

【表紙】
【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長 殿
【提出日】 平成21年3月11日提出
【計算期間】 第1計算期間
（自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日）
【ファンド名】 DCダイワ・ターゲットイヤー2030
【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 樋口 三千人
【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【事務連絡者氏名】 長谷川 英男
【連絡場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【電話番号】 03-5695-2111
【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、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

主として、マザーファンドを通じて内外の株式、債券、リート（REIT）に投資するとともに、短期金融資産に投資を行ない、中長期的に安定した信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

2

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。

- ◆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。

■ 当初設定時の基本配分比率は…

	国内株式	海外株式	国内リート	海外リート	国内債券	海外債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	38%	22%	8%	7%	14%	11%

（注）実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

- ◎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、上記の運用が行なわれないことがあります。

■ 各資産ごとの運用は…

- ◆各資産への投資は、下記の各マザーファンドを通じて行ないます（マザーファンド方式）。
- ◆各マザーファンドは、下記の各ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

（カッコ内はベンチマーク）

国内株式	トピックス・インデックス・マザーファンド （東証株価指数（TOPIX））
海外株式	外国株式インデックスマザーファンド （MSCI コクサイ指数（円ベース））
国内リート	ダイワJ-REITマザーファンド （東証REIT指数（配当込み））
海外リート	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド （S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））
国内債券	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI） （NOMURA-BPI総合指数）
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド （NOMURA-BPI総合短期指数） ※2030年の決算日以降
海外債券	外国債券インデックスマザーファンド （シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

（注）くわしくは、後掲の「〈参考〉各マザーファンドの概要」をご参照下さい。

マザーファンド方式について

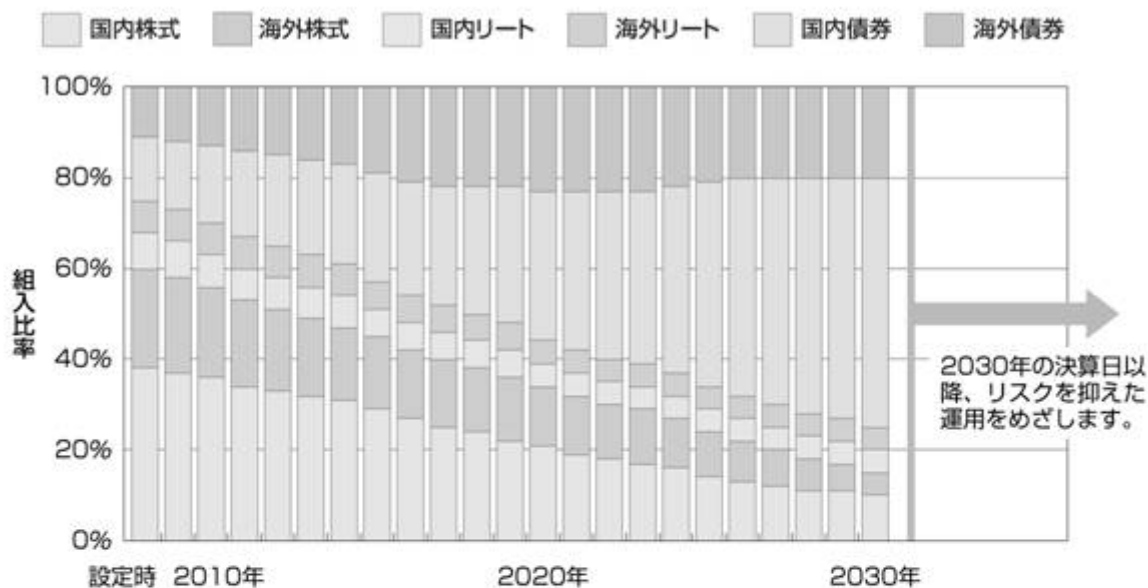
当ファンドは、マザーファンド方式で運用を行ないます。

マザーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主として各マザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なうしくみです。



（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

■ ファンドの基本配分比率のイメージは…



- (注1) 2009年2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。
- (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。

3

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

4

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。

5

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4.の前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合を除きます。)

(2) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者		
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金(※3)		
お取扱窓口	<table border="1"> <tr> <td>販売会社</td><td> 受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など </td></tr> </table>	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など		
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金(※3)		
委託会社	<table border="1"> <tr> <td>大和証券投資信託委託株式会社</td><td> 当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など </td></tr> </table>	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など		
↓運用指図 ↑↓※2	損益↑↓信託金(※3)		
受託会社	<table border="1"> <tr> <td> 住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社 </td><td> 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。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など </td></tr> </table>	住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など		
	損益↑↓投資		
投資対象	内外の株式・債券・リート（REIT）および短期金融資産 など（マザーファンド方式で運用を行ないます。）		

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

<委託会社の概況（平成21年1月末日現在）>

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

① 主要投資対象

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
3. ダイワJ－REITマザーファンドの受益証券
4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券

