INC	3,350	82.820	277,447.000		
PINNACLE WEST CAPITAL	3,200	46.630	149,216.000		



ALLEGHENY TECHNOLOGIES	2,600	44.710	116,246.000
CELANESE CORP-SERIES A	4,200	42.150	177,030.000
D.R.HORTON INC	8,766	12.000	105,192.000
DENTSPLY INTERNATIONAL IN	3,800	34.660	131,708.000
AUTODESK INC	6,100	31.200	190,320.000
MOODY'S CORP	5,500	32.600	179,300.000
DEVON ENERGY CORPORATION	10,900	60.450	658,905.000
CONSOL ENERGY INC	6,100	36.320	221,552.000
ALLIANT ENERGY CORP	3,200	41.960	134,272.000
CITIGROUP INC	76,923	26.030	2,002,305.690
AUTOMATIC DATA PROCESSING	13,000	51.730	672,490.000
AMERICAN ELEC POWER	13,000	39.660	515,580.000
DUN&BRADSTREET CORP	1,400	70.770	99,078.000
HESS CORP	8,500	54.310	461,635.000
COVIDIEN PLC	13,325	43.340	577,505.500
DAVITA INC	2,500	74.150	185,375.000
DANAHER CORP	15,300	46.370	709,461.000
AVNET INC	4,600	29.080	133,768.000
INTERCONTINENTALEXCHANGE	1,900	117.680	223,592.000
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	18,700	27.700	517,990.000
PEABODY ENERGY CORP	7,400	32.980	244,052.000
BUNGE LIMITED	4,200	56.610	237,762.000
TE CONNECTIVITY LTD	11,225	30.450	341,801.250
APPLE INC	25,000	381.020	9,525,500.000
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	15,200	24.230	368,296.000
BOEING CO	18,500	71.010	1,313,685.000
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,415	29.980	132,361.700
MEADWESTVACO CORP	4,800	28.790	138,192.000
SPECTRA ENERGY CORP	17,696	29.410	520,439.360
BECTON DICKINSON & CO	5,900	70.650	416,835.000
SAIC INC	8,600	12.170	104,662.000
NISOURCE INC	7,600	22.530	171,228.000
JOY GLOBAL INC	2,800	75.170	210,476.000
BMC SOFTWARE INC	4,800	33.170	159,216.000
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	4,400	66.590	292,996.000
ALPHA NATURAL RESOURCES I	6,000	19.620	117,720.000
BARD(C.R.) INC	2,300	86.160	198,168.000
BANK OF NEW YORK MELLON	33,171	19.120	634,229.520
VERIZON COMMUNICATIONS	75,100	38.780	2,912,378.000
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	24,500	75.130	1,840,685.000
H&R BLOCK INC	8,800	15.360	135,168.000
BB&T CORPORATION	19,200	24.050	461,760.000
HOSPIRA INC	4,520	28.920	130,718.400
BROADCOM CORP-CL A	12,450	28.720	357,564.000
BAKER HUGHES INC	11,623	45.930	533,844.390
BRISTOL MYERS SQUIBB	45,100	34.220	1,543,322.000
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,900	74.230	141,037.000
FIDELITY NATIONAL FINL-A	7,138	15.420	110,067.960
JPMORGAN CHASE & CO	104,220	31.890	3,323,575.800
LEGG MASON INC	3,850	23.510	90,513.500
T ROWE PRICE GROUP INC	6,900	54.280	374,532.000
CIGNA CORP	8,000	42.380	339,040.000
COMPUTER SCIENCES CORP	4,200	25.930	108,906.000
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,600	72.310	115,696.000
FRONTIER COMMUNICATIONS	26,442	4.920	130,094.640
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,200	77.730	171,006.000
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,760	46.550	314,678.000

DOLLAR GENERAL CORP	4,800	41.020	196,896.000
CATERPILLAR INC DEL	17,000	87.200	1,482,400.000
GENWORTH FINANCIAL INC-A	12,900	6.260	80,754.000
VIRGIN MEDIA INC	8,600	20.950	180,170.000
HERBALIFE LTD	3,000	51.660	154,980.000
MOSAIC CO/THE	8,600	48.120	413,832.000
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,600	72.920	408,352.000
CORNING INC	40,800	13.080	533,664.000
CISCO SYSTEMS	150,500	17.940	2,699,970.000
DU PONT	24,800	43.980	1,090,704.000
MORGAN STANLEY	39,700	14.980	594,706.000
DOW CHEMICAL	30,800	26.360	811,888.000
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,200	28.800	178,560.000
DELL INC	44,800	15.030	673,344.000
DTE ENERGY COMPANY	4,600	51.440	236,624.000
DEVRY INC	1,800	34.100	61,380.000
AGCO CORP	2,800	40.310	112,868.000
DOMINION RESOURCES INC/VA	15,300	50.650	774,945.000
DENBURY RESOURCES INC	10,500	14.940	156,870.000
DEERE & CO	11,200	73.650	824,880.000
AIRGAS INC	2,100	76.560	160,776.000
WALTER ENERGY INC	1,700	62.810	106,777.000
QUANTA SERVICES INC	6,400	20.910	133,824.000
TIME WARNER INC	28,233	34.590	976,579.470
VMWARE INC-CLASS A	2,500	85.820	214,550.000
URBAN OUTFITTERS INC	3,700	26.580	98,346.000
NASDAQ STOCK MARKET INC	3,900	24.030	93,717.000
CONSOLIDATED EDISON INC	7,600	59.780	454,328.000
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,900	44.460	128,934.000
NYSE EURONEXT	6,900	26.230	180,987.000
COLGATE PALMOLIVE CO	13,100	89.890	1,177,559.000
AMETEK INC	4,350	40.560	176,436.000
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,000	44.810	179,240.000
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,000	32.050	256,400.000
COSTCO WHOLESALE CORP	11,500	82.570	949,555.000
SCANA CORP	3,500	42.780	149,730.000
GREEN MOUNTAIN COFFEE	3,400	45.260	153,884.000
CHIPOTLE MEXICAN GRILL IN	900	318.400	286,560.000
LEUCADIA NATIONAL CORP	5,800	22.040	127,832.000
CUMMINS INC	4,900	87.300	427,770.000
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,500	11.880	160,380.000
APOLLO GROUP INC-CL A	3,500	50.150	175,525.000
LORILLARD INC	3,700	108.030	399,711.000
PROGRESS ENERGY INC	7,500	53.710	402,825.000
SBA COMMUNICATIONS CORP-C	3,200	39.960	127,872.000
HCA HOLDINGS INC	5,100	21.570	110,007.000
CABOT OIL & GAS CORP	2,800	74.170	207,676.000
METROPCS COMMUNICATIONS	7,300	8.330	60,809.000
DOLBY LABORATORIES-A	1,500	31.400	47,100.000
ABERCROMBIE & FITCH -CL A	2,500	46.570	116,425.000
COCA COLA CO	54,700	67.440	3,688,968.000
COCA-COLA ENTERPRISES	8,800	25.780	226,864.000
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,700	40.370	230,109.000
EATON VANCE CORP	3,700	22.760	84,212.000
COOPER INDUSTRIES LTD-A	4,800	51.690	248,112.000
FMC TECHNOLOGIES INC	6,700	49.410	331,047.000
FRANKLIN RESOURCES INC	4,200	94.090	395,178.000

CSX CORP	29,400	20.410	600,054.000
FLUOR CORP	4,700	48.090	226,023.000
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,700	81.630	220,401.000
EXPEDIA INC	5,350	27.980	149,693.000
AUTOLIV INC	2,600	49.050	127,530.000
AMAZON.COM INC	10,000	181.260	1,812,600.000
FLOWSERVE CORP	1,500	97.540	146,310.000
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,200	67.390	215,648.000
EXXON MOBIL CORP	131,355	80.160	10,529,416.800
RALCORP HOLDINGS INC	1,600	85.210	136,336.000
FLIR SYSTEMS INC	4,500	25.180	113,310.000
AES CORP	17,900	11.500	205,850.000
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	3,000	64.450	193,350.000
EVEREST RE GROUP LTD	1,700	79.860	135,762.000
EOG RESOURCES INC	7,200	97.680	703,296.000
EQUITABLE RESOURCES INC	3,900	54.340	211,926.000
AKAMA I TECHNOLOGIES	5,600	26.650	149,240.000
AMERICAN TOWER CORP-CL A	10,300	59.140	609,142.000
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,100	36.750	260,925.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,090	33.460	304,151.400
FORD MOTOR CO	93,023	10.250	953,485.750
MACY'S INC	11,698	31.030	362,988.940
ARCH COAL INC	6,000	14.320	85,920.000
DISCOVERY COMMUNICATION-A	3,640	40.170	146,218.800
FOREST LABORATORIES INC	7,500	29.030	217,725.000
LIBERTY GLOBAL INC	3,735	39.580	147,831.300
DISCOVERY COMMUNICATION-C	3,240	36.450	118,098.000
WARNER CHILCOTT PLC-CL A	4,000	14.020	56,080.000
FOSSIL INC	1,500	80.940	121,410.000
NEXTERA ENERGY INC	10,700	57.870	619,209.000
FREEMPORT-MCMORAN COPPER	25,408	36.990	939,841.920
US BANCORP	51,500	26.000	1,339,000.000
FAMILY DOLLAR STORES	3,400	57.920	196,928.000
F5 NETWORKS INC	2,100	104.830	220,143.000
FASTENAL CO	7,400	41.420	306,508.000
FISERV INC	3,800	57.430	218,234.000
GENERAL ELECTRIC CO	281,700	17.010	4,791,717.000
GOODYEAR TIRE&RUBBER	7,100	13.580	96,418.000
GENERAL MOTORS CO	21,700	20.150	437,255.000
GENERAL DYNAMICS CORP	8,600	63.200	543,520.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,000	90.100	1,171,300.000
LIBERTY MEDIA CO-LIBER-A	3,100	75.550	234,205.000
GAMESTOP CORP-CLASS A	4,900	23.340	114,366.000
GOODRICH CORP	3,300	122.730	405,009.000
GOOGLE INC-CL A	6,900	625.960	4,319,124.000
GENERAL MILLS INC	17,300	39.720	687,156.000
FIRSTENERGY CORP	10,868	43.430	471,997.240
GENUINE PARTS CO	4,200	58.200	244,440.000
FIFTH THIRD BANCORP	25,800	12.070	311,406.000
HARRIS CORP	3,400	34.290	116,586.000
HALLIBURTON CO	24,500	31.760	778,120.000
HOME DEPOT INC	42,000	40.420	1,697,640.000
ASSURANT INC	3,300	39.410	130,053.000
HERSHEY CO/THE	4,800	59.400	285,120.000
HARLEY-DAVIDSON INC	6,200	36.690	227,478.000
HUMANA INC	4,600	84.750	389,850.000
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,100	45.420	231,642.000

HELMERICH & PAYNE	3,000	55.780	167,340.000
WINDSTREAM CORP	17,100	11.580	198,018.000
HENRY SCHEIN INC	2,600	62.440	162,344.000
HEWLETT-PACKARD CO	58,200	25.840	1,503,888.000
DIRECTV	20,782	42.100	874,922.200
HOLLYFRONTIER CORP	5,400	22.510	121,554.000
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,600	36.980	133,128.000
HEINZ H J CO	8,400	52.970	444,948.000
INT'L BUSINESS MACHINES	32,100	183.570	5,892,597.000
INTERNATIONAL PAPER	11,600	27.790	322,364.000
INGERSOLL-RAND CO-CL A	9,229	30.650	282,868.850
LEGGETT & PLATT INC	4,200	21.770	91,434.000
LIBERTY GLOBAL INC-C	2,935	38.360	112,586.600
JUNIPER NETWORKS INC	14,600	18.350	267,910.000
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3,100	76.760	237,956.000
JOHNSON & JOHNSON	74,200	64.300	4,771,060.000
HOLOGIC INC	7,100	16.790	119,209.000
KIMBERLY-CLARK CORP	10,500	71.280	748,440.000
KROGER CO	15,600	23.710	369,876.000
KLA-TENCOR CORPORATION	4,600	46.040	211,784.000
LOCKHEED MARTIN CORP	7,900	77.100	609,090.000
LIMITED BRANDS	7,200	38.400	276,480.000
LOWE'S COS INC	34,200	25.020	855,684.000
ELI LILLY & CO	27,700	40.530	1,122,681.000
LAM RESEARCH CORP	3,200	35.920	114,944.000
RANGE RESOURCES CORP	4,400	60.200	264,880.000
LSI CORP	17,000	5.420	92,140.000
LOEWS CORP	8,500	36.960	314,160.000
LINCOLN NATIONAL CORP	8,349	18.510	154,539.990
MCDONALD'S CORP	27,200	97.490	2,651,728.000
3M CO	17,900	78.870	1,411,773.000
MANPOWER INC	2,300	35.050	80,615.000
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	7,800	42.750	333,450.000
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,300	74.440	96,772.000
CONCHO RESOURCES INC	2,700	93.480	252,396.000
MURPHY OIL CORP	4,900	52.190	255,731.000
MATTEL INC	9,000	27.950	251,550.000
KBR INC	4,200	25.360	106,512.000
MCCORMICK & CO-NON VTG SH	3,600	48.760	175,536.000
MYLAN INC	12,400	20.880	258,912.000
METLIFE INC	27,700	30.230	837,371.000
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	14,500	13.520	196,040.000
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,028	46.160	370,572.480
MONSANTO CO	14,306	68.140	974,810.840
ROCKWELL INTL CORP	4,000	71.850	287,400.000
MERCK & CO INC	81,821	36.250	2,966,011.250
MASCO CORP	9,700	9.160	88,852.000
M & T BANK CORP	3,100	72.750	225,525.000
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	10,936	54.630	597,433.680
MARSH & MCLENNAN COS	14,100	30.420	428,922.000
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	7,782	28.560	222,253.920
NETAPP INC	10,200	35.710	364,242.000
NIKE INC -CL B	9,600	93.670	899,232.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,300	69.820	649,326.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,300	34.480	182,744.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,200	55.660	400,752.000
NEWMONT MINIG CORP	13,200	62.180	820,776.000

MCKESSON CORP	6,600	77.700	512,820.000
MOTOROLA MOBILITY HLGS	7,725	38.700	298,957.500
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,900	25.040	197,816.000
PHILIP MORRIS INTERNATION	47,100	75.600	3,560,760.000
NUCOR CORP	8,300	38.990	323,617.000
NABORS INDUSTRIES LTD	8,300	16.740	138,942.000
WESTERN UNION CO	16,746	17.780	297,743.880
NEWELL RUBBERMAID INC	7,500	14.990	112,425.000
OCCIDENTAL PETROLEUM	21,700	89.270	1,937,159.000
OMNICARE INC	3,200	33.800	108,160.000
PAYCHEX INC	9,300	29.590	275,187.000
J.C.PENNY CO INC(HLDG CO)	4,400	32.640	143,616.000
PATTERSON COS INC	2,900	28.550	82,795.000
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	79.880	303,544.000
ALTRIA GROUP INC	55,300	29.140	1,611,442.000
OWENS-ILLINOIS INC	4,600	18.290	84,134.000
PG & E CORPORATION	11,200	39.980	447,776.000
PFIZER INC	208,263	21.030	4,379,770.890
XCEL ENERGY INC	12,700	26.410	335,407.000
STRYKER CORP	7,600	46.210	351,196.000
PARKER HANNIFIN CORP	4,200	75.020	315,084.000
PALL CORP	3,100	56.600	175,460.000
PIONEER NATURAL RESOURCES	2,800	83.780	234,584.000
PROCTER & GAMBLE CO	74,137	65.140	4,829,284.180
EXELON CORP	17,700	42.840	758,268.000
ALEXION PHARMACEUTICALS	5,200	66.370	345,124.000
CONOCOPHILLIPS	35,600	68.400	2,435,040.000
PEPSICO INC	41,900	64.710	2,711,349.000
PLAINS EXPLORATION&PRODUC	4,300	32.960	141,728.000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,700	48.070	610,489.000
AMERICAN WATER WORKS CO	5,300	31.260	165,678.000
ACCENTURE LTD-CL A	17,200	54.150	931,380.000
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,200	30.910	98,912.000
PENTAIR INC	2,600	33.190	86,294.000
QUALCOMM INC	45,800	52.610	2,409,538.000
PARTNERRE LTD	1,800	62.000	111,600.000
INVESCO LTD	13,150	19.240	253,006.000
ADVANCE AUTO PARTS	2,050	68.000	139,400.000
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,700	23.540	204,798.000
MDU RESOURCES GROUP INC	5,200	20.840	108,368.000
ENERGEN CORP	2,000	48.640	97,280.000
RAYTHEON CO	9,700	45.510	441,447.000
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	2,800	41.790	117,012.000
RED HAT INC	5,200	47.640	247,728.000
REPUBLIC SERVICES INC	8,100	26.460	214,326.000
PRICELINE.COM INC	1,300	457.080	594,204.000
ROSS STORES INC	6,400	47.000	300,800.000
QEP RESOURCES INC	4,600	28.870	132,802.000
QUEST DIAGNOSTICS	4,400	56.240	247,456.000
ROBERT HALF INTL INC	3,700	27.110	100,307.000
REYNOLDS AMERICAN INC	9,700	40.660	394,402.000
RALPH LAUREN CORP	1,700	139.130	236,521.000
ROWAN COS INC	3,300	29.870	98,571.000
ROCKWELL COLLINS INC.	4,400	53.700	236,280.000
REGIONS FINANCIAL CORP	33,235	3.990	132,607.650
SUNOCO INC	3,200	39.120	125,184.000
CHEVRON CORP	54,218	100.860	5,468,427.480

EDISON INTERNATIONAL	8,600	39.300	337,980.000
SYMANTEC CORP	20,000	15.460	309,200.000
STANLEY BLACK & DECKER IN	4,522	63.100	285,338.200
SYNOPSIS INC	3,900	26.880	104,832.000
CBRE GROUP INC	8,500	15.040	127,840.000
SLM CORP	14,900	13.410	199,809.000
SANDISK CORP	6,200	47.910	297,042.000
SOUTHERN CO	22,600	44.550	1,006,830.000
SYSCO CORP	16,400	28.900	473,960.000
TRAVELERS COS INC	11,323	57.280	648,581.440
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,000	33.490	301,410.000
SPX CORP	1,400	57.540	80,556.000
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,100	16.370	67,117.000
STERICYCLE INC	2,200	76.510	168,322.000
SCHLUMBERGER LTD	35,967	66.910	2,406,551.970
AT&T INC	159,595	28.850	4,604,315.750
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,000	8.710	52,260.000
SIGMA-ALDRICH	3,300	63.150	208,395.000
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,500	84.640	211,600.000
SEMPRA ENERGY	6,000	52.840	317,040.000
TIFFANY & CO	3,300	62.610	206,613.000
SEAGATE TECHNOLOGY	12,300	15.430	189,789.000
TEXAS INSTRUMENTS INC	31,200	28.690	895,128.000
SALESFORCE.COM INC	3,500	107.060	374,710.000
TRW INC	3,000	30.300	90,900.000
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,000	56.680	113,360.000
TIME WARNER CABLE	9,053	62.210	563,187.130
TYCO INTERNATIONAL LTD	12,525	44.860	561,871.500
UNION PACIFIC CORP	13,100	99.880	1,308,428.000
MARATHON OIL CORP	19,500	27.380	533,910.000
MARATHON PETROLEUM CORP	9,900	31.960	316,404.000
UNITED TECHNOLOGIES	22,900	72.390	1,657,731.000
UNITED PARCEL SERVICE-B	19,500	71.760	1,399,320.000
SPRINT NEXTEL CORP	78,022	2.250	175,549.500
UNUM GROUP	8,600	20.580	176,988.000
AMEREN CORPORATION	6,500	31.710	206,115.000
UNITEDHEALTH GROUP INC	28,426	49.000	1,392,874.000
USX-US STEEL GRP	3,800	25.870	98,306.000
VERISIGN INC	4,200	34.720	145,824.000
VALERO ENERGY CORP	15,892	20.520	326,103.840
WEYERHAEUSER CO	13,994	16.700	233,699.800
WELLPOINT INC	9,600	64.950	623,520.000
THE WALT DISNEY CO.	46,700	35.320	1,649,444.000
WELLS FARGO & CO	133,172	25.980	3,459,808.560
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,200	51.700	113,740.000
WASTE MANAGEMENT INC	12,400	31.000	384,400.000
WILLIAMS COMPANY	15,900	31.000	492,900.000
WHITING PETROLEUM CORP	3,300	45.270	149,391.000
WHIRLPOOL CORP	2,100	46.640	97,944.000
WAL-MART STORES	50,700	58.270	2,954,289.000
ZIMMER HOLDINGS INC	5,100	47.520	242,352.000
WEATHERFORD INTERNATIONAL	19,700	13.510	266,147.000
WYNN RESORTS LTD	2,100	105.650	221,865.000
XEROX CORP	37,044	7.970	295,240.680
TJX COMPANIES INC	10,300	62.140	640,042.000
WATERS CORP	2,500	71.610	179,025.000
WATSON PHARMACEUTICALS IN	3,800	60.120	228,456.000