6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券

7. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

② 投資態度

イ. 主として、マザーファンドを通じて内外の株式、債券、リート（REIT）に投資するとともに、短期金融資産に投資を行ない、中長期的に安定した信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

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-REIT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REITインデックス・マザーファンドの受益証券

……信託財産の純資産総額の 7%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券

……信託財産の純資産総額の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】

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

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

イ. 有価証券

ロ. 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

② 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。

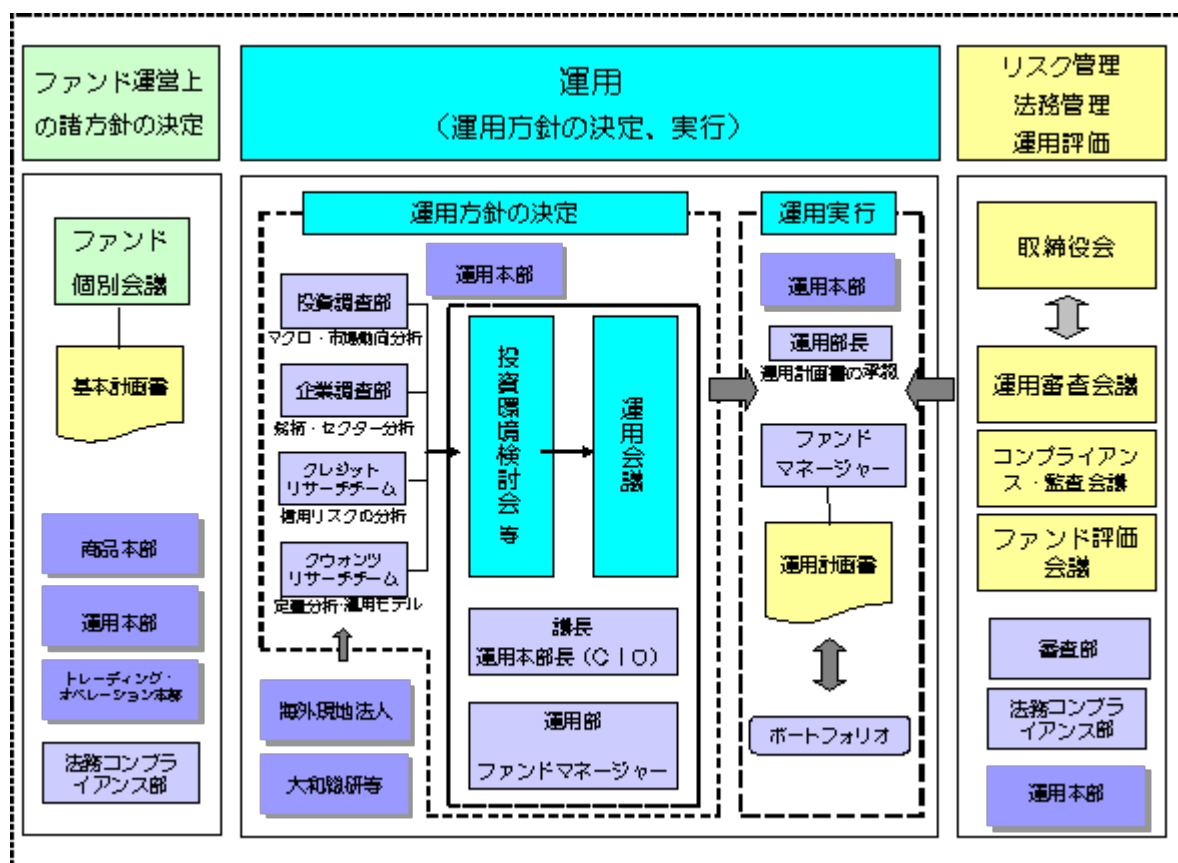
1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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。）
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ. 基本計画書の策定

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

ロ. 投資環境の検討

運用最高責任者である運用本部長（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。

③ 職務権限

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

イ．運用本部長（ＣＩＯ）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．運用副本部長（1～5名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は15～25名程度です。

⑤ 受託会社に対する管理体制

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

※ 上記の運用体制は平成21年1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】

- 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。
- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

① 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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

① 主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3) 主な投資制限

① 株式への投資には、制限を設けません。

② 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。

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

2. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ. 主として外国の株式（預託証券を含みます。）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

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証券

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。

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

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

(3) 主な投資制限

- ① 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）MSCIコクサイ指数とは

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

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

3. ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第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。

② 投資態度

- イ. 東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」（配当込み、以下同じ。）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ. 投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。
- ハ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、「東証REIT指数」が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

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

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

イ. 有価証券

ロ. 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

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

- 1. 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。）

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

- 1. 預金
- 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3. コール・ローン
- 4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への直接投資は、行ないません。

② 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。

③ 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。

④ 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^{（注1）} ÷ 基準時の時価総額^{（注2）} × 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。
- ③（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。
- ④（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。
- ⑤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。
- ⑥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。
- ⑦（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。
- ⑧（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。
- ⑨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

① 主要投資対象

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

託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

- イ. 主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ. 組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。
- ハ. 保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- 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

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

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

- イ. 有価証券

- ロ. 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

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

- 1. 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。）

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

- 1. 預金

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

- 3. コール・ローン

- 4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

① 株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 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ますものとしします。

④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注） 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、The McGraw-Hill Companies, Inc. の一部門であるStandard & Poor's（以下「S&P」という）によって資金提供、保証、売買又は販売促進されるものではない。S&Pは、本商品の所有者若しくは一般の者に対して、一般に証券について若しくは特に本商品に対する投資の妥当性に関して、又はS & P先進国REIT指数（除く日本）の株式市場の運用成績を追跡する能力に関して、明示的にも黙示的にも、表明又は保証するものではない。S&Pのライセンシーに対する唯一の関係は、S&Pの特定の商標及び商号についてのライセンスを行うこと、並びにS&Pによりライセンシー又は本商品と関係なく決定、作成及び計算されたS & P先進国REIT指数（除く日本）についてライセンスすることである。S&Pは、S & P先進国REIT指数（除く日本）の決定、作成及び計算において、本商品のライセンシー又は所有者の要求を考慮に入れる義務を負わない。S&Pは、本商品の価格及び量の決定、本商品の発行若しくは販売の時期の決定、又は、本商品を現金に換算する方程式の決定若しくは計算に、責任を負わず、また関わっていない。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負うものではない。

S&Pは、S & P先進国REIT指数（除く日本）、又はそれに含まれるデータの正確性及び／又は完全性を保証しない。また、S&Pは、当該商品に含まれる誤り、欠落又は障害に対する責任を負わないものとする。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、ライセンシー、本商品の所有者又はその他の人や組織に生じた結果に関して、明示的にも黙示的にも保証しないものとする。また、S&Pは、S & P先進国REIT指数（除く日本）又はそれに含まれるデータに関して、その市場性又は特別な目的若しくは使用への適合性について、明示若しくは黙示の保証を行わず、かつあらゆる保証を放棄する。前述のいずれかを制限することなく、S&Pは、特別な、懲罰的な、間接の又は派生的な損害（逸失利益を含む）の可能性を通知されたとしても、かかる損害に対して何ら責任を負わないものとする。

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

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。
1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの
 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. コマーシャル・ペーパー
 8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
 9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2

項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 主な投資制限

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

- ② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

- ③ 外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

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

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

⑤ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥ 金利先渡取引

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

図をすることができます。

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

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

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

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

(注) NOMURA-BPI 総合指数とは

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

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

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

① 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。

② 投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資し、ベンチマーク（NOMURA-BPI 総合短期指数）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-BPI 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

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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)③の 1.から4.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)③の 1.から4.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。

⑤ スワップ取引

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

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

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

とします。

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

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

⑥ 金利先渡取引

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

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

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

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

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

(注) NOMURA-BPI 総合短期指数とは

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

NOMURA-BPI 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、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

7. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

- ① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
1. 転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

- ① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限りします。
- ② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは
シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、シティグループ・グローバル・マーケット・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

当ファンドは、株式、公社債、不動産投資信託証券（リート）など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。投資家のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

〈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
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
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
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、必ずしも上図とおりにならない場合もあります。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉

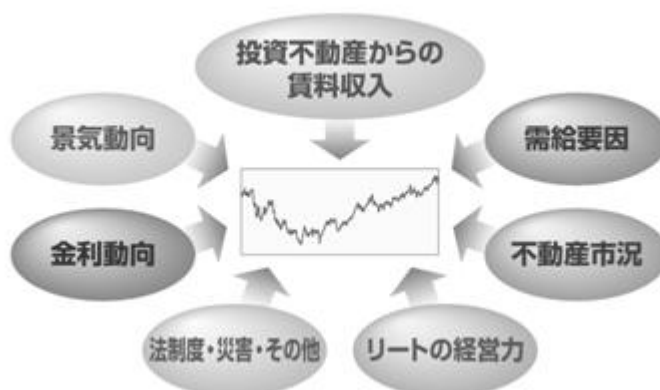


※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

③ リートの価格変動

〈リー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があります。

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。

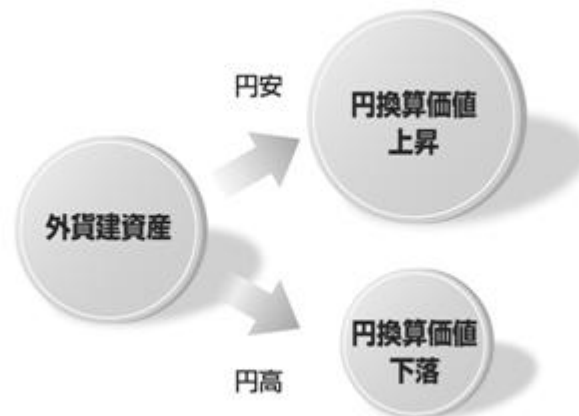
- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当が影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