WHOLE FOODS MARKET INC	4,200	66.160	277,872.000
WASHINGTON POST -CL B	200	353.790	70,758.000
WALGREEN CO	24,000	34.130	819,120.000
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	4,700	37.800	177,660.000
WESTERN DIGITAL CORP	6,300	30.950	194,985.000
WISCONSIN ENERGY CORP	6,400	33.440	214,016.000
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	13,200	31.290	413,028.000
VISA INC-CLASS A SHS	13,900	97.440	1,354,416.000
PPL CORPORATION	15,700	28.740	451,218.000
PITNEY BOWES INC	5,500	18.340	100,870.000
PEPCO HOLDINGS INC	6,400	19.370	123,968.000
ULTRA PETROLEUM CORP	4,100	30.230	123,943.000
PPG INDUSTRIES INC	4,300	80.870	347,741.000
NORTHERN TRUST CORP	6,100	38.980	237,778.000
NSTAR	2,500	45.840	114,600.000
PRECISION CASTPARTS CORP	3,900	156.030	608,517.000
NVIDIA CORP	17,050	13.510	230,345.500
PNC FINANCIAL SERVICES	14,193	55.090	781,892.370
LIBERTY INTERACTIVE CORP	14,950	15.430	230,678.500
TERADATA CORP	4,700	49.280	231,616.000
TYSON FOODS INC-CL A	8,800	20.370	179,256.000
NETFLIX.COM INC	1,300	69.820	90,766.000
NII HOLDINGS INC	4,500	19.880	89,460.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC	10,300	43.840	451,552.000
NRG ENERGY INC	6,900	18.310	126,339.000
TORCHMARK CORP	3,150	42.140	132,741.000
TEXTRON INC	7,500	17.820	133,650.000
NEWS CORP-CL A	48,150	16.980	817,587.000
NEWS CORP-CLASS B	11,600	17.620	204,392.000
OMNICOM GROUP	7,300	41.340	301,782.000
ORACLE CORPORATION	107,683	29.210	3,145,420.430
MASTERCARD INC-CLASS A	2,900	362.160	1,050,264.000
ONEOK INC	2,900	82.060	237,974.000
CENTURYLINK INC	15,995	35.260	563,983.700
ROPER INDUSTRIES INC	2,500	83.080	207,700.000
YUM! BRANDS INC	12,100	57.700	698,170.000
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,400	103.000	144,200.000
MOLSON COORS BREWING CO-B	4,800	42.640	204,672.000
NOBLE ENERGY INC	4,800	90.060	432,288.000
BANK OF AMERICA CORP	268,601	5.200	1,396,725.200
NORDSTROM INC	4,800	47.030	225,744.000
AMERICAN EXPRESS CO	28,800	46.880	1,350,144.000
ANALOG DEVICES	7,900	34.160	269,864.000
ADVANCED MICRO DEVICES	14,927	5.130	76,575.510
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,500	15.250	99,125.000
AMERICAN INTL GROUP	12,872	23.360	300,689.920
ANADARKO PETROLEUM CORP	13,000	72.940	948,220.000
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	3,700	25.960	96,052.000
HUDSON CITY BANCORP INC	12,300	6.000	73,800.000
NEWFIELD EXPLORATION COMP	3,600	37.010	133,236.000
AVERY DENNISON CORP	3,000	27.470	82,410.000
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	7,900	65.490	517,371.000
EMERSON ELECTRIC CO	19,800	49.130	972,774.000
AON CORP	7,800	44.860	349,908.000
AMGEN	24,300	60.050	1,459,215.000
ALLERGAN INC	8,000	83.660	669,280.000
COACH INC	7,800	57.590	449,202.000

EATON CORP	9,000	42.190	379,710.000
CROWN CASTLE INTL CORP	7,400	42.880	317,312.000
CELGENE CORP	12,100	63.690	770,649.000
CONSTELLATION BRANDS INC-	5,700	19.530	111,321.000
APPLIED MATERIALS INC	34,300	10.330	354,319.000
CIT GROUP INC	5,100	34.740	177,174.000
CIMAREX ENERGY CO	2,500	61.740	154,350.000
CME GROUP INC	1,700	242.000	411,400.000
NATIONAL OILWELL VARCO IN	11,444	65.530	749,925.320
ECOLAB INC	8,300	54.720	454,176.000
EQUIFAX INC	3,500	37.730	132,055.000
GAP INC	11,400	18.300	208,620.000
GILEAD SCIENCES INC	20,700	37.160	769,212.000
COVENTRY HEALTH CARE INC	4,350	30.810	134,023.500
ST JUDE MEDICAL INC	8,900	32.950	293,255.000
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	6,148	38.810	238,603.880
HORMEL FOODS CORP	4,400	28.590	125,796.000
SAFEWAY INC	10,100	20.570	207,757.000
STATE STREET CORP	13,743	40.040	550,269.720
STAPLES INC	19,900	14.080	280,192.000
SUNTRUST BANKS INC	15,048	16.480	247,991.040
SCHWAB(CHARLES) CORP	29,800	10.850	323,330.000
IHS INC-CLASS A	1,200	83.600	100,320.000
BAXTER INTL INC	14,900	48.080	716,392.000
CONSTELLATION ENERGY	5,400	38.960	210,384.000
CAMPBELL SOUP CO	5,000	32.720	163,600.000
CROWN HOLDINGS INC	4,300	33.310	143,233.000
CHUBB CORP	7,800	67.380	525,564.000
CARDINAL HEALTH INC	9,500	40.940	388,930.000
CAREFUSION CORP	5,850	24.060	140,751.000
FEDEX CORP	8,300	84.890	704,587.000
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	12,254	43.390	531,701.060
FMC CORP	1,900	84.490	160,531.000
FLEXTRONICS INTL LTD	22,600	5.790	130,854.000
CERNER CORP	4,000	56.350	225,400.000
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,100	51.890	108,969.000
CITRIX SYSTEMS INC	5,100	64.080	326,808.000
INTEL CORP	139,800	23.230	3,247,554.000
CAMERON INTERNATIONAL COR	6,400	47.550	304,320.000
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	13,800	9.090	125,442.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS	12,000	15.660	187,920.000
IRON MOUNTAIN INC	5,050	30.160	152,308.000
CREE INC	3,300	21.750	71,775.000
ILLINOIS TOOL WORKS	11,700	46.000	538,200.000
SIRIUS XM RADIO INC	98,000	1.770	173,460.000
ILLUMINA INC	3,400	26.910	91,494.000
CHESAPEAKE ENERGY CORP	17,900	22.980	411,342.000
SEALED AIR CORP	4,500	17.420	78,390.000
INTUITIVE SURGICAL INC	1,100	432.120	475,332.000
SARA LEE CORP	15,600	18.420	287,352.000
CALPINE CORP	9,300	15.160	140,988.000
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	6,100	12.750	77,775.000
COVANCE INC	1,700	45.090	76,653.000
CARMAX INC	6,500	30.360	197,340.000
COMERICA INC	5,800	24.740	143,492.000
DUKE ENERGY CORP	35,692	21.010	749,888.920
TARGET CORP	17,100	52.200	892,620.000



DOVER CORP	4,900	56.140	275,086.000
RR DONNELLEY & SONS CO	5,500	14.350	78,925.000
WW GRAINGER INC	1,600	178.990	286,384.000
JACOBS ENGINEERING GROUP	3,500	39.810	139,335.000
JOHNSON CONTROLS INC	18,600	28.960	538,656.000
CINTAS CORP	3,700	30.520	112,924.000
CA INC	10,805	20.120	217,396.600
CONAGRA INC	11,000	25.450	279,950.000
CLOROX COMPANY	3,600	65.000	234,000.000
ENTERGY CORP	4,700	71.640	336,708.000
MICROSOFT CORP	200,700	26.000	5,218,200.000
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,800	38.890	186,672.000
CVS CAREMARK CORP	36,374	37.550	1,365,843.700
MEDTRONIC INC	28,700	35.300	1,013,110.000
MICRON TECHNOLOGY INC	25,600	5.680	145,408.000
BLACKROCK INC-CLASS A	2,600	170.330	442,858.000
CENTERPOINT ENERGY INC	10,700	19.220	205,654.000
HASBRO INC	3,600	34.020	122,472.000
KELLOGG CO	7,100	48.770	346,267.000
KEYCORP	26,000	7.180	186,680.000
KANSAS CITY SOUTHERN	2,700	63.810	172,287.000
KRAFT FOODS INC-A	44,611	36.490	1,627,855.390
KOHL'S CORP	7,300	48.820	356,386.000
SEARS HOLDING CORP	1,225	46.160	56,546.000
URS CORP	2,100	34.660	72,786.000
NEW YORK COMMUNITY BANCOR	11,500	11.970	137,655.000
APACHE CORP	10,110	88.740	897,161.400
ACE LTD	9,200	66.740	614,008.000
ARROW ELECTRONICS INC	3,200	34.510	110,432.000
ALLSTATE	13,700	26.440	362,228.000
EBAY INC	30,800	30.400	936,320.000
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,800	36.740	139,612.000
XILINX INC	7,500	31.210	234,075.000
EXPRESS SCRIPTS INC CL-A	13,100	43.520	570,112.000
DISH NETWORK CORP	5,400	25.780	139,212.000
YAHOO! INC	31,900	14.960	477,224.000
ESTEE LAUDER COMPANIES-A	3,300	108.120	356,796.000
TOLL BROTHERS INC	4,500	19.660	88,470.000
LINEAR TECHNOLOGY CORP	6,300	28.970	182,511.000
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	7,500	11.310	84,825.000
NOBLE CORP	7,400	30.600	226,440.000
PROGRESSIVE CORP	17,000	18.670	317,390.000
PRAXAIR INC	8,100	103.770	840,537.000
PACCAR INC	8,937	36.220	323,698.140
PETSMART INC	3,300	50.490	166,617.000
EL PASO CORPORATION	21,000	24.980	524,580.000
EMC CORP/MASS	54,200	22.300	1,208,660.000
BIOGEN IDEC INC	6,030	110.290	665,048.700
INTL GAME TECHNOLOGY	8,100	15.700	127,170.000
STARBUCKS CORP	20,100	43.480	873,948.000
PERRIGO CO	2,200	98.180	215,996.000
NORTHEAST UTILITIES	4,700	34.740	163,278.000
INTUIT INC	7,700	51.780	398,706.000
BORG-WARNER AUTOMOTIVE	3,100	62.350	193,285.000
BEST BUY COMPANY INC	9,000	23.190	208,710.000
BALL CORP	4,200	34.630	145,446.000
BOSTON SCIENTIFIC CORP	42,947	5.140	220,747.580

BED BATH & BEYOND INC	6,700	61.220	410,174.000
XL GROUP PLC	8,400	19.660	165,144.000
ELECTRONIC ARTS INC	9,100	20.225	184,047.500
VULCAN MATERIALS CO	3,700	38.780	143,486.000
VERTEX PHARMACEUTICALS IN	5,400	33.910	183,114.000
VF CORP	2,400	128.480	308,352.000
CBS CORP-CL B	16,571	24.840	411,623.640
VIACOM INC-CLASS B	14,271	42.760	610,227.960
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,700	54.390	92,463.000
NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,400	24.630	157,632.000
VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	3,200	63.190	202,208.000
CARNIVAL CORP	12,400	33.870	419,988.000
CLEVELAND-CLIFFS INC	3,800	63.950	243,010.000
COMCAST CORP -CL A	55,070	23.330	1,284,783.100
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	17,900	23.150	414,385.000
アメリカ・ドル 小計	株 8,123,072		アメリカ・ドル 302,820,914.260 (23,583,692,802)
イギリス・ポンド	株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド
KAZAKHMYS PLC	5,900	8.740	51,566.000
BP PLC	518,800	4.457	2,312,291.600
UNILEVER PLC	35,260	20.670	728,824.200
BARCLAYS PLC	319,700	1.714	547,965.800
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	52,900	7.240	382,996.000
TUI TRAVEL PLC	16,100	1.544	24,858.400
MARKS & SPENCER GROUP PLC	45,600	3.077	140,311.200
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,600	65.150	169,390.000
REXAM PLC	24,200	3.408	82,473.600
PRUDENTIAL PLC	68,300	6.095	416,288.500
LONMIN PLC	4,800	9.465	45,432.000
INMARSAT PLC	12,800	3.968	50,790.400
ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	500,915	0.200	100,183.000
JOHNSON MATTHEY PLC	5,800	17.680	102,544.000
BAE SYSTEMS PLC	94,800	2.724	258,235.200
AVIVA PLC	79,200	2.855	226,116.000
EURASIAN NATURAL RESOURCE	7,400	6.220	46,028.000
CAIRN ENERGY PLC	40,900	2.623	107,280.700
GLAXOSMITHKLINE PLC	141,002	14.430	2,034,658.860
INVENSYS PLC	23,500	1.970	46,295.000
REED ELSEVIER PLC	32,646	5.045	164,699.070
BG GROUP PLC	92,800	13.205	1,225,424.000
DIAGEO PLC	68,000	13.530	920,040.000
RIO TINTO PLC-REG	39,300	30.600	1,202,580.000
STANDARD CHARTERED PLC	64,500	13.635	879,457.500
TESCO PLC	217,200	3.829	831,658.800
FRESNILLO PLC	5,000	15.530	77,650.000
SMITH & NEPHEW PLC	25,700	5.750	147,775.000
GLENCORE INTERNATIONAL PL	22,200	3.870	85,914.000
SMITHS GROUP PLC	11,433	8.900	101,753.700
BABCOCK INTL GROUP PLC	10,000	7.005	70,050.000
PEARSON PLC	23,263	11.420	265,663.460
SAINSBURY (J) PLC	36,125	2.877	103,931.620
NEXT PLC	5,100	26.000	132,600.000
WHITBREAD PLC	4,911	15.380	75,531.180
BUNZL PLC	9,055	8.510	77,058.050
GKN PLC	41,000	1.720	70,520.000

VODAFONE GROUP PLC	1,409,037	1.745	2,458,769.560
BALFOUR BEATTY PLC	21,400	2.450	52,430.000
KINGFISHER PLC	67,511	2.385	161,013.730
WPP PLC	34,100	6.430	219,263.000
UNITED UTILITIES GROUP PL	18,527	5.920	109,679.840
SEVERN TRENT PLC	6,633	14.650	97,173.450
RECKITT BENCKISER PLC	16,800	31.500	529,200.000
SCHRODERS PLC	3,200	12.710	40,672.000
TATE&LYLE PLC	12,600	6.715	84,609.000
INTERNATIONAL POWER PLC	43,300	3.198	138,473.400
AMEC PLC	9,600	8.775	84,240.000
SSE PLC	26,600	12.540	333,564.000
WEIR GROUP PLC (THE)	5,700	19.410	110,637.000
ASTRAZENECA PLC	37,500	29.130	1,092,375.000
WOLSELEY PLC	8,190	19.480	159,541.200
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	159,500	0.996	158,862.000
3I GROUP PLC	27,591	1.692	46,683.970
BRITISH SKY BROADCASTING	31,900	7.160	228,404.000
SAGE GROUP PLC (THE)	39,200	2.835	111,132.000
NATIONAL GRID PLC	100,328	6.135	615,512.280
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,139,965	0.245	279,291.420
RSA INSURANCE GROUP PLC	102,300	0.996	101,890.800
IMPERIAL TOBACCO GROUP	27,600	23.250	641,700.000
CENTRICA PLC	141,760	2.838	402,314.880
ARM HOLDINGS PLC	37,800	5.505	208,089.000
BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	55,360	29.635	1,640,593.600
ICAP PLC	16,900	3.348	56,581.200
SABMILLER PLC	25,800	21.505	554,829.000
BHP BILLITON PLC	57,577	18.435	1,061,431.990
ASSOCIATED BRITISH FOODS	9,900	10.870	107,613.000
HSBC HOLDINGS PLC	492,300	4.807	2,366,486.100
SHIRE PLC	15,500	21.100	327,050.000
OLD MUTUAL PLC	157,400	1.260	198,324.000
ANGLO AMERICAN PLC	35,683	22.985	820,173.750
MORRISON SUPERMARKETS	60,900	3.157	192,261.300
CARNIVAL PLC	5,061	21.500	108,811.500
COMPASS GROUP PLC	52,500	5.835	306,337.500
BT GROUP PLC	215,500	1.899	409,234.500
MAN GROUP PLC	51,525	1.276	65,745.900
XSTRATA PLC	55,800	9.700	541,260.000
BURBERRY GROUP PLC	12,189	11.380	138,710.820
INTERCONTINENTAL HOTELS	8,300	10.670	88,561.000
AGGREKO PLC	7,671	18.170	139,382.070
CAPITA GROUP PLC	18,190	6.240	113,505.600
SERCO GROUP PLC	13,500	4.640	62,640.000
INTERTEK GROUP PLC	4,700	19.200	90,240.000
ITV PLC	112,200	0.618	69,339.600
TULLOW OIL PLC	25,400	13.290	337,566.000
VEDANTA RESOURCES PLC	3,500	10.850	37,975.000
PETROFAC LTD	7,000	14.200	99,400.000
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,349	7.760	33,748.240
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	99,600	22.755	2,266,398.000
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	72,081	23.430	1,688,857.830
G4S PLC	40,800	2.578	105,182.400
COBHAM PLC	31,500	1.694	53,361.000
ADMIRAL GROUP PLC	5,700	8.020	45,714.000
INVESTEC PLC	13,900	3.261	45,327.900

	ANTOFAGASTA PLC	10,800	11.720	126,576.000
	STANDARD LIFE PLC	67,400	1.967	132,575.800
	EXPERIAN PLC	28,054	8.295	232,707.930
	RESOLUTION LTD	42,476	2.460	104,490.960
イギリス・ボンド 小計		株 8,174,368		イギリス・ボンド 37,541,349.860 (4,532,367,169)
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	7.210	406,644.000
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	35.850	501,900.000
	ELBIT SYSTEMS LTD	800	160.600	128,480.000
	TEVA PHARMACEUTICAL IND L	26,200	162.900	4,267,980.000
	BANK HAPOALIM BM	32,000	12.850	411,200.000
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,600	11.350	426,760.000
	NICE SYSTEMS LTD	2,100	120.000	252,000.000
イスラエル・シュケル 小計		株 169,100		イスラエル・シュケル 6,394,964.000 (131,480,460)
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル
	BHP BILLITON LTD	86,500	35.190	3,043,935.000
	LEND LEASE	16,100	7.420	119,462.000
	ASCIANO LTD	28,600	4.590	131,274.000
	ALUMINA LTD	69,900	1.250	87,375.000
	WOODSIDE PETROLEUM	17,800	31.300	557,140.000
	OZ MINERALS LTD	9,707	10.550	102,408.850
	FORTESCUE METALS GROUP	33,900	4.600	155,940.000
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,000	9.000	90,000.000
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	61,800	23.430	1,447,974.000
	WESTPAC BANKING	80,898	20.510	1,659,217.980
	SANTOS LIMITED	26,800	12.650	339,020.000
	AUSTRALIA & NZLAND BK	70,900	20.930	1,483,937.000
	RIO TINTO LTD	12,200	61.800	753,960.000
	ORIGIN ENERGY LIMITED	30,600	13.690	418,914.000
	AMCOR	35,600	7.310	260,236.000
	METCASH LTD	23,500	4.210	98,935.000
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP	20,500	3.650	74,825.000
	QR NATIONAL LTD	46,800	3.550	166,140.000
	FOSTER'S GROUP LTD	55,900	5.380	300,742.000
	NEWCREST MINING	21,400	31.600	676,240.000
	INCITEC PIVOT LTD	45,600	3.100	141,360.000
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	42,600	49.130	2,092,938.000
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,800	12.710	61,008.000
	ORICA LIMITED	10,300	25.180	259,354.000
	QBE INSURANCE	30,800	13.510	416,108.000
	LEIGHTON HOLDINGS	4,600	19.700	90,620.000
	WOOLWORTHS	33,300	26.260	874,458.000
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	15,900	12.020	191,118.000
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	2.810	57,605.000
	CROWN LTD	16,900	8.180	138,242.000
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	38,700	1.520	58,824.000
	TELSTRA CORPORATION	121,200	3.270	396,324.000
	AMP LIMITED	79,400	4.310	342,214.000
	JAMES HARDIE INDUSTRIES	15,900	6.520	103,668.000
	MACQUARIE GROUP LIMITED	9,800	24.120	236,376.000
	FAIRFAX MEDIA LTD	77,700	0.770	59,829.000

CSL LIMITED	15,100	32.400	489,240.000	
ONSTEEL LIMITED	44,700	0.765	34,195.500	
WESFARMERS LIMITED	26,900	30.500	820,450.000	
COCHLEAR LIMITED	1,700	55.460	94,282.000	
SUNCORP GROUP LTD	36,300	8.410	305,283.000	
BORAL LIMITED	22,700	3.610	81,947.000	
ASX LTD	5,000	30.650	153,250.000	
COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	7.830	108,837.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LT	14,000	1.955	27,370.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	58,400	3.160	184,544.000	
SONIC HEALTHCARE LTD	10,100	11.530	116,453.000	
TRANSURBAN GROUP	37,500	5.690	213,375.000	
ILUKA RESOURCES LTD	11,000	15.930	175,230.000	
TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	4.460	83,848.000	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	5,400	13.160	71,064.000	
MAP GROUP NEW	18,900	2.800	52,920.000	
WORLEYPARSONS LTD	5,300	26.050	138,065.000	
TATTS GROUP LTD	36,900	2.450	90,405.000	
AGL ENERGY LTD	12,800	14.670	187,776.000	
BRAMBLES LTD	42,700	7.240	309,148.000	
LYNAS CORP LTD	49,900	1.175	58,632.500	
オーストラリア・ドル 小計	株 1,815,405		オーストラリア・ドル 21,284,036.830 (1,648,022,971)	
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
IMPERIAL OIL LTD	8,500	42.860	364,310.000	
SILVER WHEATON CORP	10,200	30.220	308,244.000	
INTACT FINANCIAL CORP	3,700	59.030	218,411.000	
BCE INC	7,530	40.380	304,061.400	
FRANCO-NEVADA CORP	3,600	39.530	142,308.000	
SUNCOR ENERGY INC	42,480	27.800	1,180,944.000	
METRO INC-A	3,000	52.120	156,360.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	4,400	71.310	313,764.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	30,400	49.410	1,502,064.000	
CANADIAN IMPERIAL BANK	11,300	72.300	816,990.000	
TORONTO-DOMINION BANK	24,200	72.620	1,757,404.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	8,100	19.830	160,623.000	
MEG ENERGY CORP	3,400	39.710	135,014.000	
ROYAL BANK OF CANADA	39,300	48.820	1,918,626.000	
TOURMALINE OIL CORP	3,800	27.400	104,120.000	
PROGRESS ENERGY RESOURCES	5,700	12.900	73,530.000	
VERMILION ENERGY INC	2,400	43.970	105,528.000	
TRANSCANADA CORP	19,400	43.750	848,750.000	
BAYTEX ENERGY CORP	3,400	55.740	189,516.000	
BONAVISTA ENERGY CORP	4,600	26.580	122,268.000	
PENGROWTH ENERGY CORP	10,700	10.750	115,025.000	
BOMBARDIER INC 'B'	41,400	3.550	146,970.000	
BARRICK GOLD CORP	27,000	46.650	1,259,550.000	
CAE INC	9,200	9.710	89,332.000	
THOMSON REUTERS CORP	10,104	26.700	269,776.800	
POTASH CORP OF SASKATCHEW	23,000	40.580	933,340.000	
INMET MINING CRP	1,600	61.490	98,384.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	3,500	36.200	126,700.000	
OSISKO MINING CORP	9,500	10.220	97,090.000	
CANADIAN UTILITIES LTD A	2,500	59.000	147,500.000	
ROGERS COMMUNICATIONS-B	11,700	36.630	428,571.000	