二、組入リートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

④ 外国証券への投資に伴うリスク

イ、為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ、カントリー・リスク

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

⑤ 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

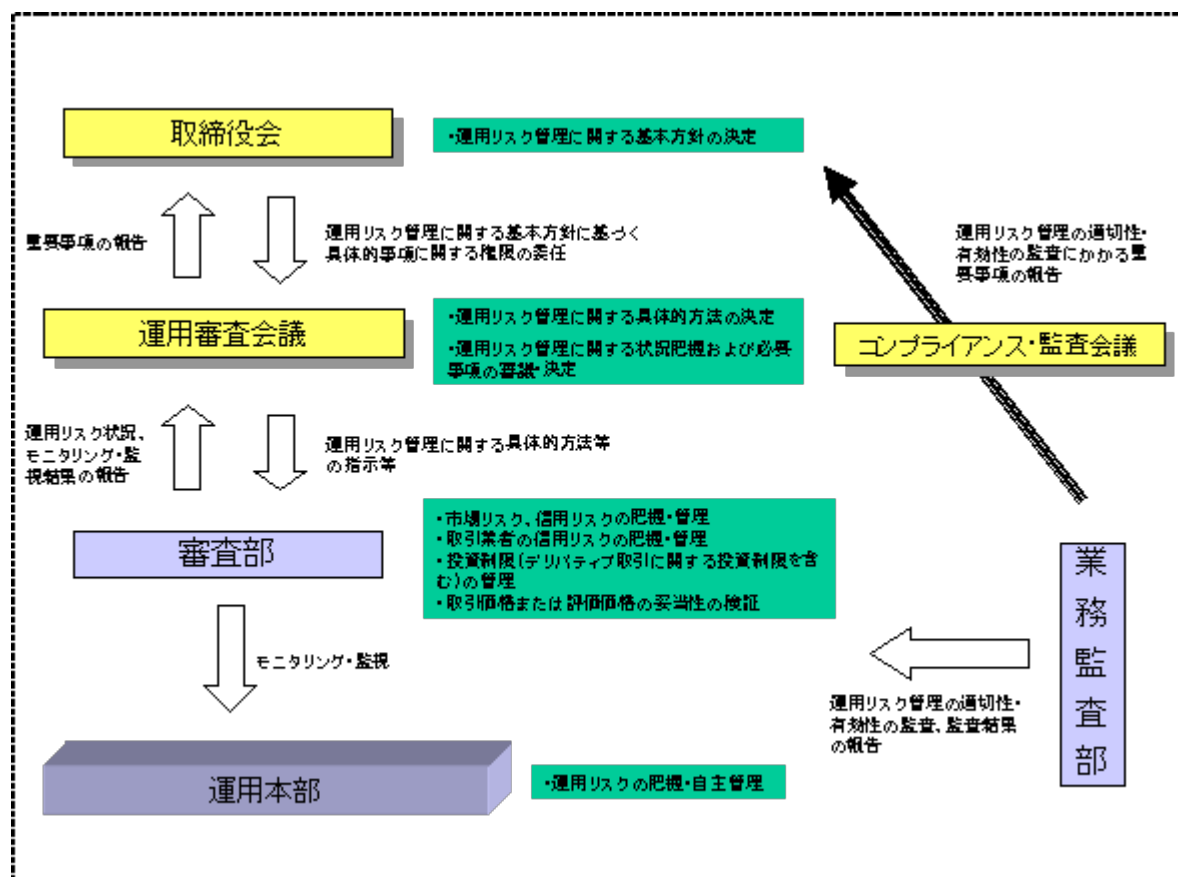
通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

① 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。

- ② 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) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

- ② 申込手数料には、消費税等が課されます。
- ③ 収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に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%）

- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

<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0.315% （税抜0.3%）	年0.315% （税抜0.3%）	年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0.1155% （税抜0.11%）	年0.1155% （税抜0.11%）	年0.0315% （税抜0.03%）

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

(4) 【その他の手数料等】

- ① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。
- ② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（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。
- ③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。
- ④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

<マザーファンドより支弁する手数料等>

各マザーファンドの投資対象等に応じて、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取

引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

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

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

イ. 収益分配金に対する課税

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

ただし、平成21年1月1日から平成22年12月31日までの2年間は特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行なわれます。平成21年および平成22年において、1年間に受取る普通分配金など上場株式等の配当等の金額の合計額が100万円（年間の支払金額が1万円以下のものは除外されます。）を超える場合には、確定申告が必要となります。この場合申告分離課税または総合課税を選択することができ、申告分離課税を選択した場合は、その超える部分については20%（所得税15%および地方税5%）の税率が適用されます。

ロ. 解約金および償還金に対する課税

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

ただし、平成21年1月1日から平成22年12月31日までの2年間は特例措置として、1年間の上場株式等の譲渡所得等の金額の合計額が500万円までは、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率が適用され、源泉徴収選択口座においては申告不要の特例があります。なお、当該合計額が500万円を超える場合には、確定申告が必要となります。この場合、その超える部分については、20%（所得税15%および地方税5%）の税率が適用されます。

ハ. 損益通算について

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

<注1> 個別元本について

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

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

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

③ 受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特

別分配金」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

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

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

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成21年1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	2,958,968	99.90
内 日本	2,958,968	99.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,938	0.10
純資産総額	2,961,906	100.00

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	68,113,848,770	96.99
内 日本	68,113,848,770	96.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,114,160,788	3.01
純資産総額	70,228,009,558	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）	2,283,100,000	3.25
内 日本	2,283,100,000	3.25

（参考）外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	28,605,057,103	97.33
内 オーストラリア	823,269,827	2.80
内 カナダ	1,357,303,723	4.62
内 スイス	1,235,928,297	4.21
内 デンマーク	139,791,824	0.48
内 ユーロ	4,902,280,876	16.68
内 英国	3,058,718,365	10.41
内 香港	316,797,080	1.08
内 ノルウェー	97,953,625	0.33
内 ニュージーランド	11,365,203	0.04
内 スウェーデン	298,622,656	1.02
内 シンガポール	169,198,599	0.58
内 米国	16,193,827,027	55.10
投資証券	352,954,524	1.20
内 オーストラリア	61,345,738	0.21
内 ユーロ	38,909,695	0.13
内 英国	27,281,316	0.09
内 香港	9,507,960	0.03

	内 シンガポール	3,587,103	0.01
	内 米国	212,322,712	0.72
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		433,237,476	1.47
純資産総額		29,391,249,103	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）		415,100,070	1.41
	内 米国	415,100,070	1.41
為替予約取引（買建）		63,662,500	0.22
	内 日本	63,662,500	0.22

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
投資証券		19,523,543,050	97.58
	内 日本	19,523,543,050	97.58
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		483,227,469	2.42
純資産総額		20,006,770,519	100.00

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
投資証券		249,463,558	97.54
	内 オーストラリア	34,706,378	13.57
	内 カナダ	5,809,446	2.27
	内 ユーロ	31,253,522	12.22
	内 英国	15,381,353	6.01
	内 香港	6,030,602	2.36
	内 ニュージーランド	1,198,321	0.47
	内 シンガポール	5,526,572	2.16
	内 米国	149,557,365	58.48
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,285,909	2.46
純資産総額		255,749,467	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）		2,077,935	0.81
	内 日本	2,077,935	0.81

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
国債証券		6,154,408,270	62.47
	内 日本	6,154,408,270	62.47

地方債証券	886,375,629	9.00
内 日本	886,375,629	9.00
特殊債券	1,513,900,944	15.37
内 日本	1,513,900,944	15.37
社債券	1,209,848,702	12.28
内 日本	1,209,848,702	12.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	87,508,704	0.89
純資産総額	9,852,042,249	100.00

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
国債証券	73,273,738,531	96.28
内 オーストラリア	304,194,191	0.40
内 カナダ	1,767,145,510	2.32
内 スイス	588,857,580	0.77
内 デンマーク	677,766,014	0.89
内 ユーロ	37,934,058,574	49.84
内 英国	6,041,538,816	7.94
内 マレーシア	430,737,208	0.57
内 ノルウェー	227,328,795	0.30
内 ポーランド	641,415,833	0.84
内 スウェーデン	478,659,668	0.63
内 シンガポール	343,064,118	0.45
内 米国	23,838,972,226	31.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,830,694,302	3.72
純資産総額	76,104,432,833	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）	2,411,246,384	3.17
内 日本	2,411,246,384	3.17

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

（2）【投資資産】（平成21年1月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	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 —	2,703,788	0.43244 1,169,251	0.4095 1,107,201	— —	37.38%
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 —	1,052,217	0.65125 685,260	0.6128 644,798	— —	21.77%
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 —	409,790	1.05584 432,674	1.0598 434,295	— —	14.66%
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 —	190,606	1.79534 342,203	1.6806 320,332	— —	10.82%
5	ダイワJ-REITマザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券 —	292,518	0.85211 249,258	0.8516 249,108	— —	8.41%
6	ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券 —	370,799	0.61361 227,527	0.5481 203,234	— —	6.86%

（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
親投資信託受益証券	99.90%
合計	99.90%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	863,000	4,500 3,883,871,500	2,925 2,524,275,000	— —	3.59%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	3,861,400	809 3,124,136,377	510 1,969,314,000	— —	2.80%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	304,700	4,729 1,441,035,095	4,400 1,340,680,000	— —	1.91%
4	東京電力 日本	株式 電気・ガス業	423,000	2,690 1,137,988,000	2,830 1,197,090,000	— —	1.70%