AGNICO-EAGLE MINES	4,800	38.240	183,552.000
ATHABASCA OIL SANDS CORP	9,000	12.250	110,250.000
KINROSS GOLD CORP	32,100	12.490	400,929.000
BANK OF MONTREAL	16,800	54.700	918,960.000
POWER CORP OF CANADA	10,400	22.770	236,808.000
CAMECO CORP	11,700	17.750	207,675.000
TELUS CORP	900	55.670	50,103.000
POWER FINANCIAL CORP	6,700	25.370	169,979.000
NEW GOLD INC	12,400	10.400	128,960.000
TECK RESOURECES LIMITED-B	15,500	35.180	545,290.000
NEXEN INC	14,500	15.180	220,110.000
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,500	63.940	159,850.000
VITERRA INC	10,500	10.540	110,670.000
TALISMAN ENERGY INC	29,700	11.760	349,272.000
IVANHOE MINES LTD	7,500	17.370	130,275.000
AGRIUM INC	4,400	67.610	297,484.000
CANADIAN NATURAL RESOURCE	29,400	36.100	1,061,340.000
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS L	600	425.410	255,246.000
MAGNA INTERNATIONAL INC	6,300	33.650	211,995.000
TRANSALTA CORP	6,700	20.460	137,082.000
WESTON (GEORGE) LTD	1,400	64.090	89,726.000
PAN AMERICAN SILVER CORP	3,400	22.930	77,962.000
RESEARCH IN MOTION	13,800	13.970	192,786.000
SUN LIFE FINANCIAL SVSC	16,000	19.390	310,240.000
ENBRIDGE INC	20,400	35.850	731,340.000
BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	15,400	27.030	416,262.000
BROOKFIELD OFFICE PROPERT	8,750	15.960	139,650.000
MANULIFE FINANCIAL CORP	48,800	10.410	508,008.000
VALEANT PHARMACEUTICALS I	7,700	47.160	363,132.000
GOLDCORP INC	22,659	47.340	1,072,677.060
ENCANA CORP	19,800	19.030	376,794.000
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	4,900	64.030	313,747.000
IAMGOLD CORPORATION	11,000	16.920	186,120.000
INDUSTRIAL ALLIANCE INSUR	2,800	26.090	73,052.000
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,400	19.510	66,334.000
CANADIAN NATL RAILWAY CO	12,200	76.000	927,200.000
CGI GROUP INC - CL A	6,400	18.950	121,280.000
HUSKY ENERGY INC	9,700	24.500	237,650.000
ONEX CORPORATION	3,500	32.860	115,010.000
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	11,200	19.710	220,752.000
TELUS CORPORATION-NON VOT	4,400	53.350	234,740.000
FINNING INTERNATIONAL INC	5,200	22.150	115,180.000
SHOPPERS DRUG MART CORP	5,900	42.040	248,036.000
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,400	47.900	210,760.000
ELDORADO GOLD CORPORATION	16,000	15.390	246,240.000
CENTERRA GOLD INC	4,600	18.840	86,664.000
IGM FINANCIAL INC	3,100	44.400	137,640.000
TMX GROUP INC	2,700	41.000	110,700.000
OPEN TEXT CORP	2,000	52.520	105,040.000
CI FINANCIAL CORP	5,600	20.920	117,152.000
SAPUTO INC	4,000	37.890	151,560.000
FIRST QUANTUM MINERALS LT	13,600	18.580	252,688.000
ALIMENTATION COUCHE-TARD	4,700	29.750	139,825.000
YAMANA GOLD INC	21,500	14.730	316,695.000
FORTIS INC	5,700	32.050	182,685.000
NIKO RESOURCES LTD	1,500	44.880	67,320.000
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,400	20.970	71,298.000

	CRESCENT POINT ENERGY COR	6,800	43.300	294,440.000
	CENOVUS ENERGY INC	20,900	31.850	665,665.000
	TIM HORTONS INC	4,400	49.030	215,732.000
	CANADIAN OIL SANDS LTD	13,500	22.100	298,350.000
	ENERPLUS CORP	5,300	25.290	134,037.000
	PENN WEST PETROLEUM LTD	13,600	19.800	269,280.000
	ARC RESOURCES LTD	7,700	25.180	193,886.000
	PACIFIC RUBIALES ENERGY C	7,000	19.000	133,000.000
カナダ・ドル 小計		株 1,052,723		カナダ・ドル 31,859,239.260 (2,385,619,836)
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	36,000	15.510	558,360.000
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	48,000	11.640	558,720.000
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	10.310	169,805.700
	FRASER & NEAVE LTD	33,000	6.140	202,620.000
	KEPPEL CORP	41,500	9.110	378,065.000
	UOL GROUP LIMITED	19,400	4.090	79,346.000
	CITY DEVELOPMENT	17,000	8.930	151,810.000
	CAPITALAND LIMITED	73,000	2.300	167,900.000
	SEBACORP MARINE LTD	25,000	3.760	94,000.000
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	49,000	3.670	179,830.000
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	3,000	47.920	143,760.000
	O.C.B.C.	67,000	7.980	534,660.000
	GENTING SINGAPORE PLC	175,000	1.515	265,125.000
	SINGAPORE TELECOM	236,450	3.180	751,911.000
	NOBLE GROUP LTD	115,181	1.145	131,882.240
	SINGAP. TECH ENGINEERING	48,000	2.650	127,200.000
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	36,000	4.010	144,360.000
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	219,400	0.705	154,677.000
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,000	6.050	163,350.000
	OLAM INTERNATIONAL LTD	44,000	2.200	96,800.000
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	28,000	0.870	24,360.000
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	56,000	5.000	280,000.000
	CAPITAMALLS ASIA LTD	45,000	1.185	53,325.000
シンガポール・ドル 小計		株 1,458,401		シンガポール・ドル 5,411,866.940 (322,980,219)
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン
	ADECCO SA-REG	3,850	37.230	143,335.500
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	19,300	159.000	3,068,700.000
	PARGESA HOLDING SA-BR	800	60.700	48,560.000
	SIKA AG-BR	60	1,671.000	100,260.000
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	31,000.000	124,000.000
	ABB LTD	60,650	16.760	1,016,494.000
	ARYZTA AG	2,700	43.450	117,315.000
	TRANSOCEAN LTD	8,650	37.580	325,067.000
	SWISS RE LTD	9,800	47.000	460,600.000
	NESTLE SA-REGISTERED	93,850	51.200	4,805,120.000
	SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,500	106.700	160,050.000
	CREDIT SUISSE GROUP AG	31,450	21.410	673,344.500
	GAM HOLDING LTD	5,900	10.000	59,000.000
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,900	34.640	204,376.000
	SGS SA	150	1,522.000	228,300.000
	THE SWATCH GROUP AG-B	850	323.900	275,315.000
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	4,032	203.000	818,496.000

	BALOISE HOLDING AG - REG	1,600	60.350	96,560.000
	NOVARTIS AG-REG SHS	64,100	52.000	3,333,200.000
	CIE FINANC RICHEMONT-A	14,700	45.050	662,235.000
	UBS AG-REGISTERED	98,100	10.860	1,065,366.000
	SWISSCOM AG-REG	720	344.800	248,256.000
	GEBERIT AG-REG	1,150	175.700	202,055.000
	GIVAUDAN REG	230	850.000	195,500.000
	ACTELION LTD-REG	3,450	30.760	106,122.000
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	250	155.000	38,750.000
	SYNGENTA AG	2,612	259.900	678,858.800
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,450	91.550	132,747.500
	SYNTHESE INC	1,800	155.700	280,260.000
	LONZA GROUP AG-REG	1,550	54.150	83,932.500
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	57.500	86,250.000
	HOLCIM LTD-REG	6,700	49.210	329,707.000
	SWISS LIFE HOLDING AG	950	85.000	80,750.000
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,500	105.900	158,850.000
スイス・フラン 小計		株 451,808		スイス・フラン 20,407,732.800 (1,694,862,209)
スウェーデン・クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ
	ERICSSON LM-B SHS	82,430	65.300	5,382,679.000
	VOLVO AB-B SHS	38,900	70.250	2,732,725.000
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	2,200	719.000	1,581,800.000
	S.K.F. AB-B SHS	10,900	136.000	1,482,400.000
	ELECTROLUX AB-SER B	6,400	104.500	668,800.000
	NORDEA AB	72,000	49.900	3,592,800.000
	SCANIA AB-B SHS	9,250	96.350	891,237.500
	SWEDISH MATCH AB	6,200	233.700	1,448,940.000
	TELE2 AB-B SHS	8,950	126.600	1,133,070.000
	GETINGE AB-B SHS	6,200	165.600	1,026,720.000
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	40,050	38.490	1,541,524.500
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	13,600	177.200	2,409,920.000
	SWEDBANK AB	22,550	85.550	1,929,152.500
	HENNES & MAURITZ AB-B	27,400	210.100	5,756,740.000
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	16,450	97.950	1,611,277.500
	SKANSKA AB-B	10,800	104.000	1,123,200.000
	SANDVIK AB	27,950	79.100	2,210,845.000
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	123.900	1,523,970.000
	ATLAS COPCO AB-A SHS	19,150	140.700	2,694,405.000
	SECURITAS AB-B SHS	9,200	59.600	548,320.000
	TELIASONERA AB	58,300	45.230	2,636,909.000
	ALFA LAVAL AB	9,400	124.100	1,166,540.000
	ATLAS COPCO AB-B SHS	10,400	124.300	1,292,720.000
	ASSA ABLOY AB-B	8,450	160.800	1,358,760.000
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,450	302.400	438,480.000
	SSAB AB-A SHARES	6,100	55.850	340,685.000
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,400	158.900	858,060.000
	BOLIDEN AB	7,900	94.900	749,710.000
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,550	30.350	380,892.500
	RATOS AB-B SHS	5,900	76.200	449,580.000
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,650	131.500	874,475.000
	HEXAGON AB-B SHS	7,000	92.850	649,950.000
スウェーデン・クローナ 小計		株 582,380		スウェーデン・クローナ 52,487,287.500 (589,957,112)



デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ
	NOVO NORDISK A/S-B	11,700	636.000	7,441,200.000
	DANSKE BANK A/S	17,100	71.800	1,227,780.000
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	19	32,660.000	620,540.000
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,450	63.700	347,165.000
	TDC A/S	11,500	45.180	519,570.000
	CARLSBERG AS-B	3,050	393.600	1,200,480.000
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,000	165.600	1,324,800.000
	COLOPLAST-B	750	801.000	600,750.000
	DSV A/S	5,600	100.000	560,000.000
	WILLIAM DEMANT HOLDING	825	444.300	366,547.500
	A P MOLLER-MAERSK A/S	32	34,520.000	1,104,640.000
デンマーク・クローネ 小計		株 64,026		デンマーク・クローネ 15,313,472.500 (209,028,899)
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル
	TELECOM CORP OF NZ	65,589	2.035	133,473.610
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	6.170	124,017.000
ニュージーランド・ドル 小計		株 85,689		ニュージーランド・ドル 257,490.610 (15,225,420)
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ
	NORSK HYDRO ASA	24,700	26.440	653,068.000
	DNB ASA	27,600	55.000	1,518,000.000
	ORKLA ASA	20,750	42.110	873,782.500
	TELENOR ASA	21,100	93.000	1,962,300.000
	STATOIL ASA	29,873	147.700	4,412,242.100
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,460	220.800	1,205,568.000
	SEADRILL LTD	9,200	192.500	1,771,000.000
	AKER SOLUTIONS ASA	4,250	58.850	250,112.500
	SUBSEA 7 SA	8,000	105.600	844,800.000
ノルウェー・クローネ 小計		株 150,933		ノルウェー・クローネ 13,490,873.100 (176,190,803)
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ
	BAYER AG	22,400	45.045	1,009,008.000
	DEUTSCHE BANK AG-REG	25,600	27.350	700,160.000
	COMMERZBANK AG	104,850	1.300	136,305.000
	VOLKSWAGEN AG	750	103.450	77,587.500
	VOLKSWAGEN AG PFD	3,900	115.350	449,865.000
	M.A.N.	1,800	62.460	112,428.000
	SIEMENS AG	22,400	71.410	1,599,584.000
	E.ON AG	49,700	16.160	803,152.000
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	9,450	49.990	472,405.500
	GEA GROUP AG	5,050	20.325	102,641.250
	CONTINENTAL AG	2,200	46.400	102,080.000
	BASF SE	25,150	51.710	1,300,506.500
	LINDE	4,650	110.050	511,732.500
	K+S AG	4,850	33.875	164,293.750
	ALLIANZ SE-REG	12,800	72.770	931,456.000
THYSSENKRUPP AG	10,600	17.130	181,578.000	
HENKEL AG & CO KGAA	5,250	43.285	227,246.250	
R.W.E. AG	11,950	26.250	313,687.500	
LUFTHANSA	6,750	8.927	60,257.250	

FRAPORT AG	1,100	38.110	41,921.000
BRENTAG AG	1,000	70.570	70,570.000
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,100	69.420	215,202.000
UNITED INTERNET AG-REG SH	4,100	13.655	55,985.500
HOCHTIEF AG	1,450	41.980	60,871.000
SAP AG	24,792	42.245	1,047,338.040
MUNCHENER RUECK AG-REG	5,050	90.500	457,025.000
HEIDELBERGCEMENT AG	3,900	30.190	117,741.000
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	4,450	39.435	175,485.750
BEIERSDORF AG	3,000	42.400	127,200.000
CELESIO AG	2,800	11.945	33,446.000
MERCK KGAA	1,950	73.760	143,832.000
ADIDAS AG	5,970	48.105	287,186.850
HENKEL KGAA	3,750	36.155	135,581.250
METRO AG	3,850	27.950	107,607.500
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	76,100	9.000	684,900.000
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,950	51.050	303,747.500
DAIMLER AG	24,800	31.775	788,020.000
QIAGEN N.V.	6,800	10.460	71,128.000
INFINEON TECHNOLOGIES AG	31,500	5.765	181,597.500
HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,850	36.465	67,460.250
DEUTSCHE POST AG	23,550	11.130	262,111.500
DEUTSCHE BOERSE AG-NEW	5,150	40.895	210,609.250
RWE AG-NON VTG PFD	1,150	23.950	27,542.500
SUEDZUCKER AG	2,250	23.245	52,301.250
LANXESS	2,450	37.115	90,931.750
SALZGITTER AG	1,250	36.745	45,931.250
WACKER CHEMIE AG	500	59.500	29,750.000
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING	2,800	39.290	110,012.000
PHILIPS ELECTRONICS NV	28,276	14.755	417,212.380
ARCELORMITTAL	23,500	13.150	309,025.000
UNILEVER NV-CVA	45,400	24.995	1,134,773.000
HEINEKEN NV	7,200	34.010	244,872.000
REED ELSEVIER NV	18,427	8.585	158,195.790
AEGON NV	48,744	2.929	142,771.170
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	31,260	9.600	300,096.000
AKZO NOBEL	6,600	33.970	224,202.000
KONINKLIJKE DSM NV	4,400	33.895	149,138.000
WOLTERS KLUWER	8,150	12.700	103,505.000
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,100	25.275	53,077.500
ING GROEP N.V.	107,550	5.195	558,722.250
KONINKLIJKE KPN NV	42,600	8.950	381,270.000
ASML HOLDING NV	12,038	30.320	364,992.160
TNT EXPRESS NV-W/I	10,195	5.612	57,214.340
VOPAK	2,000	39.605	79,210.000
RANDSTAD HOLDING NV	3,250	21.420	69,615.000
SBM OFFSHORE NV	5,407	15.625	84,484.370
FUGRO NV-CVA	1,900	41.825	79,467.500
HEINEKEN HOLDING NV	3,050	29.150	88,907.500
TOTAL SA	57,250	36.855	2,109,948.750
MICHELIN (CGDE) - B	4,900	42.935	210,381.500
AIR LIQUIDE	7,660	89.390	684,727.400
PPR	2,050	106.000	217,300.000
SCHNEIDER ELECTRIC SA	13,750	37.595	516,931.250
BOUYGUES	6,900	23.675	163,357.500
LAFARGE SA	5,450	25.485	138,893.250
BNP PARIBAS	26,500	27.745	735,242.500

PEUGEOT SA	4,750	11.810	56,097.500
NATIXIS	24,150	1.960	47,334.000
THALES SA	3,050	22.270	67,923.500
GROUPE DANONE	15,800	45.990	726,642.000
CARREFOUR	16,550	16.005	264,882.750
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	8,075	8.960	72,352.000
VIVENDI SA	34,250	16.240	556,220.000
L'OREAL	6,450	77.220	498,069.000
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	11,350	27.390	310,876.500
LEGRAND SA	6,500	23.165	150,572.500
ALCATEL-LUCENT	66,800	1.151	76,886.800
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	60.470	93,728.500
PERNOD-RICARD	5,667	66.900	379,122.300
EURAZEO	1,026	26.005	26,681.130
SOCIETE GENERALE-A	18,650	16.545	308,564.250
LVMH	6,800	104.100	707,880.000
ACCOR SA	4,050	17.840	72,252.000
CAP GEMINI SA	4,300	24.405	104,941.500
PUBLICIS GROUPE	4,250	33.695	143,203.750
VALLOUREC	3,350	45.730	153,195.500
BUREAU VERITAS SA	1,550	54.070	83,808.500
EIFFAGE	1,300	16.560	21,528.000
SODEXO	2,550	52.050	132,727.500
ESSILOR INTERNATIONAL	5,400	51.890	280,206.000
AXA	46,800	9.771	457,282.800
TELEVISION FRANCAISE	4,200	7.123	29,916.600
CHRISTIAN DIOR	1,600	87.940	140,704.000
LAGARDERE S.C.A.	3,800	18.090	68,742.000
TECHNIP S.A.	2,850	67.310	191,833.500
EDENRED	4,600	17.885	82,271.000
RENAULT	5,350	25.695	137,468.250
STMICROELECTRONICS NV	19,150	4.210	80,621.500
ATOS	1,600	33.475	53,560.000
DASSAULT SYSTEMS SA	1,750	58.790	102,882.500
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ	4,650	16.395	76,236.750
FRANCE TELECOM SA	51,650	11.820	610,503.000
ALSTOM	5,650	22.210	125,486.500
CNP ASSURANCES	4,000	9.561	38,244.000
NEOPOST SA	1,000	50.290	50,290.000
SANOFI	30,475	53.430	1,628,279.250
VINCI	12,850	31.430	403,875.500
EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	11,700	22.650	265,005.000
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,000	8.087	88,957.000
CREDIT AGRICOLE SA	29,200	4.043	118,055.600
GDF SUEZ	34,873	19.730	688,044.290
IMERYS SA	1,100	32.270	35,497.000
ELECTRICITE DE FRANCE	6,850	18.050	123,642.500
SES	8,700	17.965	156,295.500
SAFRAN SA	4,850	21.745	105,463.250
ILIAD SA	600	90.160	54,096.000
ARKEMA	1,550	48.465	75,120.750
ADP	950	52.340	49,723.000
EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,800	28.530	79,884.000
SCOR SE	5,900	17.850	105,315.000
GROUPE EUROTUNNEL SA-REGR	15,550	5.156	80,175.800
UCB SA	3,350	31.055	104,034.250
KBC GROUPE	4,000	9.801	39,204.000