5	本田技研 日本	株式 輸送用機器	573,800	3,157 1,811,617,000	2,070 1,187,766,000	— —	1.69%
6	武田薬品 日本	株式 医薬品	254,700	5,083 1,294,891,000	4,250 1,082,475,000	— —	1.54%
7	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	6,553	156,050 1,022,599,187	158,400 1,037,995,200	— —	1.48%
8	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	279,700	6,197 1,733,371,741	3,650 1,020,905,000	— —	1.45%
9	任 天 堂 日本	株式 その他製品	35,400	45,276 1,602,794,290	28,300 1,001,820,000	— —	1.43%
10	キャノン 日本	株式 電気機器	389,400	4,071 1,585,353,900	2,475 963,765,000	— —	1.37%
11	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	3,726,000	423 1,577,930,043	227 845,802,000	— —	1.20%
12	パナソニック 日本	株式 電気機器	716,000	1,894 1,356,545,000	1,099 786,884,000	— —	1.12%
13	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	124,900	7,643 954,668,461	6,150 768,135,000	— —	1.09%
14	東京海上HD 日本	株式 保険業	285,000	3,533 1,007,123,300	2,435 693,975,000	— —	0.99%
15	関西電力 日本	株式 電気・ガス業	278,700	2,432 677,809,200	2,485 692,569,500	— —	0.99%
16	セブン&アイ・HLDGS 日本	株式 小売業	264,700	2,954 782,091,000	2,435 644,544,500	— —	0.92%
17	ソ ニ ー 日本	株式 電気機器	356,000	3,198 1,138,658,807	1,780 633,680,000	— —	0.90%
18	三菱商事 日本	株式 卸売業	494,100	2,470 1,220,873,400	1,221 603,296,100	— —	0.86%
19	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,030	572,944 590,133,158	570,000 587,100,000	— —	0.84%
20	中部電力 日本	株式 電気・ガス業	227,400	2,548 579,511,700	2,570 584,418,000	— —	0.83%
21	三菱地所 日本	株式 不動産業	461,000	2,086 961,692,000	1,211 558,271,000	— —	0.79%
22	三井物産 日本	株式 卸売業	569,000	1,417 806,397,000	960 546,240,000	— —	0.78%
23	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	157,400	4,221 664,478,300	3,440 541,456,000	— —	0.77%
24	信越化学 日本	株式 化学	117,000	5,052 591,158,000	4,260 498,420,000	— —	0.71%
25	新日本製鐵 日本	株式 鉄鋼	1,842,000	422 777,956,960	269 495,498,000	— —	0.71%
26	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,666	413,509 688,907,387	261,000 434,826,000	— —	0.62%
27	第一三共 日本	株式 医薬品	206,500	2,771 572,346,128	2,040 421,260,000	— —	0.60%
28	三菱重工業 日本	株式 機械	1,195,000	466 556,955,000	345 412,275,000	— —	0.59%
29	野村ホールディングス 日本	株式 証券・商品先物取引業	694,900	1,237 860,026,581	593 412,075,700	— —	0.59%
30	JFEホールディングス 日本	株式 鉄鋼	179,000	3,662 655,500,400	2,285 409,015,000	— —	0.58%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

株式	96.99%
合計	96.99%

（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	0.41%
建設業	2.19%
食料品	3.39%
繊維製品	0.88%
パルプ・紙	0.49%
化学	5.34%
医薬品	5.23%
石油・石炭製品	0.76%
ゴム製品	0.53%
ガラス・土石製品	0.92%
鉄鋼	2.30%
非鉄金属	0.97%
金属製品	0.61%
機械	3.71%
電気機器	11.25%
輸送用機器	7.81%
精密機器	1.10%
その他製品	2.47%
電気・ガス業	7.04%
陸運業	4.49%
海運業	0.62%
空運業	0.61%
倉庫・運輸関連業	0.26%
情報・通信業	6.65%
卸売業	4.04%
小売業	3.92%
銀行業	10.42%
証券・商品先物取引業	1.27%
保険業	2.69%
その他金融業	0.74%
不動産業	2.06%
サービス業	1.66%
合計	96.99%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2009年3月	買建	289	2,360,195,351	2,283,100,000	3.25%