BEKAERT NV	1,100	25.560	28,116.000
COLRUYT SA	2,500	28.000	70,000.000
DELHAIZE GROUP	2,950	42.470	125,286.500
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	2,300	49.370	113,551.000
SOLVAY SA	1,750	62.960	110,180.000
UMICORE	2,850	30.610	87,238.500
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	20,600	43.995	906,297.000
AGEAS	66,400	1.186	78,750.400
BELGACOM SA	4,900	23.280	114,072.000
MOBISTAR SA	1,050	38.945	40,892.250
BANCO POPOLARE SCARL	50,150	1.016	50,952.400
FIAT SPA	23,700	3.432	81,338.400
PRYSMIAN SPA	5,700	9.850	56,145.000
ASSICURAZIONI GENERALI	31,143	11.200	348,801.600
SAIPEM	7,550	31.550	238,202.500
FIAT INDUSTRIAL	22,450	6.185	138,853.250
MEDIOBANCA SPA	17,115	4.518	77,325.570
TENARIS SA	13,400	13.460	180,364.000
UNICREDIT SPA	356,699	0.681	242,912.010
TELECOM ITALIA SPA	269,882	0.806	217,524.890
TELECOM ITALIA-RNC	170,950	0.682	116,587.900
INTESA SANPAOLO-RNC	21,350	0.964	20,581.400
INTESA SANPAOLO	288,097	1.216	350,325.950
ATLANTIA SPA	9,150	11.720	107,238.000
ENI SPA	66,200	15.090	998,958.000
MEDIASET SPA	24,100	2.042	49,212.200
A2A SPA	42,800	0.694	29,703.200
FINMECCANICA SPA	11,225	2.674	30,015.650
MONTE DEI PASCHI SIENA	131,900	0.259	34,162.100
ENEL SPA	181,600	3.016	547,705.600
SNAM RETE GAS	47,100	3.296	155,241.600
LUXOTTICA GROUP SPA	3,750	20.500	76,875.000
UNIONE DI BANCHE ITALIANE	26,800	3.174	85,063.200
TERNA SPA	37,300	2.518	93,921.400
PIRELLI & C.	7,645	6.300	48,163.500
ENEL GREEN POWER SPA	47,400	1.579	74,844.600
TELEFONICA S.A.	113,177	12.835	1,452,626.790
BANCO POPULAR ESPANOL	28,015	3.361	94,158.410
BANCO BILBAO VIZCAYA	128,312	6.150	789,118.800
ACERINOX SA	3,900	9.506	37,073.400
IBERDROLA SA	106,184	4.698	498,852.430
BANCO DE SABADELL SA	29,969	3.052	91,465.380
BANKINTER SA	8,850	4.342	38,426.700
REPSOL YPF SA	22,550	22.065	497,565.750
GRIFOLS SA	4,400	12.100	53,240.000
GRIFOLS SA- RTS	4,400	0.741	3,260.400
BANCO SANTANDER SA	230,250	5.600	1,289,400.000
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	10,800	11.850	127,980.000
AMADEUS IT HOLDING SA-A	8,700	11.735	102,094.500
GAS NATURAL SDG SA	9,100	12.685	115,433.500
MAPFRE SA	17,100	2.404	41,108.400
CAIXABANK	24,750	3.744	92,664.000
ZARDOYA OTIS SA	3,700	10.210	37,777.000
INTL CONSOLIDATED AIRLINE	26,300	1.702	44,762.600
FOMENTO DE CONSTRUC Y CO	1,300	18.525	24,082.500
ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	3,876	22.620	87,675.120
ACCIONA SA	750	64.000	48,000.000

INDRA SISTEMAS SA	2,400	9.780	23,472.000
INDITEX	6,050	62.260	376,673.000
ENAGAS	4,900	13.895	68,085.500
RED ELECTRICA DE ESPANA	3,050	31.990	97,569.500
FERROVIAL SA	9,800	9.123	89,405.400
DISTRIBUIDORA INTERNACION	18,700	3.180	59,466.000
BANKIA SA	22,200	3.627	80,519.400
UPM-KYMMENE OYJ	15,050	7.815	117,615.750
NOKIA OYJ	97,650	3.646	356,031.900
WARTSILA OYJ	4,700	21.160	99,452.000
STORA ENSO OYJ-R SHS	17,750	4.132	73,343.000
METSO OYJ	3,750	25.940	97,275.000
ELISA OYJ-A SHARES	4,550	15.590	70,934.500
SAMPO OYJ-A SHS	12,250	18.230	223,317.500
FORTUM OYJ	12,150	15.660	190,269.000
KESKO OYJ-B SHS	1,950	23.490	45,805.500
KONE OYJ-B	4,250	38.830	165,027.500
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,800	22.580	85,804.000
NESTE OIL OYJ	4,300	7.540	32,422.000
POHJOLA BANK PLC	4,800	7.105	34,104.000
VERBUND AG	2,100	18.925	39,742.500
IMMOFINANZ AG	24,000	2.190	52,560.000
OMV AG	4,850	23.270	112,859.500
ERSTE GROUP BANK AG	4,750	12.170	57,807.500
TELEKOM AUSTRIA AG	11,000	9.010	99,110.000
VOESTALPINE AG	2,850	20.085	57,242.250
RAIFFEISEN BANK INTERNATI	1,900	18.815	35,748.500
VIENNA INSURANCE GROUP	1,000	28.305	28,305.000
PORTUGAL TELECOM SGPS SA	20,300	4.524	91,837.200
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,050	2.371	128,152.550
GALP ENERGIA SGPS SA-B	6,700	11.400	76,380.000
EDP RENOVAVEIS SA	7,700	4.540	34,958.000
HELLENIC TELECOMMUN ORGAN	7,600	2.780	21,128.000
NATIONAL BANK OF GREECE	23,813	1.590	37,862.670
ELAN CORPORATION PLC	14,200	9.153	129,972.600
KERRY GROUP PLC-A	4,600	28.250	129,950.000
CRH PLC	20,400	13.390	273,156.000
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	16,300	1.050	17,115.000
COCA-COLA HELLENIC BOTTLI	4,800	12.320	59,136.000
OPAP SA	6,100	6.680	40,748.000
ユーロ 小計	株 5,027,087		ユーロ 52,421,480.290 (5,316,062,316)
香港・ドル	株	香港・ドル	香港・ドル
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	43,500	56.950	2,477,325.000
GALAXY ENTERTAINMENT	35,000	14.420	504,700.000
MTR CORP	42,500	24.750	1,051,875.000
SUN HUNG KAI PROPERTIES	40,000	93.750	3,750,000.000
HOPEWELL HOLDINGS	21,000	19.960	419,160.000
SINO LAND	88,000	10.120	890,560.000
CHEUNG KONG	36,000	90.150	3,245,400.000
WHARF HOLDINGS	43,000	33.850	1,455,550.000
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	20,000	92.800	1,856,000.000
CLP HOLDINGS LIMITED	52,500	66.050	3,467,625.000
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	13.280	544,480.000
HUTCHISON WHAMPOA	55,300	65.000	3,594,500.000

HENDERSON LAND DEVELOPMNT	36,000	36.900	1,328,400.000
HANG LUNG GROUP LTD	25,000	42.200	1,055,000.000
HK & CHINA GAS	118,531	17.700	2,097,998.700
HANG SENG BANK	19,200	92.900	1,783,680.000
WHEELLOCK & CO	25,000	18.460	461,500.000
NEW WORLD DEVELOPMENT	115,000	6.300	724,500.000
WING HANG BANK LIMITED	6,000	61.400	368,400.000
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,500	41.500	269,750.000
HONG KONG EX & CL	28,900	124.900	3,609,610.000
LI & FUNG LTD	150,000	14.720	2,208,000.000
HANG LUNG PROPERTIES LTD	63,000	22.200	1,398,600.000
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	87.250	567,125.000
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	24.150	507,150.000
NWS HOLDINGS LTD	46,500	10.740	499,410.000
KERRY PROPERTIES LTD	22,500	25.250	568,125.000
BANK OF EAST ASIA	51,040	27.100	1,383,184.000
SJM HOLDINGS LTD	51,000	13.260	676,260.000
AIA GROUP LTD	232,000	22.850	5,301,200.000
SANDS CHINA LTD	68,000	21.500	1,462,000.000
FOXCONN INTERNATIONAL HLD	56,000	4.880	273,280.000
SHANGRI-LA ASIA	42,000	13.220	555,240.000
BANK OF CHINA HONG KONG	106,500	18.380	1,957,470.000
WYNN MACAU LTD	40,000	19.000	760,000.000
香港・ドル 小計	株 1,853,971		香港・ドル 53,073,057.700 (531,261,308)
合計	株 29,008,963		41,136,751,524 [41,136,751,524]

## (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	2,547	328,461.120	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,887	972,782.580	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,000	383,840.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	12,200	177,144.000	
		VORNADO REALTY TRUST	4,527	336,039.210	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,000	446,800.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	19,493	270,562.840	
		KIMCO REALTY CORP	10,500	169,365.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	4,500	158,625.000	
		RAYONIER INC	3,300	137,907.000	
		VENTAS INC	7,300	386,170.000	
		PROLOGIS INC	12,262	337,327.620	
		DUKE REALTY CORP	8,000	92,480.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,700	153,765.000	
		HEALTH CARE REIT INC	5,300	275,812.000	
		HCP INC	11,200	436,912.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	99,660.000	
		MACERICH CO/THE	3,700	182,040.000	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	27,000	441,990.000	
		PUBLIC STORAGE	3,900	500,721.000	
		REGENCY CENTERS CORP	2,700	97,686.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,600	170,482.000	
	アメリカ・ドル 小計		165,916	アメリカ・ドル 6,556,572.370	

			(510,625,857)
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド
	LAND SECURITIES PLC	21,700	133,129.500
	SEGRO PLC	19,850	38,965.550
	HAMMERSON PLC	20,400	71,277.600
	BRITISH LAND CO PLC	23,400	106,399.800
	CAPITAL SHOPPING CENTRES	15,900	46,284.900
イギリス・ポンド 小計		101,250	イギリス・ポンド 396,057.350 (47,816,004)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	WESTFIELD RETAIL TRUST	81,396	204,303.960
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	51,200	94,720.000
	DEXUS PROPERTY GROUP	143,700	125,019.000
	GPT GROUP	50,460	161,472.000
	MIRVAC GROUP	93,400	118,151.000
	STOCKLAND	69,500	237,690.000
	WESTFIELD GROUP	61,796	500,547.600
	GOODMAN GROUP	205,000	114,800.000
オーストラリア・ドル 小計		756,452	オーストラリア・ドル 1,556,703.560 (120,535,557)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	CAPITAMALL TRUST	79,000	135,090.000
シンガポール・ドル 小計		79,000	シンガポール・ドル 135,090.000 (8,062,172)
ユーロ			ユーロ
	CORIO NV	1,700	53,949.500
	ICADE	800	42,120.000
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,450	312,007.500
	GECINA SA	650	37,349.000
	KLEPIERRE	3,200	66,064.000
	FONCIERE DES REGIONS	950	42,465.000
ユーロ 小計		9,750	ユーロ 553,955.000 (56,176,577)
香港・ドル			香港・ドル
	LINK REIT	72,000	2,055,600.000
香港・ドル 小計		72,000	香港・ドル 2,055,600.000 (20,576,556)
投資証券 合計			763,792,723 [763,792,723]
合計			763,792,723 [763,792,723]

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 555銘柄 投資証券 22銘柄	97.9%	2.1%	57.7%
イギリス・ポンド	株式 98銘柄 投資証券 5銘柄	99.0%	1.0%	10.9%
イスラエル・シケル	株式 7銘柄	100%	-%	0.3%
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄 投資証券 8銘柄	93.2%	6.8%	4.2%
カナダ・ドル	株式 96銘柄	100%	-%	5.7%
シンガポール・ドル	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	97.6%	2.4%	0.8%
スイス・フラン	株式 34銘柄	100%	-%	4.0%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	100%	-%	1.4%
デンマーク・クローネ	株式 11銘柄	100%	-%	0.5%
ニュージーランド・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	0.0%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	100%	-%	0.4%
ユーロ	株式 230銘柄 投資証券 6銘柄	99.0%	1.0%	12.8%
香港・ドル	株式 35銘柄 投資証券 1銘柄	96.3%	3.7%	1.3%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)



「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22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	233,391,146	177,659,220
投資証券	23,884,131,700	17,987,548,910
未収配当金	139,797,664	143,419,843
流動資産合計	24,257,320,510	18,308,627,973
資産合計	24,257,320,510	18,308,627,973
負債の部		
流動負債		
未払金	205,398,490	1,362,794
未払解約金	1,100,000	70,000,000
流動負債合計	206,498,490	71,362,794
負債合計	206,498,490	71,362,794
純資産の部		
元本等		
元本	1 21,026,889,156	19,205,025,479
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 3,023,932,864	967,760,300
元本等合計	24,050,822,020	18,237,265,179
純資産合計	24,050,822,020	18,237,265,179
負債純資産合計	24,257,320,510	18,308,627,973

## 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21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19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。	投資証券  同左
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。	受取配当金 同左

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	20,901,191,070円	21,026,889,156円

同期中における追加設定元本額	1,935,167,646円	1,361,133,030円
同期中における一部解約元本額	1,809,469,560円	3,182,996,707円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワJ - REITオープン	6,903,092,175円	5,969,259,752円
ダイワJ - REITオープン（毎月分配型）	13,346,524,432円	12,437,640,997円
DC・ダイワJ - REITオープン	774,299,293円	794,238,705円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	1,696,436円	2,134,627円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	1,226,221円	1,648,624円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	50,599円	102,774円
計	21,026,889,156円	19,205,025,479円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	21,026,889,156口	19,205,025,479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967,760,300円であります。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19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。	同左
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。	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。	同左

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。	同左
----------------------------	--	----

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19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	同左
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。	(1)有価証券 同左  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

## (追加情報)

自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間（平成21年12月19日から平成22年12月20日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成22年12月20日現在	平成23年12月19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	3,395,679,125	2,122,265,038
合計	3,395,679,125	2,122,265,038

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年9月16日から平成22年12月20日まで、及び平成23年9月16日から平成23年12月19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22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
該当事項はありません。	同左

## (1口当たり情報)

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1438円 (11,438円)	0.9496円 (9,496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	1,187	633,858,000	
	M I Dリート投資法人	1,119	212,050,500	
	森ヒルズリート	1,411	350,774,600	
	野村不レジデンシャル	901	297,780,500	
	産業ファンド	571	222,690,000	
	アドバンス・レジデンス	5,973	867,279,600	
	日本ビルファンド	3,526	2,376,524,000	
	ジャパンリアルエステイト	2,981	1,827,353,000	
	日本リテールファンド	11,459	1,308,617,800	
	オリックス不動産投資	1,734	556,614,000	
	日本プライムリアルティ	4,358	835,864,400	
	プレミア投資法人	1,181	294,659,500	
	東急リアル・エステート	1,032	394,224,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	591	288,408,000	
	野村不動産オフィスF	1,860	747,720,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	12,819	1,057,567,500	
	森トラスト総合リート	1,475	879,100,000	
	インヴィンシブル投資法人	2,440	16,274,800	
	フロンティア不動産投資	1,182	777,756,000	
	平和不動産リート	4,241	152,676,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	902	586,300,000	
	福岡リート投資法人	750	378,000,000	
	ケネディクス不動産投資法人	1,746	380,628,000	
	積水ハウス・S I 投資法人	701	206,304,300	
	いちご不動産投資法人	5,137	140,651,060	
	大和証券オフィス投資法人	2,412	385,920,000	
	阪急リート投資法人	520	169,780,000	
	スターツプロシード投資法人	658	65,734,200	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	644	104,199,200	
	トップリート投資法人	945	321,772,500	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	958	461,756,000		
日本ホテルファンド投資法人	354	63,967,800		
日本賃貸住宅投資法人	8,111	260,768,650		
ジャパンエクセレント投資法人	1,150	363,975,000		
投資証券 合計		87,029	17,987,548,910	
合計		87,029	17,987,548,910	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	5,420,263	4,230,748
コール・ローン	8,169,266	4,287,612
投資証券	509,323,795	476,896,312
派生商品評価勘定	72,912	-
未収入金	22,858,443	412,106
未収配当金	981,309	1,218,354
流動資産合計	546,825,988	487,045,132
資産合計	546,825,988	487,045,132
負債の部		
流動負債		
未払金	410,046	-
未払解約金	20,000,000	-
流動負債合計	20,410,046	-
負債合計	20,410,046	-
純資産の部		
元本等		
元本	1 574,332,197	554,892,740
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 47,916,255	67,847,608
元本等合計	526,415,942	487,045,132
純資産合計	526,415,942	487,045,132
負債純資産合計	546,825,988	487,045,132

## 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21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)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、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。  (2)投資証券	投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	同左
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引
	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	同左
3. 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、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。	受取配当金 同左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準  外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	外貨建取引等の処理基準  同左

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在

1.	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	555,489,212円	574,332,197円
	同期中における追加設定元本額	136,458,903円	144,942,314円
	同期中における一部解約元本額	117,615,918円	164,381,771円
	同期末における元本の内訳		
	ファンド名		
	ダイワ・グローバルREITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	295,142,038円	176,575,383円
	ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	19,503,885円	- 円
	DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	256,207,923円	374,085,265円
	DCダイワ・ターゲットイヤー2020	1,917,689円	2,329,216円
	DCダイワ・ターゲットイヤー2030	1,499,865円	1,808,284円
	DCダイワ・ターゲットイヤー2040	60,797円	94,592円
	計	574,332,197円	554,892,740円
2.	本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	574,332,197口	554,892,740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47,916,255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67,847,608円であります。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19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。	同左
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。	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、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。



3. 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。	同左
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22年12月20日現在	平成23年12月19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	同左
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。	(1)有価証券 同左  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

## (追加情報)

自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間（平成21年12月19日から平成22年12月20日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	

## (有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
--	---------------	---------------

種 類	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	1,084,636	14,393,032
合計	1,084,636	14,393,032

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年12月1日から平成22年12月20日まで、及び平成23年12月1日から平成23年12月19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22年12月20日 現在				平成23年12月19日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	18,702,689	-	18,639,620	63,069	-	-	-	-
アメリカ・ドル	11,793,166	-	11,769,800	23,366	-	-	-	-
オーストラリア	2,493,390	-	2,490,300	3,090	-	-	-	-
ア・ドル カナダ・ドル	586,867	-	581,070	5,797	-	-	-	-
ユーロ	3,341,916	-	3,312,000	29,916	-	-	-	-
香港・ドル	487,350	-	486,450	900	-	-	-	-
買 建	4,277,727	-	4,287,570	9,843	-	-	-	-
アメリカ・ドル	4,277,727	-	4,287,570	9,843	-	-	-	-
合計	22,980,416	-	22,927,190	72,912	-	-	-	-

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在

本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9166円 (9,166円)	0.8777円 (8,777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	500	9,315.000	
		EXCEL TRUST INC	200	2,360.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,100	141,856.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,347	412,818.980	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,700	163,132.000	
		BIOMED REALTY TRUST INC	1,500	26,790.000	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	1,455	31,719.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	6,977	101,306.040	
		VORNADO REALTY TRUST	2,164	160,633.720	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,400	189,890.000	
		ENTERTAINMENT PROPERTIES	500	21,330.000	
		CHATHAM LODGING TRUST	200	2,116.000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	400	6,132.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	8,000	111,040.000	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY	700	16,478.000	
		CORESITE REALTY CORP	200	3,552.000	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES	200	2,610.000	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES	400	3,984.000	
		KIMCO REALTY CORP	4,700	75,811.000	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TR	2,000	34,060.000	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES	300	2,820.000	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	300	12,201.000	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	400	8,232.000	
		STAG INDUSTRIAL INC	200	2,230.000	
		VENTAS INC	3,279	173,459.100	
		UMH PROPERTIES	200	1,788.000	
		TERRENO REALTY CORP	100	1,439.000	
		SUN COMMUNITIES INC	200	7,066.000	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY	500	7,800.000	
		ACADIA REALTY TRUST	511	10,010.490	
		PROLOGIS INC	5,246	144,317.460	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ	700	46,382.000	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	1,700	14,977.000	
		SAUL CENTERS INC	100	3,507.000	
		BRE PROPERTIES-CL A	900	43,839.000	
		CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	1,645	25,333.000	
		MACK-CALI REALTY CORP	1,000	25,860.000	
		COLONIAL PROPERTIES TRUST	1,000	19,870.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	800	47,360.000	
		COUSINS PROPERTIES INC	1,358	8,338.120	
		DDR CORP	2,456	28,268.560	
		DUKE REALTY CORP	2,900	33,524.000	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	300	12,561.000	

EQUITY ONE INC	600	9,888.000
ESSEX PROPERTY TRUST INC	400	55,016.000
FELCOR LODGING TRUST INC	1,400	3,626.000
FIRST INDUSTRIAL REALTY	800	7,608.000
FEDERAL REALTY INVS TRUST	700	63,315.000
GLIMCHER REALTY TRUST	1,000	8,940.000
GETTY REALTY CORP	300	4,014.000
HEALTH CARE REIT INC	2,100	109,284.000
HCP INC	4,700	183,347.000
HIGHWOODS PROPERTIES INC	800	23,328.000
HOME PROPERTIES INC	500	28,330.000
HOSPITALITY PROPERTIES	1,400	31,276.000
HEALTHCARE REALTY TRUST	800	14,256.000
COMMONWEALTH REIT	875	14,595.000
KILROY REALTY CORP	700	25,641.000
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,000	22,550.000
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,300	39,260.000
LTC PROPERTIES INC	400	11,844.000
LEXINGTON REALTY TRUST	1,400	10,430.000
MID-AMERICA APARTMENT COM	400	24,084.000
MACERICH CO/THE	1,500	73,800.000
EQUITY LIFESTYLE PROPERTI	400	25,988.000
MPG OFFICE TRUST INC	500	1,010.000
MISSION WEST PROPERTIES	200	1,576.000
NATL HEALTHINVESTORS INC	300	13,263.000
NATIONAL RETAIL PROPERTIE	1,100	28,556.000
REALTY INCOME CORP	1,500	51,870.000
CORPORATE OFFICE PROPERTI	800	17,256.000
PENN REAL ESTATE INVEST	800	8,104.000
PARKWAY PROPERTIES INC	300	2,919.000
POST PROPERTIES INC	600	25,296.000
PUBLIC STORAGE	1,600	205,424.000
PS BUSINESS PARKS INC/CA	200	10,856.000
REGENCY CENTERS CORP	1,100	39,798.000
RAMCO-GERSHENSON PROPERTI	400	3,764.000
TANGER FACTORY OUTLET CEN	1,000	28,780.000
SL GREEN REALTY CORP	1,000	65,350.000
SENIOR HOUSING PROP TRUST	1,700	37,570.000
TAUBMAN CENTERS INC	700	43,120.000
URSTADT BIDDLE-CL A	300	5,133.000
UDR INC	2,500	61,475.000
UNIVERSAL HEALTH RLTY INC	100	3,741.000
WASHINGTON REAL ESTATE IN	800	21,424.000
WEINGARTEN REALTY INVESTO	1,400	29,848.000
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	700	5,544.000
AGREE REALTY CORP	100	2,442.000
OMEGA HEALTHCARE INVESTOR	1,200	22,800.000
INLAND REAL ESTATE CORP	1,000	7,310.000
STRATEGIC HOTELS&RESORTS	2,000	10,100.000
CUBESMART	1,000	10,270.000
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	1,347	9,738.810
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,200	78,684.000
CEDAR REALTY TRUST	700	2,856.000
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,100	26,037.000
FIRST POTOMAC REALTY TRUS	600	7,572.000
WINTHROP REALTY TRUST	300	2,916.000
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,800	8,352.000

	INVESTORS REAL ESTATE TRU	1,000	7,440.000
	KITE REALTY GROUP TRUST	800	3,544.000
	MONMOUTH REIT-CLASS A	400	3,600.000
	ONE LIBERTY PROPERTIES IN	100	1,697.000
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITI	800	32,416.000
	EDUCATION REALTY TRUST	700	6,790.000
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	100	1,723.000
	DIAMONDROCK HOSPITALITY	1,942	17,905.240
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	1,400	13,370.000
	CAPLEASE INC	700	2,947.000
	FRANKLIN STREET PROPERTIE	800	8,424.000
	DOUGLAS EMMETT	1,500	27,360.000
	COGDELL SPENCER INC	700	2,534.000
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	2,700	13,095.000
アメリカ・ドル 小計		134,802	アメリカ・ドル 4,032,136.520 (314,022,792)
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド
	LAND SECURITIES PLC	8,950	54,908.250
	SEGRO PLC	8,650	16,979.950
	HAMMERSON PLC	8,250	28,825.500
	BRITISH LAND CO PLC	10,350	47,061.450
	GREAT PORTLAND ESTATES PL	3,800	12,084.000
	CAPITAL SHOPPING CENTRES	6,950	20,231.450
	DERWENT LONDON PLC	1,000	15,320.000
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	730	2,263.000
	WORKSPACE GROUP PLC	1,270	2,794.000
	SHAFTESBURY PLC	2,800	13,014.400
	BIG YELLOW GROUP PLC	1,500	3,615.000
	LONDON & STAMFORD PROPERT	6,750	7,182.000
	METRIC PROPERTY INVESTMEN	2,700	2,381.400
イギリス・ポンド 小計		63,700	イギリス・ポンド 226,660.400 (27,364,710)
イスラエル・シュケル			イスラエル・シュケル
	REIT 1 LTD	900	5,829.300
イスラエル・シュケル 小計		900	イスラエル・シュケル 5,829.300 (119,850)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	CROMWELL PROPERTY GROUP	10,050	6,733.500
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	3,000	8,070.000
	WESTFIELD RETAIL TRUST	33,000	82,830.000
	TISHMAN SPEYER OFFICE FUN	3,000	1,515.000
	BWP TRUST	4,500	8,122.500
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	27,500	50,875.000
	COMMONWEALTH PROPERTY OFF	26,500	25,572.500
	DEXUS PROPERTY GROUP	58,500	50,895.000
	GPT GROUP	20,000	64,000.000
	INVESTA OFFICE FUND	34,500	20,872.500
	CHARTER HALL RETAIL REIT	3,000	9,900.000
	CHARTER HALL OFFICE REIT	5,000	17,900.000
	MIRVAC GROUP	40,000	50,600.000
	STOCKLAND	28,000	95,760.000

	WESTFIELD GROUP	24,000	194,400.000
	ABACUS PROPERTY GROUP	3,300	6,600.000
	GOODMAN GROUP	80,500	45,080.000
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROU	500	1,085.000
	CHARTER HALL GROUP	2,950	6,165.500
	ALE PROPERTY GROUP	2,000	4,200.000
	ASPEN GROUP	7,000	3,150.000
	CHALLENGER DIVERSIFIED PR	7,857	3,967.780
オーストラリア・ドル 小計		424,657	オーストラリア・ドル 758,294.280 (58,714,726)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	ARTIS REAL ESTATE INVESTM	500	6,870.000
	TRANSGLOBE APARTMENT REIT	300	3,540.000
	CANMARC REAL ESTATE INVES	300	4,878.000
	NORTHWEST HEALTHCARE PROP	100	1,101.000
	WHITEROCK REAL ESTATE INV	150	1,974.000
	BROOKFIELD OFFICE PROP-U	100	2,416.000
	CALLOWAY REAL ESTATE INVE	600	15,618.000
	CAN APARTMENT PROP REAL	400	9,000.000
	CAN REAL ESTATE INVEST TR	400	14,464.000
	CHARTWELL SENIORS HOUSING	1,000	8,390.000
	COMINAR REAL ESTATE INV-T	400	8,812.000
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-	800	18,640.000
	INNVEST REAL ESTATE INVES	500	2,250.000
	MORGUARD REAL ESTATE-TR U	300	4,731.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVST	1,500	38,865.000
	DUNDEE REAL ESTATE INVEST	300	9,828.000
	BOARDWALK REAL ESTATE INV	300	14,991.000
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA	400	8,128.000
	NORTHERN PROPERTY REAL ES	200	5,902.000
	CROMBIE REAL ESTATE INVES	200	2,616.000
	ALLIED PROPERTIES REAL ES	300	7,302.000
	EXTENDICARE REAL ESTATE I	500	4,045.000
カナダ・ドル 小計		9,550	カナダ・ドル 194,361.000 (14,553,751)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	FIRST REAL ESTATE INVT TR	6,000	4,500.000
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRI	4,400	4,114.000
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	23,000	24,035.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	19,000	35,435.000
	CAPITAMALL TRUST	29,000	49,590.000
	SUNTEC REIT	24,000	26,280.000
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	14,000	11,620.000
	K-REIT ASIA	7,400	6,068.000
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	6,960	5,150.400
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	7,000	6,860.000
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUS	14,779	7,020.020
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	7,000	10,955.000
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	5,000	7,275.000
	STARHILL GLOBAL REIT	19,000	10,735.000
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	4,000	4,520.000
	SAIZEN REIT	11,000	1,551.000
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	4,000	7,000.000
	LIPPO MALLS INDONESIA RET	14,000	4,760.000

	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUS	11,880	12,889.800
	CACHE LOGISTICS TRUST	6,000	5,640.000
	MAPLETREE COMMERCIAL TR	12,000	10,080.000
シンガポール・ドル 小計		249,419	シンガポール・ドル 256,078.220 (15,282,748)
ニュージーランド ・ドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	3,000	3,690.000
	ARGOSY PROPERTY TRUST	6,500	5,200.000
	KIWI INCOME PROPERTY TRU	12,000	12,360.000
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY	3,500	3,815.000
	GOODMAN PROPERTY TRUST	9,500	9,357.500
ニュージーランド・ドル 小計		34,500	ニュージーランド・ドル 34,422.500 (2,035,403)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT	650	5,102.500
	HAMBORNER REIT AG	400	2,483.200
	WERELDHAVE NV	250	12,363.750
	CORIO NV	1,050	33,321.750
	EUROCOMMERCIAL -CVA	450	10,287.000
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS	624	5,401.340
	VASTNED RETAIL NV	200	5,921.000
	ICADE	250	13,162.500
	ANF	150	3,967.500
	ALTAREA	20	2,400.000
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,050	133,717.500
	GECINA SA	300	17,238.000
	KLEPIERRE	1,100	22,709.500
	FONCIERE DES REGIONS	450	20,115.000
	SILIC	100	6,674.000
	STE DE LA TOUR EIFFEL	50	1,715.000
	MERCIALYS	550	12,738.000
	AEDIFICA	100	4,350.000
	COFINIMMO	150	13,047.000
	BEFIMMO S.C.A	150	7,424.250
	INTERVEST OFFICES&WAREHOU	100	1,815.000
WAREHOUSES DE PAUW SCA	133	5,046.020	
BENI STABILI SPA	10,100	2,949.200	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRI	1,800	1,294.200	
EUROBANK PROPERTIES REAL	200	716.000	
ユーロ 小計		20,377	ユーロ 345,959.210 (35,083,723)
香港・ドル	YUEXIU REIT ASSET MANAGEM	9,000	30,510.000
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVE	14,000	30,380.000
	FORTUNE REIT	13,000	48,620.000
	PROSPERITY REIT	13,000	19,240.000
	LINK REIT	26,000	742,300.000
	REGAL REAL ESTATE INV	8,000	14,000.000
	CHAMPION REIT	29,000	85,840.000
香港・ドル 小計		112,000	香港・ドル 970,890.000 (9,718,609)
投資証券 合計			476,896,312

		[476,896,312]	
合計		476,896,312	[476,896,312]

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 114銘柄	100%	65.9%
イギリス・ポンド	投資証券 13銘柄	100%	5.7%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	100%	0.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 22銘柄	100%	12.3%
カナダ・ドル	投資証券 22銘柄	100%	3.1%
シンガポール・ドル	投資証券 21銘柄	100%	3.2%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 25銘柄	100%	7.4%
香港・ドル	投資証券 7銘柄	100%	2.0%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)



## 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	70,116,829	57,462,319
国債証券	6,901,001,560	7,423,993,600
地方債証券	1,290,933,060	1,056,055,443
特殊債券	1,698,835,297	1,359,843,757
社債券	1,692,541,959	1,645,633,070
未収利息	29,006,861	48,866,359
前払費用	1,978,096	3,615,898
流動資産合計	11,684,413,662	11,595,470,446
資産合計	11,684,413,662	11,595,470,446
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,618,000	-
流動負債合計	1,618,000	-
負債合計	1,618,000	-
純資産の部		
元本等		
元本	10,613,829,095	10,296,043,254
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,068,966,567	1,299,427,192
元本等合計	11,682,795,662	11,595,470,446
純資産合計	11,682,795,662	11,595,470,446
負債純資産合計	11,684,413,662	11,595,470,446

## 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21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19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。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	11,162,111,940円	10,613,829,095円

同期中における追加設定元本額	1,467,673,433円	2,148,257,758円
同期中における一部解約元本額	2,015,956,278円	2,466,043,599円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ・ライフ・バランス30	2,109,564,101円	2,340,902,165円
ダイワ・ライフ・バランス50	127,154,890円	474,405,764円
ダイワ・ライフ・バランス70	35,628,101円	122,814,940円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	145,174,361円	193,871,212円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	103,756,755円	123,148,571円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	21,829,310円	27,098,910円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	10,659,373円	12,717,017円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	3,086,295円	3,824,343円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	42,091円	73,716円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	4,304,952,267円	3,765,413,977円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	380,741,554円	330,890,183円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド50VA	1,017,025,001円	944,368,105円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド75VA	2,354,214,996円	1,956,514,351円
計	10,613,829,095円	10,296,043,254円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	10,613,829,095口	10,296,043,254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21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19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。	同左
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。	同左

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。	同左
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。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19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	同左
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。	(1)有価証券 同左  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

## (追加情報)

自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間（平成21年12月19日から平成22年12月20日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成22年12月20日現在	平成23年12月19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	325,260	54,916,300
地方債証券	850,558	1,620,589
特殊債券	1,198,099	2,104,627
社債券	1,165,166	654,744
合計	2,888,563	57,986,772

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成22年12月1日から平成22年12月20日まで、及び平成23年12月1日から平成23年12月19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22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
該当事項はありません。	同左

(1口当たり情報)

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1007円 (11,007円)	1.1262円 (11,262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	303 2年国債	90,000,000	90,088,200	
	305 2年国債	100,000,000	100,110,000	
	310 2年国債	30,000,000	30,042,600	
	72 5年国債	25,000,000	25,514,000	
	75 5年国債	86,000,000	87,467,160	
	76 5年国債	13,000,000	13,244,400	
	77 5年国債	105,000,000	106,608,600	
	78 5年国債	50,000,000	50,770,500	
	79 5年国債	4,000,000	4,045,720	
	83 5年国債	30,000,000	30,558,600	
	85 5年国債	10,000,000	10,144,800	
	86 5年国債	140,000,000	141,643,600	
	87 5年国債	120,000,000	121,107,600	
	88 5年国債	80,000,000	80,733,600	
	89 5年国債	23,000,000	23,131,330	
	91 5年国債	23,000,000	23,123,510	
	92 5年国債	114,000,000	114,189,240	
	93 5年国債	3,000,000	3,026,670	
	94 5年国債	18,000,000	18,231,120	
	95 5年国債	155,000,000	156,979,350	
	96 5年国債	56,000,000	56,480,480	
	97 5年国債	130,000,000	130,517,400	
	98 5年国債	41,000,000	40,981,550	
	1 40年国債	24,000,000	25,989,600	
	2 40年国債	25,000,000	25,710,250	
	3 40年国債	19,000,000	19,485,450	
	4 40年国債	14,000,000	14,316,540	
	252 10年国債	35,000,000	35,458,850	
	254 10年国債	8,000,000	8,178,320	
	256 10年国債	14,000,000	14,355,040	

257	10年国債	15,000,000	15,350,550
268	10年国債	10,000,000	10,415,200
269	10年国債	14,000,000	14,491,120
270	10年国債	8,000,000	8,296,560
272	10年国債	105,000,000	109,480,350
274	10年国債	11,000,000	11,534,600
275	10年国債	30,000,000	31,339,500
276	10年国債	25,000,000	26,314,000
277	10年国債	58,000,000	61,183,040
278	10年国債	20,000,000	21,265,200
279	10年国債	2,000,000	2,143,720
280	10年国債	3,000,000	3,212,790
286	10年国債	45,000,000	48,438,000
287	10年国債	66,000,000	71,397,480
288	10年国債	127,000,000	136,232,900
289	10年国債	140,000,000	148,709,400
290	10年国債	55,000,000	58,136,100
291	10年国債	39,000,000	40,987,440
292	10年国債	47,000,000	50,550,850
293	10年国債	9,000,000	9,747,990
294	10年国債	28,000,000	30,150,960
295	10年国債	26,000,000	27,661,140
296	10年国債	99,000,000	105,355,800
297	10年国債	16,000,000	16,927,360
298	10年国債	39,000,000	40,983,540
299	10年国債	112,000,000	117,685,120
300	10年国債	20,000,000	21,308,200
301	10年国債	25,000,000	26,613,250
302	10年国債	23,000,000	24,310,540
303	10年国債	110,000,000	116,125,900
304	10年国債	48,000,000	50,300,640
305	10年国債	167,000,000	174,717,070
306	10年国債	65,000,000	68,385,200
307	10年国債	77,000,000	80,411,100
308	10年国債	41,000,000	42,749,060
309	10年国債	103,000,000	105,666,670
310	10年国債	120,000,000	121,812,000
311	10年国債	31,000,000	30,936,760
312	10年国債	170,000,000	174,970,800
313	10年国債	85,000,000	88,050,650
314	10年国債	59,000,000	60,057,870
315	10年国債	54,000,000	55,319,760
316	10年国債	72,000,000	73,131,120
317	10年国債	38,000,000	38,525,540
318	10年国債	120,000,000	120,534,000
2	30年国債	9,000,000	10,020,330
3	30年国債	4,000,000	4,388,760
4	30年国債	8,000,000	9,558,480
5	30年国債	8,000,000	8,634,080
6	30年国債	9,000,000	10,019,160
7	30年国債	7,000,000	7,665,350
8	30年国債	4,000,000	4,033,680
9	30年国債	11,000,000	10,313,820
10	30年国債	12,000,000	10,587,120
11	30年国債	12,000,000	11,850,720
12	30年国債	8,000,000	8,460,960
13	30年国債	9,000,000	9,342,450

14	30年国債	13,000,000	14,445,210
15	30年国債	15,000,000	16,966,350
16	30年国債	9,000,000	10,189,350
17	30年国債	11,000,000	12,232,440
18	30年国債	13,000,000	14,228,240
19	30年国債	15,000,000	16,414,350
20	30年国債	12,000,000	13,578,000
21	30年国債	11,000,000	12,012,220
22	30年国債	12,000,000	13,578,000
23	30年国債	14,000,000	15,868,160
24	30年国債	10,000,000	11,314,600
25	30年国債	15,000,000	16,391,700
26	30年国債	29,000,000	32,271,780
27	30年国債	26,000,000	29,487,120
28	30年国債	28,000,000	31,776,360
29	30年国債	38,000,000	42,345,300
30	30年国債	40,000,000	43,695,600
31	30年国債	38,000,000	40,624,660
32	30年国債	40,000,000	43,540,800
33	30年国債	49,000,000	50,003,520
34	30年国債	45,000,000	47,807,100
35	30年国債	27,000,000	27,434,700
30	利付国債20年	16,000,000	18,056,320
32	利付国債20年	8,000,000	9,147,440
33	利付国債20年	5,000,000	5,817,350
36	利付国債20年	33,000,000	37,839,780
37	利付国債20年	5,000,000	5,761,400
38	利付国債20年	11,000,000	12,502,380
39	20年国債	32,000,000	36,187,520
40	20年国債	51,000,000	56,971,080
41	20年国債	40,000,000	42,601,600
42	20年国債	13,000,000	14,860,950
43	20年国債	14,000,000	16,371,040
44	20年国債	24,000,000	27,355,200
45	20年国債	20,000,000	22,657,800
46	20年国債	19,000,000	21,200,960
47	20年国債	23,000,000	25,674,440
48	20年国債	9,000,000	10,279,800
49	20年国債	4,000,000	4,428,600
50	20年国債	30,000,000	32,672,400
51	20年国債	25,000,000	27,465,750
52	20年国債	19,000,000	21,052,570
53	20年国債	13,000,000	14,390,870
54	20年国債	14,000,000	15,632,960
55	20年国債	21,000,000	23,036,790
56	20年国債	12,000,000	13,158,240
57	20年国債	19,000,000	20,643,500
58	20年国債	19,000,000	20,629,060
59	20年国債	27,000,000	28,729,620
60	20年国債	12,000,000	12,389,520
61	20年国債	19,000,000	18,781,690
62	20年国債	12,000,000	11,561,880
63	20年国債	24,000,000	25,714,080
64	20年国債	21,000,000	22,688,400
65	20年国債	24,000,000	25,910,880
66	20年国債	6,000,000	6,411,060
67	20年国債	10,000,000	10,781,600

68	20年国債	11,000,000	12,226,170
69	20年国債	27,000,000	29,688,660
70	20年国債	16,000,000	18,125,280
71	20年国債	25,000,000	27,746,000
72	20年国債	37,000,000	40,613,790
73	20年国債	15,000,000	16,257,600
74	20年国債	19,000,000	20,828,560
75	20年国債	14,000,000	15,325,800
76	20年国債	21,000,000	22,473,990
77	20年国債	9,000,000	9,744,660
78	20年国債	17,000,000	18,170,790
79	20年国債	12,000,000	12,979,080
80	20年国債	15,000,000	16,405,650
81	20年国債	10,000,000	10,803,700
82	20年国債	33,000,000	36,057,450
83	20年国債	28,000,000	30,525,600
84	20年国債	21,000,000	22,646,610
85	20年国債	30,000,000	32,667,900
86	20年国債	6,000,000	6,688,800
87	20年国債	15,000,000	16,522,800
88	20年国債	26,000,000	28,941,380
89	20年国債	23,000,000	25,308,280
90	20年国債	36,000,000	39,568,320
91	20年国債	13,000,000	14,456,390
92	20年国債	44,000,000	47,698,640
93	20年国債	3,000,000	3,205,950
94	20年国債	48,000,000	51,959,040
95	20年国債	28,000,000	31,050,040
96	20年国債	20,000,000	21,617,200
97	20年国債	16,000,000	17,493,280
98	20年国債	29,000,000	31,295,930
99	20年国債	50,000,000	53,869,500
100	20年国債	32,000,000	34,879,680
101	20年国債	14,000,000	15,665,860
102	20年国債	23,000,000	25,719,750
103	20年国債	18,000,000	19,877,580
104	20年国債	14,000,000	15,041,040
105	20年国債	35,000,000	37,559,200
106	20年国債	16,000,000	17,405,760
107	20年国債	12,000,000	12,861,720
108	20年国債	43,000,000	44,813,310
109	20年国債	25,000,000	26,013,500
110	20年国債	26,000,000	27,831,700
111	20年国債	14,000,000	15,179,080
112	20年国債	55,000,000	58,798,300
113	20年国債	65,000,000	69,395,300
114	20年国債	44,000,000	46,909,720
115	20年国債	20,000,000	21,646,200
116	20年国債	23,000,000	24,860,700
117	20年国債	43,000,000	45,809,190
118	20年国債	13,000,000	13,625,300
119	20年国債	29,000,000	29,490,970
120	20年国債	32,000,000	31,527,360
121	20年国債	57,000,000	58,787,520
122	20年国債	10,000,000	10,149,300
123	20年国債	36,000,000	38,287,440
124	20年国債	33,000,000	34,545,390