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

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

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	EXXON MOBIL CORP 米国	株式 石油・石炭製 品	122,600	7,170 879,063,814	6,877 843,174,144	— —	2.87%
2	PROCTER & GAMBLE CO 米国	株式 化学	69,637	5,688 396,134,898	5,213 363,059,533	— —	1.24%
3	JOHNSON & JOHNSON 米国	株式 医薬品	63,200	5,247 331,659,529	5,218 329,839,157	— —	1.12%
4	CHEVRON CORP 米国	株式 石油・石炭製 品	48,718	7,014 341,751,741	6,324 308,093,655	— —	1.05%
5	AT&T INC 米国	株式 情報・通信業	136,995	2,540 347,983,081	2,212 303,139,865	— —	1.03%
6	MICROSOFT CORP 米国	株式 サービス業	184,700	1,805 333,384,771	1,575 290,936,577	— —	0.99%
7	GENERAL ELECTRIC CO 米国	株式 電気機器	249,100	1,523 379,511,325	1,139 283,743,832	— —	0.97%
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食料品	89,300	3,386 302,379,639	3,114 278,106,454	— —	0.95%
9	BP PLC 英国	株式 石油・石炭製 品	437,400	668 292,427,586	634 277,586,375	— —	0.94%
10	INT'L BUSINESS MACHINES 米国	株式 電気機器	30,000	7,293 218,799,754	8,284 248,528,115	— —	0.85%
11	WAL-MART STORES 米国	株式 小売業	54,400	5,006 272,342,773	4,285 233,150,947	— —	0.79%
12	TOTAL SA ユーロ	株式 石油・石炭製 品	49,550	4,747 235,226,675	4,558 225,889,224	— —	0.77%
13	PFIZER INC 米国	株式 医薬品	158,960	1,476 234,756,661	1,353 215,231,204	— —	0.73%
14	HSBC HOLDINGS PLC 英国	株式 銀行業	294,000	892 262,432,075	703 206,771,788	— —	0.70%
15	VODAFONE GROUP PLC 英国	株式 情報・通信業	1,229,737	161 198,450,213	167 206,132,500	— —	0.70%
16	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	56,100	4,361 244,686,387	3,664 205,568,969	— —	0.70%
17	ROCHE HOLDING AG-GENUS スイス	株式 医薬品	16,150	13,183 212,917,615	12,418 200,557,822	— —	0.68%
18	JPMORGAN CHASE & CO 米国	株式 銀行業	84,120	2,823 237,515,184	2,277 191,562,817	— —	0.65%

19	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S 英国	株式 石油・石炭製品	83,600	2,211 184,896,400	2,290 191,486,786	— —	0.65%
20	CISCO SYSTEMS 米国	株式 電気機器	131,800	1,480 195,182,911	1,426 188,016,852	— —	0.64%
21	GLAXOSMITHKLINE PLC 英国	株式 医薬品	121,102	1,424 172,499,626	1,545 187,131,291	— —	0.64%
22	VERIZON COMMUNICATIONS 米国	株式 情報・通信業	67,200	2,904 195,206,463	2,707 181,916,885	— —	0.62%
23	HEWLETT-PACKARD CO 米国	株式 電気機器	56,000	3,158 176,859,459	3,217 180,181,764	— —	0.61%
24	APPLE INC 米国	株式 電気機器	21,600	8,303 179,354,501	8,328 179,888,040	— —	0.61%
25	COCA COLA CO 米国	株式 食料品	45,900	4,189 192,297,610	3,899 179,005,525	— —	0.61%
26	GOOGLE INC-CL A 米国	株式 サービス業	5,800	26,592 154,234,741	30,744 178,316,975	— —	0.61%
27	ABBOTT LABS 米国	株式 医薬品	34,800	4,696 163,449,973	4,961 172,676,399	— —	0.59%
28	TELEFONICA S.A. ユーロ	株式 情報・通信業	102,827	1,839 189,180,117	1,622 166,789,630	— —	0.57%
29	PHILIP MORRIS INTERNATION 米国	株式 食料品	45,500	3,775 171,781,974	3,470 157,887,844	— —	0.54%
30	PEPSICO INC 米国	株式 食料品	34,100	5,077 173,142,239	4,627 157,812,890	— —	0.54%

（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	97.33%
投資証券	1.20%
合計	98.53%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.30%
鉱業	2.38%
建設業	0.76%
食料品	6.65%
繊維製品	0.18%
パルプ・紙	0.22%
化学	4.15%
医薬品	9.36%
石油・石炭製品	10.01%
ゴム製品	0.08%
ガラス・土石製品	0.24%
鉄鋼	0.52%
非鉄金属	0.06%
金属製品	0.26%
機械	2.10%