	1 2 5	20年国債	22,000,000	23,732,280	
	1 2 6	20年国債	19,000,000	19,869,630	
	1 2 7	20年国債	20,000,000	20,609,800	
	1 2 8	20年国債	28,000,000	28,798,560	
	1 2 9	20年国債	26,000,000	26,341,900	
	1 3 0	20年国債	45,000,000	45,530,550	
	1 3 1	20年国債	25,000,000	24,871,250	
国債証券 合計			7,061,000,000	7,423,993,600	
地方債証券	5 9 5	東京都公債	67,000,000	67,539,618	
	6 0 4	東京都公債	10,000,000	10,267,120	
	6 2 4	東京都公債	100,000,000	104,263,000	
	2 9 3	大阪府公債	100,000,000	107,731,500	
	2 1 - 2	埼玉県公債	100,000,000	106,591,900	
	1 2	共同発行地方	50,000,000	51,360,700	
	1 4	共同発行地方	36,400,000	37,536,917	
	2 0	共同発行地方	100,000,000	103,692,400	
	2 7	共同発行地方	34,000,000	35,204,688	
	3 0	共同発行地方	50,000,000	51,856,700	
	1 2 - さ	名古屋市債	100,000,000	100,616,900	
	1 2 - ゆ	名古屋市債	20,000,000	20,544,080	
	1 4 - 5	横浜市公債	20,000,000	20,148,720	
	1 8 - 4	札幌市公債	100,000,000	106,679,900	
	7 6	川崎市公債	25,000,000	25,198,700	
	1 8 - 2	北九州市債	100,000,000	106,822,600	
地方債証券 合計			1,012,400,000	1,056,055,443	
特殊債券	6	政保政策投資 B K	25,000,000	25,203,875	
	4 7	日本政策投資 B	100,000,000	102,950,100	
	3 1 7	政保道路債	100,000,000	100,528,100	
	3 1 9	政保道路債	40,000,000	40,498,200	
	3 2 3	政保道路債	85,000,000	87,268,565	
	3 2 8	政保道路債	41,000,000	42,307,982	
	3 3 3	政保道路債	21,000,000	21,829,752	
	3 3 4	政保道路債	2,000,000	2,075,024	
	2 7	政保道路機構	50,000,000	53,605,750	
	5 6	政保道路機構	100,000,000	105,526,400	
	8 2 8	政保公営企業	15,000,000	15,079,275	
	8 2 9	政保公営企業	10,000,000	10,150,310	
	8 3 1	政保公営企業	4,000,000	4,102,356	
	8 4 2	政保公営企業	5,000,000	5,213,740	
	2	政保地方公営機	100,000,000	106,889,800	
	2 6	公営企業	100,000,000	107,054,400	
	1 9 0	政保首都高速	3,000,000	3,081,921	
	1 3	首都高速道路	100,000,000	103,663,700	
	2 7	国際協力銀行	100,000,000	106,660,500	
	3 9	政保関西空港	16,000,000	16,082,768	
	5	政保中部空港	121,000,000	121,986,997	
	1 4	政保国民生活	19,000,000	19,674,842	
	2	成田国際空港	100,000,000	104,541,800	
	1	アフリカ開発銀行 S U B	50,000,000	53,867,600	
	特殊債券 合計			1,307,000,000	1,359,843,757
	社債券	2	サントリーホールディング	100,000,000	102,033,300
2 5		三菱化学	100,000,000	101,706,000	
7		小松製作所	100,000,000	102,183,600	
5 0		東芝	100,000,000	101,090,300	
1 7		ソニー	100,000,000	103,893,500	
1		明治安田 2 0 1 1 基	100,000,000	100,252,100	



9	トヨタ自動車	100,000,000	101,941,900	
6	ドン・キホーテ	100,000,000	100,000,000	
4	住友信託 劣後	100,000,000	103,302,700	
7	三井住友BK劣後	100,000,000	103,003,600	
140	オリックス	100,000,000	100,779,300	
31	三井不動産	100,000,000	103,590,200	
27	東日本旅客鉄道	100,000,000	102,130,200	
16	NTTドコモ	100,000,000	102,053,300	
378	東北電力	100,000,000	112,716,000	
261	北海道電力	3,000,000	3,310,770	
10	電源開発	100,000,000	101,646,300	
社債券 合計		1,603,000,000	1,645,633,070	
合計		10,983,400,000	11,485,525,870	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	190,117,201	37,175,393
コール・ローン	1,228,620,393	884,066,405
国債証券	99,738,177,896	103,977,680,653
派生商品評価勘定	5,044,231	544,995
未収利息	1,225,348,329	1,195,050,742
前払費用	69,745,638	37,966,877
流動資産合計	102,457,053,688	106,132,485,065
資産合計	102,457,053,688	106,132,485,065
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,938,818	9,364,916
未払解約金	14,308,000	37,161,000
流動負債合計	16,246,818	46,525,916
負債合計	16,246,818	46,525,916
純資産の部		
元本等		
元本	1 59,018,260,058	61,598,892,147
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	43,422,546,812	44,487,067,002
元本等合計	102,440,806,870	106,085,959,149
純資産合計	102,440,806,870	106,085,959,149
負債純資産合計	102,457,053,688	106,132,485,065

## 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21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券  個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券  同左
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	54,849,946,293円	59,018,260,058円
同期中における追加設定元本額	6,372,314,064円	7,363,810,077円
同期中における一部解約元本額	2,204,000,299円	4,783,177,988円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV A	3,310,298,495円	3,148,379,152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)	104,801,506円	100,208,533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)	740,675,120円	716,398,300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)	246,300,189円	219,022,709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)	2,242,346,351円	2,275,449,547円
DCダイワ外国債券インデックス ダイワ・ライフ・バランス30	24,300,839,019円	28,200,447,353円
ダイワ・ライフ・バランス50	356,147,632円	421,260,981円
	19,771,778円	77,987,625円

ダイワ・ライフ・バランス70	11,269,858円	39,979,195円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	90,863,596円	126,668,617円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	65,653,096円	80,431,958円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	13,620,596円	17,430,860円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	4,644,272円	5,452,209円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	1,482,064円	1,836,845円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	25,256円	40,519円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	3,771,518,518円	3,454,624,729円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	397,096,574円	361,405,640円
ダイワ・バランスファンド35 VA	13,783,680,238円	12,763,721,808円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド50VA	2,553,182,512円	2,454,489,323円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド75VA	2,208,311,902円	1,913,718,330円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	789,955,851円	743,294,509円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	3,941,772,583円	4,407,803,202円
ダイワライフスタイル25	22,559,688円	24,680,560円
ダイワライフスタイル50	32,301,007円	35,087,572円
ダイワライフスタイル75	9,142,357円	9,072,071円
計	59,018,260,058円	61,598,892,147円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	59,018,260,058口	61,598,892,147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21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19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。	同左

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。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。信託財産の効率的な運用に資するため、および外貨建資産の売買代金、利金、償還金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。	同左
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。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年12月20日現在	平成23年12月19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。	同左
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	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (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。	同左
--	---	----

## （追加情報）

自 平成21年12月19日 至 平成22年12月20日	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間（平成21年12月19日から平成22年12月20日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成22年12月20日現在	平成23年12月19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	1,335,091,447	2,138,079,985
合計	1,335,091,447	2,138,079,985

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年12月1日から平成22年12月20日まで、及び平成23年12月1日から平成23年12月19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22年12月20日 現在				平成23年12月19日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	158,378,204	-	157,368,322	1,009,882	-	-	-	-
アメリカ・ドル	32,087,028	-	32,030,564	56,464	-	-	-	-
イギリス・ポンド	77,552,134	-	77,091,467	460,667	-	-	-	-
カナダ・ドル	48,739,042	-	48,246,291	492,751	-	-	-	-
買 建	1,345,548,999	-	1,347,644,530	2,095,531	814,644,540	-	805,824,619	8,819,921
アメリカ・ドル	658,194,929	-	657,691,250	503,679	320,553,871	-	320,233,760	320,111
イギリス・ポンド	125,063,910	-	124,452,080	611,830	135,377,931	-	135,166,179	211,752
オーストラリア・ドル	10,094,313	-	10,355,000	260,687	11,259,247	-	11,277,040	17,793
カナダ・ドル	46,733,239	-	46,706,480	26,759	24,408,096	-	24,238,440	169,656
スイス・フラン	5,050,579	-	5,199,600	149,021	3,723,510	-	3,653,760	69,750

スウェーデン・クローナ	6,433,030	-	6,553,750	120,720	4,955,669	-	4,959,240	3,571
デンマーク・クローネ	14,798,325	-	14,820,000	21,675	6,940,370	-	6,784,050	156,320
ポーランド・ズロチ	7,707,726	-	7,925,060	217,334	5,790,762	-	5,710,210	80,552
メキシコ・ペソ	4,753,194	-	4,758,440	5,246	7,092,386	-	7,099,300	6,914
ユーロ	466,719,754	-	469,182,870	2,463,116	294,542,698	-	286,702,640	7,840,058
合計	1,503,927,203	-	1,505,012,852	3,105,413	814,644,540	-	805,824,619	8,819,921

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	平成22年12月20日現在	平成23年12月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7357円 (17,357円)	1.7222円 (17,222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	3.875% U.S. TREASURY NOTE 20130215	1,539,000.000	1,604,407.500	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20130515	1,766,000.000	1,851,809.940	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20130815	2,631,000.000	2,807,145.450	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20131115	3,059,000.000	3,293,441.760	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,868,000.000	3,097,870.200	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000	3,024,405.960	

4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	2,870,049.710	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,107,359.100	
4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	2,654,000.000	2,953,795.840	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	4,170,016.800	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,460,917.500	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,107,610.880	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,119,146.040	
5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,315,719.800	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,380,369.220	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,764,679.360	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,427,205.210	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,133,806.250	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,902,953.060	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,998,567.540	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,000,000.000	1,030,780.000	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	1,263,000.000	1,308,278.550	
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,319,000.000	1,358,715.090	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	4,387,554.710	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,500,000.000	1,545,750.000	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20130331	1,890,000.000	1,946,397.600	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130430	1,432,000.000	1,489,723.920	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,460,654.400	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	1,462,000.000	1,532,468.400	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	2,310,000.000	2,422,335.300	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,408,000.000	2,530,639.440	
4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,746,837.050	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,500,000.000	2,623,025.000	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	2,621,000.000	2,756,741.590	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20131031	2,170,000.000	2,271,794.700	
3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	6,999,000.000	8,157,614.460	
2% U.S. TREASURY NOTE 20131130	2,466,000.000	2,550,361.860	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,139,000.000	3,219,295.620	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140131	2,450,000.000	2,526,930.000	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	6,947,000.000	7,625,374.550	



1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140228	3,716,000.000	3,846,171.480	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,195,000.000	2,378,984.900	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140331	2,341,000.000	2,419,915.110	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,463,000.000	2,644,252.170	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,386,000.000	3,513,618.340	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,001,000.000	2,170,284.600	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20190515	6,144,000.000	6,905,241.600	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	4,930,000.000	5,166,245.600	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160531	621,000.000	691,489.710	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140630	2,833,000.000	2,999,325.430	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160630	2,121,000.000	2,363,748.450	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140731	3,238,000.000	3,433,899.000	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160731	1,833,000.000	2,044,216.590	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20190815	5,842,000.000	6,784,022.500	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140831	3,958,000.000	4,175,373.360	
3% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,488,000.000	2,748,244.800	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140930	3,971,000.000	4,195,599.760	
3% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,499,000.000	2,759,820.630	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20141031	4,082,000.000	4,318,592.720	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,319,000.000	2,576,803.230	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20191115	7,436,000.000	8,510,130.200	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20141130	3,594,000.000	3,780,708.300	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20161130	4,149,000.000	4,536,309.150	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20121215	3,851,000.000	3,887,854.070	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20141231	4,437,000.000	4,738,716.000	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20161231	4,011,000.000	4,485,701.850	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130115	4,644,000.000	4,704,186.240	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20150131	2,315,000.000	2,449,084.800	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170131	2,884,000.000	3,209,776.640	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130215	4,445,000.000	4,506,252.100	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20200215	5,630,000.000	6,554,952.700	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20150228	2,275,000.000	2,418,074.750	
3% U.S. TREASURY NOTE 20170228	2,687,000.000	2,976,255.550	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130315	2,898,000.000	2,941,238.160	

2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150331	2,317,000.000	2,476,293.750	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20170331	4,635,000.000	5,194,444.500	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20130415	2,877,000.000	2,936,323.740	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150430	2,218,000.000	2,372,128.820	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170430	1,653,000.000	1,843,342.950	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130515	2,259,000.000	2,296,657.530	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20200515	5,259,000.000	6,070,411.110	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20150531	2,576,000.000	2,724,120.000	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20170531	2,835,000.000	3,107,415.150	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20130615	3,097,000.000	3,139,583.750	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20150630	4,658,000.000	4,888,897.060	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20170630	3,468,000.000	3,756,260.160	
1% U.S. TREASURY NOTE 20130715	2,440,000.000	2,470,402.400	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20150731	2,386,000.000	2,494,849.320	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20170731	1,773,000.000	1,907,623.890	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20130815	3,043,000.000	3,069,839.260	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20200815	4,929,000.000	5,332,142.910	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150831	2,519,000.000	2,590,615.170	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170831	2,903,000.000	3,041,327.950	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20130915	1,878,000.000	1,895,164.920	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150930	2,568,000.000	2,638,902.480	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170930	2,831,000.000	2,965,019.540	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20131015	1,937,000.000	1,946,220.120	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20151031	1,265,000.000	1,299,382.700	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20171031	382,000.000	400,022.760	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20131115	885,000.000	889,354.200	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20201115	4,509,000.000	4,868,277.120	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,256,000.000	1,260,207.600	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20151130	3,151,000.000	3,252,399.180	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20171130	883,000.000	943,564.970	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20131215	3,091,000.000	3,121,910.000	
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	2,088,000.000	2,098,022.400	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20151231	2,515,000.000	2,674,727.650	

2.75% U.S. TREASURY NOTE 20171231	253,000.000	277,902.790	
1% U.S. TREASURY NOTE 20140115	2,967,000.000	3,012,662.130	
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,264,000.000	1,270,408.480	
2% U.S. TREASURY NOTE 20160131	635,000.000	671,804.600	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20180131	255,000.000	278,187.150	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140215	631,000.000	644,333.030	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20210215	4,076,000.000	4,742,792.840	
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,101,000.000	1,106,372.880	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,590,000.000	2,754,387.300	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20180228	1,234,000.000	1,355,943.880	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140315	2,588,000.000	2,644,599.560	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20130331	2,621,000.000	2,640,447.820	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20160331	1,300,000.000	1,389,830.000	
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20180331	1,300,000.000	1,439,230.000	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140415	1,439,000.000	1,471,535.790	
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20130430	3,349,000.000	3,369,395.410	
2% U.S. TREASURY NOTE 20160430	260,000.000	275,111.200	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20180430	260,000.000	283,561.200	
1% U.S. TREASURY NOTE 20140515	263,000.000	267,507.820	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20210515	4,417,000.000	4,940,105.310	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	659,000.000	661,958.910	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20160531	3,832,000.000	4,012,640.480	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20180531	1,322,000.000	1,419,590.040	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20140615	4,416,000.000	4,465,812.480	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	5,180,000.000	5,193,312.600	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20160630	3,406,000.000	3,526,776.760	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20180630	3,782,000.000	4,061,792.360	
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20140715	4,093,000.000	4,127,176.550	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,307,000.000	2,312,928.990	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20160731	2,053,000.000	2,124,690.760	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20180731	1,341,000.000	1,428,366.150	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,097,000.000	2,107,149.480	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20210815	1,418,000.000	1,456,768.120	
0.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,249,000.000	2,245,379.110	
1% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,108,000.000	2,132,031.200	

1.5% U.S. TREASURY NOTE 20180831	2,730,000.000	2,773,488.900	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140915	3,109,000.000	3,102,657.640	
0.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	4,193,000.000	4,185,788.040	
1% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,793,000.000	2,823,220.260	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20180930	2,835,000.000	2,851,584.750	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20141015	2,784,000.000	2,796,722.880	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20131031	4,295,000.000	4,296,975.700	
1% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,718,000.000	2,744,853.840	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20181031	1,920,000.000	1,977,734.400	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20141115	4,179,000.000	4,182,719.310	
2% U.S. TREASURY NOTE 20211115	1,353,000.000	1,370,751.360	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20131130	4,521,000.000	4,522,763.190	
11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,258,184.880	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,382,152.500	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	2,054,087.520	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,160,934.050	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,086,135.450	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,376,050.720	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,363,966.780	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,185,782.000	
8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,742,867.250	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	1,166,092.800	
7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,430,394.200	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,392,659.220	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,267,822.710	
7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	687,000.000	1,115,619.300	
6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,264,242.140	
6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,238,476.050	
6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	961,090.200	
6.625% U.S. TREASURY BOND 20270215	688,000.000	1,064,624.960	
6.375% U.S. TREASURY BOND 20270815	765,000.000	1,165,844.700	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	2,308,000.000	3,448,636.680	
5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	1,154,012.850	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,300,809.020	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	2,064,484.940	

	6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	1,010,292.660	
	6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	2,095,110.330	
	5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,324,000.000	1,898,483.600	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	2,994,836.610	
	4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	1,835,000.000	2,510,353.400	
	5% U.S. TREASURY BOND 20370515	2,877,000.000	4,077,226.860	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	2,968,000.000	3,863,712.720	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	2,767,000.000	3,672,749.780	
	3.5% U.S. TREASURY BOND 20390215	3,416,000.000	3,870,191.360	
	4.25% U.S. TREASURY BOND 20390515	2,709,000.000	3,473,208.900	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20390815	3,537,000.000	4,708,348.290	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20391115	4,554,000.000	5,953,626.360	
	4.625% U.S. TREASURY BOND 20400215	4,202,000.000	5,706,147.920	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20400515	2,169,000.000	2,836,292.850	
	3.875% U.S. TREASURY BOND 20400815	4,184,000.000	5,047,577.600	
	4.25% U.S. TREASURY BOND 20401115	3,269,000.000	4,197,069.100	
	4.75% U.S. TREASURY BOND 20410215	3,086,000.000	4,282,287.900	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20410515	3,356,000.000	4,402,367.240	
	3.75% U.S. TREASURY BOND 20410815	1,367,000.000	1,618,924.430	
	3.125% U.S. TREASURY BOND 20411115	1,289,000.000	1,359,482.520	
	アメリカ・ドル 小計	アメリカ・ドル 498,411,000.000 (38,816,248,680)	アメリカ・ドル 556,648,509.710 (43,351,785,936)	
	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	868,000.000	1,230,910.800	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130927	592,000.000	672,156.800	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	782,000.000	1,007,216.000	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	942,000.000	1,437,680.400	
	6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	1,513,000.000	2,208,828.700	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,815,000.000	2,196,331.500	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	2,873,000.000	3,232,699.600	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	2,150,794.200	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,556,644.400	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,626,147.500	

	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	2,814,000.000	3,705,756.600	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	1,778,000.000	2,188,540.200	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	1,848,000.000	2,363,037.600	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	2,475,000.000	2,829,667.500	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	2,566,769.400	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,465,000.000	1,773,675.500	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	1,604,000.000	1,958,002.800	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	2,296,474.400	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,806,000.000	2,321,793.600	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130307	2,025,000.000	2,127,870.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	2,194,000.000	2,755,664.000	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	1,820,000.000	2,189,642.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20390907	364,000.000	443,934.400	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	1,579,000.000	1,853,746.000	
	2.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140307	2,468,000.000	2,573,630.400	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20340907	1,300,000.000	1,629,940.000	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190907	2,483,000.000	2,858,926.200	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20600122	1,011,000.000	1,243,934.400	
	2.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150122	2,529,000.000	2,704,259.700	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200907	2,316,000.000	2,669,190.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20401207	2,133,000.000	2,605,886.100	
	2% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160122	3,780,000.000	3,966,732.000	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210907	2,008,000.000	2,307,593.600	
	1.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170122	1,316,000.000	1,361,138.800	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20520722	375,000.000	429,300.000	
	イギリス・ボンド 小計	イギリス・ボンド 62,766,000.000 (7,577,739,180)	イギリス・ボンド 75,044,515.100 (9,060,124,308)	
	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	6.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,423,000.000	1,487,589.970	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	1,385,000.000	1,523,126.050	
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	1,411,000.000	1,590,860.170	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	1,148,000.000	1,271,100.040	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,463,000.000	1,688,843.310	

	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20140615	1,621,000.000	1,744,601.250	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	1,928,000.000	2,039,380.560	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	793,000.000	918,983.910	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	790,000.000	826,829.800	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20160615	1,221,000.000	1,298,631.180	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20141021	1,385,000.000	1,439,015.000	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	1,441,000.000	1,602,348.770	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	356,000.000	404,736.400	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20151021	368,000.000	388,681.600	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170721	451,000.000	470,785.370	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	399,000.000	424,899.090	
	オーストラリア・ドル 小計	オーストラリア・ドル 17,583,000.000 (1,361,451,690)	オーストラリア・ドル 19,120,412.470 (1,480,493,539)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	424,000.000	683,242.080	
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	372,000.000	670,611.840	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	532,000.000	932,510.880	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,913,289.300	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	853,000.000	907,122.850	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	2,125,860.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	2,112,000.000	2,322,714.240	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,158,382.680	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,593,000.000	2,342,474.640	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	983,000.000	1,104,842.850	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	1,747,000.000	1,996,279.430	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	2,018,000.000	2,369,434.700	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	1,367,000.000	1,419,301.420	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1,341,000.000	1,543,799.430	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,608,000.000	1,690,683.360	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	724,000.000	958,090.920	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141201	1,657,000.000	1,707,538.500	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,461,000.000	1,659,827.490	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,394,000.000	1,464,369.120	

	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130301	794,000.000	802,495.800	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20151201	973,000.000	1,045,605.260	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130901	1,087,000.000	1,117,642.530	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,257,000.000	1,407,198.930	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20121201	449,000.000	451,635.630	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	629,000.000	652,436.540	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140301	1,501,000.000	1,538,555.020	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130801	376,000.000	383,065.040	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160901	761,000.000	815,616.970	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140801	268,000.000	277,331.760	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20131101	606,000.000	613,502.280	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,359,000.000	1,458,573.930	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	379,000.000	469,012.500	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140201	283,000.000	283,931.070	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170301	272,000.000	275,264.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150201	803,000.000	803,626.340	
	カナダ・ドル 小計	カナダ・ドル 35,684,000.000 (2,672,017,920)	カナダ・ドル 41,365,869.330 (3,097,476,295)	
	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20130701	486,000.000	500,531.400	
	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	589,691.200	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	508,000.000	548,629.840	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	483,000.000	569,756.460	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	788,143.440	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	320,000.000	367,024.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	297,000.000	333,421.110	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20130401	558,000.000	567,329.760	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20150701	304,000.000	328,313.920	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	236,000.000	254,452.840	
	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20141001	179,000.000	183,346.120	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	340,000.000	374,564.400	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	439,000.000	473,369.310	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	246,000.000	264,339.300	



	1.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20160401	474,000.000	484,593.900	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	117,000.000	123,251.310	
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 6,201,000.000 (370,075,680)	シンガポール・ドル 6,750,758.310 (402,885,257)	
スイス・フラン	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20130211	948,000.000	992,205.240	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	487,000.000	649,589.820	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	726,000.000	1,046,166.000	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	1,254,000.000	1,381,080.360	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	1,215,000.000	1,479,274.650	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	152,000.000	178,993.680	
スイス・フラン 小計		スイス・フラン 4,782,000.000 (397,145,100)	スイス・フラン 5,727,309.750 (475,653,074)	
スウェーデン・ク ローナ	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	7,275,000.000	8,288,116.500	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	9,005,000.000	10,161,061.900	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	8,390,000.000	10,845,753.000	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,250,000.000	4,620,345.000	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,875,022.250	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	7,950,000.000	9,488,643.000	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,680,000.000	6,083,110.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	2,060,000.000	2,428,637.000	
スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 48,785,000.000 (548,343,400)	スウェーデン・クローナ 57,790,689.450 (649,567,350)	
デンマーク・ク ローネ	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	3,320,000.000	5,213,163.600	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	10,238,000.000	11,160,443.800	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	8,732,000.000	9,904,183.680	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	8,535,000.000	9,958,296.600	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	9,889,000.000	14,746,773.470	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	9,530,000.000	11,321,354.100	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	450,000.000	498,037.500	
	2% DANISH GOVERNMENT BOND 20141115	1,395,000.000	1,463,745.600	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 52,089,000.000	デンマーク・クローネ 64,265,998.350	

		(711,014,850)	(877,230,878)
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	6,036,000.000	6,495,762.120
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	5,939,000.000	6,681,553.170
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	4,132,000.000	4,688,208.520
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	2,431,000.000	2,858,539.970
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	2,843,000.000	3,231,410.660
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 21,381,000.000 (279,235,860)	ノルウェー・クローネ 23,955,474.440 (312,858,496)
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20131024	2,383,000.000	2,393,890.310
	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	3,221,000.000	3,342,979.270
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,285,101.850
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,855,000.000	2,831,788.850
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20130425	2,660,000.000	2,680,854.400
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20140425	3,090,000.000	3,146,670.600
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	2,458,000.000	2,428,356.520
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290425	1,586,000.000	1,552,376.800
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20150425	1,964,000.000	1,991,456.720
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20201025	2,012,000.000	1,929,930.520
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20160425	945,000.000	941,494.050
	POLAND GOVERNMENT BOND 20130125	2,445,000.000	2,326,344.150
	POLAND GOVERNMENT BOND 20130725	2,383,000.000	2,217,190.860
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20211025	739,000.000	732,275.100
	POLAND GOVERNMENT BOND 20140125	484,000.000	438,794.400
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20161025	1,623,000.000	1,598,703.690
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 33,157,000.000 (749,679,770)	ポーランド・ズロチ 32,838,208.090 (742,471,885)
マレーシア・リングgit		マレーシア・リングgit	マレーシア・リングgit
	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	2,614,000.000	2,720,442.080
	3.702% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130225	2,262,000.000	2,282,810.400
	4.72% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150930	700,000.000	737,905.000
	5.094% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140430	1,992,000.000	2,085,624.000
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	2,108,000.000	2,197,737.560

	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	938,000.000	1,072,771.840	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,035,706.000	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	542,980.530	
	3.461% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130731	763,000.000	769,241.340	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	542,000.000	624,102.160	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,093,000.000	1,152,590.360	
	3.741% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150227	1,056,000.000	1,075,567.680	
	3.21% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130531	1,617,000.000	1,623,484.170	
	3.835% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150812	368,000.000	376,324.160	
	4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	1,427,000.000	1,469,824.270	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,311,000.000	1,360,647.570	
	3.434% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140815	192,000.000	193,822.080	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	946,000.000	995,683.920	
	3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	738,000.000	741,121.740	
	マレーシア・リンギット 小計	マレーシア・リンギット 22,255,000.000 (545,247,500)	マレーシア・リンギット 23,058,386.860 (564,930,478)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	9% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20121220	9,383,000.000	9,793,975.400	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20231207	2,516,000.000	2,804,811.640	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20131219	6,720,000.000	7,138,118.400	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20241205	8,291,000.000	10,623,009.570	
	9.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20141218	9,403,000.000	10,574,895.890	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20151217	15,233,000.000	16,694,149.360	
	7.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20270603	8,568,000.000	8,813,901.600	
	7.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20161215	10,474,000.000	11,252,113.460	
	9% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20130620	7,121,000.000	7,563,712.570	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20171214	7,015,000.000	7,704,855.100	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20361120	6,874,000.000	8,491,177.240	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20290531	5,579,000.000	6,170,931.900	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20181213	6,960,000.000	7,972,680.000	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20381118	9,694,000.000	10,420,080.600	
	7% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20140619	3,526,000.000	3,709,951.420	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20200611	8,453,000.000	9,375,222.300	

	6% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20150618	2,511,000.000	2,588,815.890	
	6.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20210610	812,000.000	812,073.080	
	6.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20160616	9,996,000.000	10,323,668.880	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20310529	8,456,000.000	8,616,833.120	
メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 147,585,000.000 (827,951,850)	メキシコ・ペソ 161,444,977.420 (905,706,323)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	355,230.130	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,223,000.000	1,757,353.160	
	6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,630,525.380	
	5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,630,000.000	2,312,546.200	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,121,000.000	1,466,256.790	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,455,942.960	
	5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,705,000.000	2,452,506.100	
	4.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130104	2,774,000.000	2,903,323.880	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130704	1,909,000.000	2,015,407.660	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	2,976,332.580	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140104	2,190,000.000	2,370,675.000	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	2,989,080.380	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,294,781.720	
	4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,559,000.000	3,279,000.240	
	3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,192,500.000	
	3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,800,934.100	
	4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	3,001,269.240	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,496,930.600	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,769,073.780	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,465,401.440	
	4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	2,098,715.500	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	1,851,000.000	2,199,062.040	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,848,000.000	2,729,126.400	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	3,104,307.720	
	3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	3,256,000.000	3,717,635.680	
	3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,339,853.000	

3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	2,639,000.000	2,921,425.780	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	836,000.000	990,785.400	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	2,072,000.000	2,167,229.120	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,547,000.000	2,713,395.510	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	2,065,000.000	2,329,030.900	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	650,000.000	674,082.500	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20121214	1,114,000.000	1,124,259.940	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130315	1,377,000.000	1,400,835.870	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130614	559,000.000	572,365.690	
0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130913	1,157,000.000	1,168,199.760	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131213	102,000.000	102,052.020	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130412	1,914,000.000	1,998,522.240	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131011	2,046,000.000	2,187,296.760	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140411	2,393,000.000	2,508,653.690	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20141010	1,406,000.000	1,491,470.740	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150227	2,401,000.000	2,555,288.260	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150410	2,471,000.000	2,614,367.420	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20151009	2,786,000.000	2,909,670.540	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160226	1,926,000.000	2,033,663.400	
2.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160408	732,000.000	795,610.800	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20161014	997,000.000	1,017,119.460	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121226	840,000.000	907,368.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	911,973.270	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	1,916,166.300	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	1,968,000.000	2,532,501.120	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	3,282,946.800	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	2,925,000.000	3,315,136.500	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,507,000.000	3,297,707.800	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130425	1,700,000.000	1,780,002.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20131025	2,028,000.000	2,144,792.520	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	2,316,004.110	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140425	2,491,000.000	2,650,872.380	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,905,624.840	

4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,430,000.000	3,766,105.700	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,787,000.000	1,929,620.470	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	2,232,000.000	2,370,607.200	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	3,752,000.000	3,923,503.920	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,409,168.100	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	2,984,000.000	3,144,867.440	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,558,000.000	2,745,731.620	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	2,204,000.000	2,364,583.440	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,585,000.000	3,919,874.850	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	2,073,651.840	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,471,114.730	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	1,897,000.000	2,084,290.810	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,710,000.000	1,998,135.000	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	2,354,000.000	2,526,571.740	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	2,546,000.000	2,666,247.580	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	905,000.000	981,291.500	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	2,504,000.000	2,520,977.120	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,841,000.000	3,695,963.840	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	1,956,000.000	1,981,877.880	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130112	1,789,000.000	1,849,790.220	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130712	1,920,000.000	2,037,177.600	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140112	2,289,000.000	2,356,456.830	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140712	1,388,000.000	1,446,101.680	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150115	2,178,000.000	2,243,448.900	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150712	2,614,000.000	2,644,479.240	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160225	2,429,000.000	2,464,220.500	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130925	617,000.000	629,512.760	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160725	930,000.000	950,962.200	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	1,050,147.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,711,368.750	
4.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130715	1,993,000.000	2,112,261.120	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	1,831,000.000	1,975,978.580	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	1,536,000.000	1,657,820.160	

4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	838,000.000	1,066,170.640	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	1,398,000.000	1,570,834.740	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,132,000.000	1,286,936.840	
4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	1,405,000.000	1,619,515.400	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,377,648.000	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,417,000.000	1,625,653.250	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150115	1,506,000.000	1,593,348.000	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130115	2,210,000.000	2,246,133.500	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,848,000.000	2,053,017.120	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,095,000.000	1,385,996.250	
1% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140115	1,133,000.000	1,144,499.950	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,031,000.000	1,124,027.130	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170115	1,615,000.000	1,696,073.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,482,440.300	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,712,000.000	1,743,672.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,868,000.000	2,672,660.520	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,161,762.620	
6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	2,718,708.920	
5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	1,579,632.400	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130201	2,876,000.000	2,846,405.960	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,528,000.000	2,395,532.800	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	3,521,000.000	3,092,071.780	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,626,380.880	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130801	2,519,000.000	2,476,529.660	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	1,689,442.660	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,137,103.280	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	1,611,000.000	1,252,600.830	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	2,026,280.520	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	1,864,000.000	1,275,460.640	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	3,128,000.000	2,536,432.640	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	3,963,000.000	3,612,353.760	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	2,057,996.400	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,968,000.000	1,777,379.520	

5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	2,984,000.000	2,300,126.880	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	2,063,000.000	1,702,717.680	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	2,928,000.000	2,625,069.120	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130415	1,694,000.000	1,678,754.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	2,347,000.000	2,067,425.360	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	1,425,000.000	1,386,183.000	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,754,000.000	1,508,510.160	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,707,000.000	1,628,887.680	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250301	2,403,000.000	1,989,323.550	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400901	2,029,000.000	1,572,170.650	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200301	2,560,000.000	2,216,985.600	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20121215	2,778,000.000	2,702,966.220	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	2,891,000.000	2,652,839.420	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200901	2,000,000.000	1,670,880.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130601	2,000,000.000	1,916,580.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150615	833,000.000	761,287.030	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,361,000.000	1,845,995.070	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210301	2,144,000.000	1,763,289.920	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131101	1,206,000.000	1,143,613.620	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20151101	186,000.000	168,638.760	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,737,000.000	1,530,644.400	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140401	1,389,000.000	1,323,814.230	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160415	2,034,000.000	1,871,605.440	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140701	383,000.000	370,629.100	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160915	986,000.000	930,892.460	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,089,000.000	943,607.610	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,385,000.000	1,558,942.150	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	438,799.270	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20121224	791,000.000	844,661.440	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	874,322.100	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130928	1,243,000.000	1,279,071.860	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	2,025,000.000	2,092,412.250	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	1,742,901.600	



3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,131,216.800	
3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,190,985.850	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	1,542,000.000	1,502,894.880	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,057,978.900	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130328	1,341,000.000	1,375,141.860	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,523,200.250	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	1,569,000.000	1,609,982.280	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,552,443.160	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,876,000.000	1,895,153.960	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,792,000.000	1,736,000.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160328	516,000.000	504,013.320	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	435,000.000	425,560.500	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20210928	736,000.000	732,047.680	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170628	1,202,000.000	1,187,071.160	
4.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20260328	801,000.000	814,336.650	
5% IRISH TREASURY 20130418	607,000.000	592,158.850	
4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	589,020.790	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	450,202.500	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	633,208.000	
4% IRISH TREASURY 20140115	1,163,000.000	1,084,660.320	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	911,000.000	777,666.040	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	784,000.000	620,034.240	
5% IRISH TREASURY 20201018	918,000.000	736,695.000	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	1,074,516.510	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	578,000.000	780,213.300	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,775,000.000	1,991,567.750	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	1,345,000.000	1,444,301.350	
3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	1,421,000.000	1,525,812.960	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20131020	2,340,000.000	2,463,645.600	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	996,000.000	1,057,532.880	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	1,594,000.000	1,674,226.020	
4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	983,928.870	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	843,000.000	959,452.020	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	509,000.000	561,233.580	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	1,302,000.000	1,436,418.480	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20141020	1,762,000.000	1,863,174.040	

4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	929,000.000	1,107,117.170	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	1,137,000.000	1,187,812.530	
3.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20220420	554,000.000	585,107.100	
5.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20130704	725,000.000	780,694.500	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	1,280,000.000	1,423,641.600	
3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	434,756.810	
4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	630,723.500	
3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140915	687,000.000	732,843.510	
4% FINNISH GOVERNMENT BOND 20250704	391,000.000	448,089.910	
3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20200415	880,000.000	951,438.400	
1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20160415	839,000.000	856,795.190	
3.5% FINNISH GOVERNMENT BOND 20210415	459,000.000	503,008.920	
1.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170415	252,000.000	255,497.760	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,006,000.000	1,985,578.920	
6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130131	1,255,000.000	1,303,819.500	
4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	998,000.000	1,026,043.800	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,398,000.000	1,351,656.300	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,724,030.360	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130730	1,030,000.000	1,038,950.700	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	1,240,000.000	1,255,252.000	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,725,000.000	2,098,250.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,808,017.200	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	987,653.600	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	953,126.590	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,438,505.500	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,777,000.000	1,631,268.230	
4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140131	1,304,000.000	1,322,503.760	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	1,517,000.000	1,509,308.810	
4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,709,325.000	
3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20141031	1,189,000.000	1,170,083.010	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	893,000.000	732,572.550	
2.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130430	1,704,000.000	1,673,873.280	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	1,725,000.000	1,614,082.500	

	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,135,000.000	1,012,420.000	
	3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150430	1,805,000.000	1,757,311.900	
	2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20131031	1,748,000.000	1,720,766.160	
	4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,647,211.900	
	3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160430	863,000.000	828,678.490	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	1,932,000.000	1,960,980.000	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,074,000.000	1,070,391.360	
	3.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140430	1,196,000.000	1,188,226.000	
	4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20161031	411,000.000	404,543.190	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	775,000.000	789,701.750	
	5.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20130923	1,233,000.000	1,097,098.740	
	4.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20140616	604,000.000	485,936.120	
	3.85% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20210415	1,596,000.000	877,480.800	
	3.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20151015	305,000.000	224,254.300	
	4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	424,000.000	210,791.600	
	4.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20161015	625,000.000	417,225.000	
	4.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20171016	563,000.000	344,043.670	
	4.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20180615	440,000.000	261,056.400	
	4.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20231025	661,000.000	347,355.500	
	4.75% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20190614	1,520,000.000	871,142.400	
	3.6% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20141015	711,000.000	533,250.000	
	4.8% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20200615	416,000.000	231,653.760	
	6.4% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20160215	661,000.000	497,455.380	
	ユーロ 小計	ユーロ 404,886,000.000 (41,059,489,260)	ユーロ 414,717,452.260 (42,056,496,834)	
国債証券 合計		95,915,640,740 [95,915,640,740]	103,977,680,653 [103,977,680,653]	
合計		95,915,640,740 [95,915,640,740]	103,977,680,653 [103,977,680,653]	

- (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 197銘柄	100%	41.8%
イギリス・ポンド	国債証券 35銘柄	100%	8.7%
オーストラリア・ドル	国債証券 16銘柄	100%	1.4%

カナダ・ドル	国債証券	35銘柄	100%	3.0%
シンガポール・ドル	国債証券	16銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券	6銘柄	100%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.6%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.8%
ノルウェー・クローネ	国債証券	5銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	100%	0.7%
マレーシア・リングgit	国債証券	19銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	20銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	250銘柄	100%	40.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成23年12月30日

資産総額	23,125,592円
負債総額	4,681円
純資産総額（ - ）	23,120,911円
発行済数量	33,160,573口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6972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23年12月30日

資産総額	82,875,459,760円
負債総額	92,187,866円
純資産総額（ - ）	82,783,271,894円
発行済数量	206,802,808,185口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.4003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23年12月30日

資産総額	44,771,396,851円
負債総額	562,605,882円
純資産総額（ - ）	44,208,790,969円
発行済数量	53,967,978,781口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8192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23年12月30日

資産総額	18,278,356,171円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	18,278,356,171円
発行済数量	19,235,437,258口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9502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23年12月30日

資産総額	509,293,037円
負債総額	4,400,000円
純資産総額( - )	504,893,037円
発行済数量	557,791,144口
1単位当たり純資産額( / )	0.9052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23年12月30日

資産総額	12,254,784,258円
負債総額	134,098,840円
純資産総額( - )	12,120,685,418円
発行済数量	10,759,942,249口
1単位当たり純資産額( / )	1.1265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23年12月30日

資産総額	107,817,980,279円
負債総額	1,058,658,493円
純資産総額( - )	106,759,321,786円
発行済数量	62,125,789,937口
1単位当たり純資産額( / )	1.7184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23年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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



## ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「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23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	2	2,103
追加型株式投資信託	396	6,432,105
株式投資信託 合計	398	6,434,208
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,465,639
公社債投資信託 合計	17	2,465,639
総合計	415	8,899,847

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

なお、第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、第52期事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）は、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第52期事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第53期事業年度に係る中間会計期間（平成23年4月1日から平成23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。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

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22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,783,803	1,820,358
有価証券	26,970,072	18,987,155
前払金	136	579
前払費用	77,248	24,840
未収入金	3,858	6,925
未収委託者報酬	7,030,430	6,933,076
未収収益	90,787	41,963
貯蔵品	30,324	23,337
繰延税金資産	566,334	286,080
その他	256,955	501,484
流動資産計	39,809,953	28,625,803
固定資産		
有形固定資産	1 1,186,818	1 967,190
建物(純額)	318,162	332,407

器具備品（純額）	757,333	634,782
建設仮勘定	111,322	-
無形固定資産	1,751,209	2,414,530
ソフトウェア	1,558,342	1,364,617
ソフトウェア仮勘定	179,630	1,037,069
電話加入権	11,850	11,850
商標権	660	396
その他	725	596
投資その他の資産	10,657,920	18,825,476
投資有価証券	10,018,677	12,339,547
関係会社株式	737,012	5,141,069
出資金	178,806	142,215
従業員に対する長期貸付金	104,419	99,889
差入保証金	617,615	609,781
長期前払費用	8,402	7,607
投資不動産（純額）	1 489,861	1 490,114
貸倒引当金	3 1,496,873	4,750
固定資産計	13,595,948	22,207,196
資産合計	53,405,901	50,833,000

（単位：千円）

	前事業年度 （平成22年3月31日現在）	当事業年度 （平成23年3月31日現在）
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	46,289	46,454
未払金	7,304,929	6,501,119
未払収益分配金	31,110	27,599
未払償還金	261,645	119,838
未払手数料	3,847,895	3,725,807
その他未払金	2 3,164,277	2 2,627,872
未払費用	2,212,051	2,395,029
未払法人税等	692,446	895,379
未払消費税等	104,897	383,973
賞与引当金	838,400	263,000
その他	168,621	-
流動負債計	11,367,635	10,484,955
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,179,482	1,410,635
役員退職慰労引当金	39,300	59,160
繰延税金負債	1,963,856	1,977,913
固定負債計	3,182,638	3,447,708
負債合計	14,550,274	13,932,663
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		

資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金	2,800,000	-
繰越利益剰余金	9,085,103	9,874,176
利益剰余金合計	12,259,401	10,248,473
株主資本合計	38,929,401	36,918,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	18,061	104,040
繰延ヘッジ損益	55,712	85,902
評価・換算差額等合計	73,774	18,137
純資産合計	38,855,627	36,900,336
負債・純資産合計	53,405,901	50,833,000

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,362,142	72,303,483
その他営業収益	432,889	345,390
営業収益計	63,795,032	72,648,873
営業費用		
支払手数料	37,293,022	41,437,322
広告宣伝費	917,652	967,991
公告費	257	1,256
受益証券発行費	131	3
調査費	4,336,342	6,192,360
調査費	771,298	831,159
委託調査費	3,565,043	5,361,200
委託計算費	601,778	718,414
営業雑経費	1,793,369	1,806,147
通信費	284,273	287,454
印刷費	837,408	674,758
協会費	45,168	47,465
諸会費	11,118	10,778
その他営業雑経費	615,400	785,691
営業費用計	44,942,552	51,123,496
一般管理費		
給料	4,847,709	4,192,794
役員報酬	217,200	157,200
給料・手当	3,478,553	3,545,655
賞与	313,555	226,939
賞与引当金繰入額	838,400	263,000
福利厚生費	680,311	619,459
交際費	80,019	68,476
寄付金	-	638
旅費交通費	178,718	266,082
租税公課	166,974	169,305
不動産賃借料	731,728	680,147
退職給付費用	303,972	334,864
役員退職慰労引当金繰入額	37,500	28,500
固定資産減価償却費	941,172	897,352
諸経費	990,534	1,170,318
一般管理費計	8,958,640	8,427,939
営業利益	9,893,838	13,097,437

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)		当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	
<b>営業外収益</b>				
受取配当金		61,884	1	573,514
有価証券利息		87,447		23,029
受取利息		3,425		2,673
時効成立分配金・償還金		40,507		149,120
投資有価証券売却益		213,196		38,591
有価証券償還益		33,090		-
その他		82,595		45,094
営業外収益計		522,147		832,022
<b>営業外費用</b>				
時効成立後支払分配金・償還金		101,945		98,613
貯蔵品廃棄損		44,214		25,533
投資有価証券売却損		263,840		7,515
為替差損		7,870		-
投資不動産管理費用		-		20,028
その他		68,406		36,603
営業外費用計		486,276		188,294
経常利益		9,929,709		13,741,165
<b>特別利益</b>				
貸倒引当金戻入額		159,959		614,232
特別利益計		159,959		614,232
<b>特別損失</b>				
固定資産除却損	2	16,233	2	1,067
ゴルフ会員権評価損		-		21,290
減損損失	3	76,450	3	35,468
その他		-		768
特別損失計		92,683		58,595
税引前当期純利益		9,996,985		14,296,802
法人税、住民税及び事業税		4,592,433		4,834,931
法人税等調整額		516,225		256,140
法人税等合計		4,076,208		5,091,072
当期純利益		5,920,777		9,205,730

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	2,800,000	2,800,000
当期変動額		
別途積立金の取崩	-	2,800,000
当期変動額合計	-	2,800,000
当期末残高	2,800,000	-
繰越利益剰余金		
前期末残高	9,659,553	9,085,103
当期変動額		
別途積立金の取崩	-	2,800,000
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	574,450	789,072
当期末残高	9,085,103	9,874,176
利益剰余金合計		
前期末残高	12,833,851	12,259,401
当期変動額		
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657

当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	574,450	2,010,927
当期末残高	12,259,401	10,248,473

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
<b>株主資本合計</b>		
前期末残高	39,503,851	38,929,401
当期変動額		
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	574,450	2,010,927
当期末残高	38,929,401	36,918,473
<b>評価・換算差額等</b>		
<b>その他有価証券評価差額金</b>		
前期末残高	618,549	18,061
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	600,487	85,978
当期変動額合計	600,487	85,978
当期末残高	18,061	104,040
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	-	55,712
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,712	141,615
当期変動額合計	55,712	141,615
当期末残高	55,712	85,902
<b>評価・換算差額等合計</b>		
前期末残高	618,549	73,774
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	544,775	55,636
当期変動額合計	544,775	55,636
当期末残高	73,774	18,137
<b>純資産合計</b>		
前期末残高	38,885,301	38,855,627
当期変動額		
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	544,775	55,636
当期変動額合計	29,674	1,955,290
当期末残高	38,855,627	36,900,336



## 重要な会計方針

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
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。	(1) 子会社及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法により計上しております。	同左
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く） 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6～47年 器具備品 3～20年 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。 (3) 長期前払費用 定額法によっております。	(1) 有形固定資産及び投資不動産 同左 (2) 無形固定資産 同左 (3) 長期前払費用 同左
4. 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 役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。	(1) 貸倒引当金 債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。 (2) 賞与引当金 従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

5 . ヘッジ会計の方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p>	<p>(3) 退職給付引当金 同左</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金 同左</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 同左</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 同左</p> <p>(3) ヘッジ方針 同左</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 同左</p>
6 . リース取引の処理方法	<p>リース取引開始日が平成20年3月31日以前の、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>	
7 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(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。</p> <p>(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。</p>	<p>(1) 消費税等の会計処理 同左</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 同左</p>

## 会計方針の変更

<p>前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)</p>	<p>当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)</p>
---	---

	<p>(資産除去債務に関する会計基準の適用)</p> <p>当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。</p> <p>なお、当該変更に伴う損益に与える影響はありません。</p>
--	--

## 表示方法の変更

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
	<p>(損益計算書)</p> <p>1. 「有価証券償還益」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外収益に区分掲記しておりましたが、重要性が低いため「その他」に含めて表示しております。</p> <p>なお、当事業年度の、営業外収益の「その他」に含まれている「有価証券償還益」の金額は、3,185千円であります。</p> <p>2. 「投資不動産管理費用」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外費用の「その他」に含めて表示しておりましたが、重要性が増したため、当事業年度より、営業外費用の「投資不動産管理費用」として区分掲記しております。</p> <p>なお、前事業年度の営業外費用の「その他」に含まれている「投資不動産管理費用」の金額は、17,078千円であります。</p> <p>3. 「為替差損」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外費用に区分掲記しておりましたが、重要性が低いため「その他」に含めて表示しております。なお、当事業年度の、営業外費用の「その他」に含まれている「為替差損」の金額は、8,906千円であります。</p>

## 追加情報

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
<p>(投資有価証券売却損益の計上区分の変更)</p> <p>従来、投資有価証券売却損益は、特別利益又は特別損失の区分において処理しておりましたが、投資有価証券の保有方針等を勘案し、今後、経常的に発生すると見込まれるものについては、実態をより適切に表示するため、当事業年度より営業外収益又は営業外費用の区分において処理しております。</p> <p>この結果、従来の方法と同一の方法によった場合と比べ、経常利益は50,644千円少なく計上されておりますが、税引前当期純利益に与える影響はありません。</p>	

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <p>建物 815,365千円 器具備品 1,938,369千円 投資建物 688,305千円 投資器具備品 27,339千円</p> <p>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。 未払金 3,002,391千円</p> <p>3 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券(投資有価証券)に対するものであります。</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務598,500千円に対して保証を行っております。</p>	<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <p>建物 854,118千円 器具備品 2,129,756千円 投資建物 700,991千円 投資器具備品 28,141千円</p> <p>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。 未払金 2,591,913千円</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,384,110千円に対して保証を行っております。</p>

## (損益計算書関係)

前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
<p>2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>器具備品 1,439千円 ソフトウェア 14,793千円</p>	<p>1 関係会社項目 関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 受取配当金 460,584千円</p> <p>2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>器具備品 1,067千円</p>

## 3 減損損失に関する注記

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。  
場所 千葉県浦安市  
用途 賃貸等不動産(浦安寮)  
種類 建物及び土地

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

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失(76,450千円)として特別損失に計上しております。その内訳は、建物7,750千円及び土地68,700千円であります。

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

## 3 減損損失に関する注記

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。  
場所 千葉県浦安市  
用途 賃貸等不動産(浦安寮)  
種類 建物及び土地

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

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

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	前事業年度末 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21年6月19日 定時株主総会	普通株式	6,495	2,490	平成21年 3月31日	平成21年 6月22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22年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

剰余金の配当の総額 11,216百万円  
配当の原資 利益剰余金  
1株当たり配当額 4,300円  
基準日 平成22年3月31日  
効力発生日 平成22年6月28日

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2．配当に関する事項

## (1)配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額 9,182百万円  
 配当の原資 利益剰余金  
 1株当たり配当額 3,520円  
 基準日 平成23年3月31日  
 効力発生日 平成23年6月27日

## (リース取引関係)

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
(借主側) リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 (1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額  該当事項はありません。  (2)未経過リース料期末残高相当額  該当事項はありません。  (3)支払リース料及び減価償却費相当額	

支払リース料	985千円
減価償却費相当額	985千円
(4)減価償却費相当額の算定方法	
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	

## (金融商品関係)

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

デリバティブ取引は為替予約及び株式先物取引を行っております。当社ではこれらをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジしております。このうち株式先物取引についてはヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5. ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っており、外貨建資産担保債券について為替予約を利用してヘッジしております。

## ( ) 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保

有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

#### ( ) デリバティブ取引

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

#### 信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、デリバティブ取引は信用リスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、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）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	4,783,803	4,783,803	-
(2) 未収委託者報酬	7,030,430	7,030,430	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	34,012,542	34,012,542	-
資産計	45,826,776	45,826,776	-
(1) 未払手数料	3,847,895	3,847,895	-
(2) その他未払金	3,164,277	3,164,277	-
(3) 未払費用（*1）	1,696,832	1,696,832	-
負債計	8,709,004	8,709,004	-
デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(7,985)	(7,985)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(159,516)	(159,516)	-
デリバティブ取引計	(167,501)	(167,501)	-

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

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

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

## 資産



## (1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

## (1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額
(1) その他有価証券	
外貨建資産担保債券(*1)	311,905
非上場株式	1,172,137
(2) 子会社株式及び関連会社株式	
子会社株式	737,012
(3) 長期差入保証金	617,615

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。

(\*1) 外貨建資産担保債券に対する貸倒引当金を控除しております。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(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	4,783,803	-	-	-
未収委託者報酬	7,030,430	-	-	-
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	-	746,330	1,547,596	-
合計	11,814,233	746,330	1,547,596	-

外貨建資産担保債券311,905千円は清算事象が生じており、償還予定額を見込めないため上記表には含めておりません。

（追加情報）

当事業年度より、平成20年3月31日公表の「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会計基準第10号）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第19号）を適用しております。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社では、これをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、ヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

（ ）デリバティブ取引

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

#### 信用リスクの管理

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

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

#### 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、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）

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

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

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

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

##### 資産

##### （1）現金・預金、及び（2）未収委託者報酬

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

##### （3）有価証券及び投資有価証券

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

関係」をご参照下さい。

## 負債

### （１）未払手数料、（２）その他未払金、並びに（３）未払費用

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

## デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注 2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額
(1) その他有価証券 非上場株式	1,172,137
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069
(3) 長期差入保証金	609,781

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

<注 3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

前事業年度（平成22年3月31日現在）

### 1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（貸借対照表計上額 737,012千円）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

	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	76,077	55,101	20,975
(2)その他			
証券投資信託の受益証券	4,728,727	4,379,317	349,410
小計	4,804,805	4,434,419	370,385
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	29,207,737	29,608,576	400,839
小計	29,207,737	29,608,576	400,839
合計	34,012,542	34,042,996	30,453

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 1,172,137千円)、外貨建資産担保債券(貸借対照表計上額(貸倒引当金控除前) 1,804,069千円)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. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成21年4月1日至平成22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	13,871,201	213,196	263,840
合計	13,871,201	213,196	263,840

当事業年度(平成23年3月31日現在)

#### 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

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

合計	30,154,565	30,329,983	175,417
----	------------	------------	---------

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

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

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

#### (デリバティブ取引関係)

前事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

##### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

##### 通貨関連

(単位：千円)

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	280,388	-	7,985	7,985
	合計	280,388	-	7,985	7,985

(注) 時価の算定方法は、取引先の金融機関から提示された価格により評価しております。

##### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

##### 株式関連

(単位：千円)

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価	当該時価の 算定方法
				うち1年超		
原則的 処理方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,303,784	-	159,516	東京証券取引所から公表された価格 によっている。
	合計		2,303,784	-	159,516	

当事業年度(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

## 株式関連

(単位：千円)

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価	当該時価の 算定方法
				うち1年超		
原則的 処理方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,435,030	-	183,430	東京証券取引所から公表された価格 によっている。
	合計		2,435,030	-	183,430	

## (退職給付関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
<p>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。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 1,179,482千円 退職給付引当金 1,179,482千円</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 175,249千円 その他 128,723千円</p> <p>退職給付費用 303,972千円</p> <p>なお、「その他」の128,723千円は、確定拠出年金への掛金支払額であります。</p>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 1,410,635千円 退職給付引当金 1,410,635千円</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 191,300千円 その他 143,564千円</p> <p>退職給付費用 334,864千円</p> <p>なお、「その他」の143,564千円は、確定拠出年金への掛金支払額であります。</p>

## (税効果会計関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <p>繰延税金資産 千円</p> <p>減損損失 915,392</p> <p>貸倒引当金 609,077</p> <p>退職給付引当金 479,931</p> <p>賞与引当金 302,163</p> <p>株式譲渡損繰延 287,965</p> <p>投資有価証券評価損 225,062</p> <p>外貨建有価証券換算差額 176,654</p> <p>未払事業税 163,956</p> <p>出資金評価損 126,163</p> <p>その他有価証券評価差額金 65,652</p> <p>未払社会保険料 44,836</p>	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <p>繰延税金資産 千円</p> <p>減損損失 928,499</p> <p>退職給付引当金 573,987</p> <p>連結法人間取引（譲渡損） 294,850</p> <p>投資有価証券評価損 216,468</p> <p>未払事業税 212,062</p> <p>出資金評価損 128,238</p> <p>その他有価証券評価差額金 125,395</p> <p>賞与引当金 107,014</p> <p>器具備品 38,093</p> <p>役員退職慰労引当金 24,072</p> <p>未払社会保険料 11,722</p>

繰延ヘッジ損益	38,221	その他	28,763
器具備品	38,093	繰延税金資産小計	2,689,169
役員退職慰労引当金	15,991	評価性引当額	1,547,609
その他	27,316	繰延税金資産合計	1,141,560
繰延税金資産小計	3,516,480	繰延税金負債	
評価性引当額	2,139,543	連結法人間取引（譲渡益）	2,772,301
繰延税金資産合計	1,376,937	繰延ヘッジ損益	58,934
繰延税金負債		その他	2,156
株式譲渡益繰延	2,772,301	繰延税金負債合計	2,833,392
その他	2,156	繰延税金負債の純額	1,691,832
繰延税金負債合計	2,774,458		
繰延税金負債の純額	1,397,521		
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率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。		法定実効税率（調整）	40.69%
		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.21
		受取配当金等永久に益金に算入されない項目	1.25
		住民税均等割	0.02
		評価性引当額	4.14
		その他	0.07
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.60

## ( 関連当事者情報 )

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（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）
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	598,500	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社



種類	会社等の名称	所在地	資本金 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	22,043,473	未払手数料	2,870,857
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケット(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	676,687	未払手数料	64,597
							為替予約	3,946,508	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、証券投資信託の代行手数料の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、代行手数料を支払っております。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

(2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

3. 大和証券エスエムピーシー(株)は、平成22年1月1日付で、大和証券キャピタル・マーケット(株)に商号変更しております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金 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)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証	1,384,110	-	-
子会社	Daiwa Asset Management (India)Private Limited	India	1,128	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	増資の引受	3,204,985	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) インド共和国における外国資本規制上の最低払込金額を満たすため、当社がDaiwa Asset Management(India)Private Limited社の行った増資を1株につき72円86銭で引き受けております。

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金 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	21,941,957	未払手数料	2,760,790
同一の親会社をもつ会社	大和証券 キャピタル ・ マーケット(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	666,862	未払手数料	70,947
							為替予約	1,160,187	-	-
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	1,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,085,626	未払費用	129,623

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

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

## 2. 親会社に関する注記

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

## (セグメント情報等)

## [ セグメント情報 ]

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31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。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31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 ]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31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 ]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	35,468	35,468

## [ 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 ]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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負ののれん発生益に関する情報 ]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

## (追加情報)

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

## (1株当たり情報)

前事業年度 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）	当事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）
1株当たり純資産額 14,895.63円 1株当たり当期純利益 2,269.77円	1株当たり純資産額 14,146.05円 1株当たり当期純利益 3,529.09円
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	同左

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
当期純利益(千円)	5,920,777	9,205,730
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

## (重要な後発事象)

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
該当事項はありません。	同左

## (追加情報)

前事業年度(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

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

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

(単位：千円)

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

(注)取得付随費用を算入した後の金額になります。

[次へ](#)

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		5,608,473
有価証券		9,013,133
未収委託者報酬		6,773,690
貯蔵品		12,758
繰延税金資産		197,087
その他		472,852
流動資産計		22,077,996
固定資産		
有形固定資産	1	870,049
無形固定資産		
ソフトウェア		2,237,473
その他		321,718
無形固定資産合計		2,559,192
投資その他の資産		
投資有価証券		17,664,932
その他	1	1,296,211
貸倒引当金		4,750
投資その他の資産合計		18,956,394
固定資産計		22,385,635
資産合計		44,463,632

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		5,629,444
未払費用		2,988,680
未払法人税等		981,739
賞与引当金		277,000
その他	3	306,598
流動負債計		10,183,463
固定負債		
繰延税金負債		1,436,117
退職給付引当金		1,566,148
役員退職慰労引当金		66,370
固定負債計		3,068,636
負債合計		13,252,099

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	4,745,092
利益剰余金合計	5,119,390
株主資本合計	31,789,390
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	817,480
繰延ヘッジ損益	239,622
評価・換算差額等合計	577,857
純資産合計	31,211,532
負債・純資産合計	44,463,632

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		37,977,881
その他営業収益		178,035
営業収益計		38,155,917
営業費用		
支払手数料		21,394,608
その他営業費用		5,556,258
営業費用計		26,950,866
一般管理費	1	4,367,716
営業利益		6,837,334
営業外収益	2	165,615
営業外費用	1, 3	123,075
経常利益		6,879,874
特別損失		4,756
税引前中間純利益		6,875,117
法人税、住民税及び事業税		2,890,995
法人税等調整額		68,802
中間純利益		4,052,924

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	15,174,272
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
資本剰余金合計	
当期首残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	374,297
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	
当期首残高	9,874,176
当中間期変動額	
剰余金の配当	9,182,008
中間純利益	4,052,924
当中間期変動額合計	5,129,083
当中間期末残高	4,745,092

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日)
利益剰余金合計	
当期首残高	10,248,473
当中間期変動額	
剰余金の配当	9,182,008
中間純利益	4,052,924
当中間期変動額合計	5,129,083
当中間期末残高	5,119,390

株主資本合計	
当期首残高	36,918,473
当中間期変動額	
剰余金の配当	9,182,008
中間純利益	4,052,924
当中間期変動額合計	5,129,083
当中間期末残高	31,789,390
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	104,040
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	713,440
当中間期変動額合計	713,440
当中間期末残高	817,480
繰延ヘッジ損益	
当期首残高	85,902
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	153,719
当中間期変動額合計	153,719
当中間期末残高	239,622
評価・換算差額等合計	
当期首残高	18,137
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	559,720
当中間期変動額合計	559,720
当中間期末残高	577,857
純資産合計	
当期首残高	36,900,336
当中間期変動額	
剰余金の配当	9,182,008
中間純利益	4,052,924
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	559,720
当中間期変動額合計	5,688,804
当中間期末残高	31,211,532

## 重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)
--	--



1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。  <b>其他有価証券</b> 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。</p> <p>(2) デリバティブ 時価法により計上しております。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産及び投資不動産 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6～47年 器具備品 3～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 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。</p> <p>(3) 長期前払費用 定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。 また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>

4．ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p>
5．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(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。</p> <p>(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。</p>

## 追加情報

当中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)
(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用) 当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間末 (平成23年9月30日)	
1．減価償却累計額 有形固定資産	3,036,275千円
投資その他の資産	727,880千円
2．債務保証 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,240,890千円に対して保証を行っております。	
3．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	
1．減価償却実施額	

有形固定資産	131,539千円
無形固定資産	363,595千円
投資その他の資産	7,309千円
2. 営業外収益の主要項目	
受取配当金	46,562千円
投資有価証券売却益	44,885千円
時効成立分配金・償還金	33,386千円
法人税還付加算金	20,450千円
3. 営業外費用の主要項目	
投資有価証券償還損	67,771千円
為替差損	13,127千円
貯蔵品廃棄損	13,042千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23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23年6月24日 定時株主総会	普通株式	9,182	3,520	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

（金融商品関係）

当中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられてい

るためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、投資信託、株式であります。投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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

デリバティブ取引は為替予約及び株式先物取引を行っております。当社ではこれらをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジしております。このうち株式先物取引についてはヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「4．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

### （3）金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

##### （ ）為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っており、外貨建投資有価証券の一部について為替予約を利用してヘッジしております。

##### （ ）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

##### （ ）デリバティブ取引

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

#### 信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、デリバティブ取引は信用リスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

### （4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2．金融商品の時価等に関する事項

平成23年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（<注2>参照のこと）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額

(1) 現金・預金	5,608,473	5,608,473	-
(2) 未収委託者報酬	6,773,690	6,773,690	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	20,364,859	20,364,859	-
資産計	32,747,023	32,747,023	-
(1) 未払金	5,629,444	5,629,444	-
(2) 未払費用(*1)	2,636,853	2,636,853	-
負債計	8,266,298	8,266,298	-
デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,773)	(1,773)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(30,798)	(30,798)	-
デリバティブ取引計	(32,572)	(32,572)	-

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

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

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

##### 資産

###### (1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

###### (3) 有価証券及び投資有価証券

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

##### 負債

###### (1) 未払金、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。

##### デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

#### <注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	1,172,137
子会社株式	5,141,069
長期差入保証金	540,246

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積ることなどができず、時価を把握する

ことが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

（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	5,608,473	-	-	-
未収委託者報酬	6,773,690	-	-	-
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	-	1,496,072	6,195,633	-
合計	12,382,163	1,496,072	6,195,633	-

（有価証券関係）

当中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表計上額 （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 その他 証券投資信託の受益証券	3,556,521	3,405,918	150,602
小計	3,556,521	3,405,918	150,602
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの (1)株式	42,785	55,101	12,316
(2)その他 証券投資信託の受益証券	16,765,553	18,282,157	1,516,604
小計	16,808,338	18,337,259	1,528,920
合計	20,364,859	21,743,177	1,378,317

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

（デリバティブ取引関係）

当中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

次のとおりであります。

## 通貨関連

(単位：千円)

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	971,384	-	1,773	1,773
合計		971,384	-	1,773	1,773

(注) 時価の算定方法は、取引先の金融機関から提示された価格により評価しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

## 株式関連

(単位：千円)

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価	当該時価の 算定方法
				うち1年超		
原則的 処理方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	1,946,277	-	30,798	東京証券取引所から公表された価格 によっている。
合計			1,946,277	-	30,798	

(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23年4月1日 至 平成23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23年4月1日 至 平成23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23年 4月 1日 至 平成23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23年 4月 1日 至 平成23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23年 4月 1日 至 平成23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23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日）	
1株当たり純資産額	11,965.20円
1株当たり中間純利益金額	1,553.72円
（注）1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。 2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。	
中間純利益(千円)	4,052,924
普通株式に係る中間純利益(千円)	4,052,924
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

#### （重要な後発事象）

該当事項はありません。



#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

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

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

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

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 住友信託銀行株式会社

関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

資本金の額 342,037百万円（平成23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23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ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに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ないます。

### 3 【資本関係】

該当ありません。

#### <再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成23年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

### 第3 【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24年2月3日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 茂 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2030の平成22年12月21日から平成23年12月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2030の平成23年12月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成23年6月2日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森 公 高
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	福 井 淳
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	梅 津 広

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22年4月1日から平成23年3月31日までの第52期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成23年11月29日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23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23年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

---

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

## 独立監査人の監査報告書

平成23年1月28日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 茂 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2030の平成21年12月19日から平成22年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2030の平成22年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成22年6月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

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