電気機器	8.13%
輸送用機器	1.77%
精密機器	0.36%
その他製品	0.91%
電気・ガス業	3.38%
陸運業	0.82%
海運業	0.18%
空運業	0.12%
倉庫・運輸関連業	0.01%
情報・通信業	5.39%
卸売業	0.30%
小売業	4.68%
銀行業	8.65%
証券・商品先物取引業	0.53%
保険業	4.20%
その他金融業	1.45%
不動産業	0.47%
サービス業	10.20%
消費材	0.24%
石油他	2.44%
建設資材	0.34%
水道	0.19%
持株会社	0.30%
コンク`ロマリット	0.90%
電力	1.93%
フ`ランテーション	0.02%
その他製造	1.81%
新聞・出版	0.35%
合計	97.33%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	米国	S&P500 2009年3月	買建	22	432,586,051	415,100,070	1.41%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2009年2月	買建	250,000	31,837,500	31,790,000	0.11%
		オーストラリアドル買/円売 2009年2月	買建	550,000	32,642,500	31,872,500	0.11%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（注4）為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	日本ビルファンド 日本	投資証券 —	4,030	1,045,362 4,212,812,051	978,000 3,941,340,000	— —	19.70%
2	ジャパンリアルエステイト 日本	投資証券 —	3,294	934,252 3,077,426,956	824,000 2,714,256,000	— —	13.57%
3	野村不動産オフィスF 日本	投資証券 —	2,269	704,378 1,598,235,248	575,000 1,304,675,000	— —	6.52%
4	日本リテールファンド 日本	投資証券 —	2,874	459,845 1,321,595,048	402,000 1,155,348,000	— —	5.77%
5	日本プライムリアルティ 日本	投資証券 —	4,647	269,590 1,252,785,139	235,400 1,093,903,800	— —	5.47%
6	森トラスト総合リート 日本	投資証券 —	1,353	796,410 1,077,543,848	694,000 938,982,000	— —	4.69%
7	オリックス不動産投資 日本	投資証券 —	1,871	553,665 1,035,908,388	432,000 808,272,000	— —	4.04%
8	東急リアル・エステート 日本	投資証券 —	1,259	670,546 844,217,775	587,000 739,033,000	— —	3.69%
9	ユナイテッド・アーバン投資 法人 日本	投資証券 —	1,497	466,782 698,773,190	374,000 559,878,000	— —	2.80%
10	フロンティア不動産投資 日本	投資証券 —	1,190	554,887 660,316,029	468,000 556,920,000	— —	2.78%
11	グローバル・ワン不動産投資 法人 日本	投資証券 —	720	974,999 701,999,865	725,000 522,000,000	— —	2.61%
12	日本ロジスティクスファンド 投資法人 日本	投資証券 —	909	626,832 569,791,001	500,000 454,500,000	— —	2.27%
13	ジャパンエクセレント投資法 人 日本	投資証券 —	1,149	470,594 540,713,194	390,000 448,110,000	— —	2.24%
14	トップリート投資法人 日本	投資証券 —	1,152	383,545 441,844,222	347,000 399,744,000	— —	2.00%
15	DAオフィス投資法人 日本	投資証券 —	2,557	377,487 965,236,371	156,000 398,892,000	— —	1.99%
16	ケネディクス不動産投資法人 日本	投資証券 —	1,487	437,139 650,027,133	238,000 353,906,000	— —	1.77%
17	日本アコモデーションファン ド投資法人 日本	投資証券 —	844	468,912 395,762,093	388,000 327,472,000	— —	1.64%
18	福岡リート投資法人 日本	投資証券 —	796	524,462 417,472,035	401,000 319,196,000	— —	1.60%
19	森ヒルズリート 日本	投資証券 —	1,184	429,446 508,464,625	265,000 313,760,000	— —	1.57%
20	プレミアム投資法人 日本	投資証券 —	977	448,438 438,124,253	283,800 277,272,600	— —	1.39%
21	阪急リート投資法人 日本	投資証券 —	635	454,795 288,795,331	369,000 234,315,000	— —	1.17%
22	野村不レジデンシャル 日本	投資証券 —	719	399,203 287,027,607	318,000 228,642,000	— —	1.14%

23	M I Dリート投資法人 日本	投資証券 —	1,365	261,193 356,529,121	144,900 197,788,500	— —	0.99%
24	アドバンス・レジデンス投資 法人 日本	投資証券 —	565	321,189 181,472,346	300,000 169,500,000	— —	0.85%
25	産業ファンド 日本	投資証券 —	588	313,842 184,539,643	245,100 144,118,800	— —	0.72%
26	日本コマーシャル投資 日本	投資証券 —	1,914	252,325 482,950,111	59,800 114,457,200	— —	0.57%
27	リプラス・レジデンシャル投 資法人 日本	投資証券 —	1,245	144,496 179,898,311	74,000 92,130,000	— —	0.46%
28	日本レジデンシャル 日本	投資証券 —	1,838	261,008 479,733,897	49,000 90,062,000	— —	0.45%
29	ジョイントリート投資法人 日本	投資証券 —	778	231,974 180,476,445	113,300 88,147,400	— —	0.44%
30	クレッシェンド投資法人 日本	投資証券 —	808	198,322 160,244,457	103,000 83,224,000	— —	0.42%

（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	97.58%
合計	97.58%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考）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

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資証券 —	24,000	847 20,334,754	710 17,043,180	— —	6.66%
2	UNIBAIL-RODAMCO ユーロ	投資証券 —	1,000	12,048 12,048,954	12,142 12,142,203	— —	4.75%
3	SIMON PROPERTY GROUP INC 米国	投資証券 —	2,800	4,178 11,700,155	3,979 11,142,886	— —	4.36%
4	PUBLIC STORAGE 米国	投資証券 —	1,600	6,082 9,732,133	5,701 9,122,638	— —	3.57%
5	VORNADO REALTY TRUST 米国	投資証券 —	1,700	4,737 8,053,679	4,757 8,088,246	— —	3.16%
6	EQUITY RESIDENTIAL 米国	投資証券 —	3,400	2,636 8,964,911	2,236 7,605,661	— —	2.97%

7	HCP INC 米国	投資証券 —	3,100	1,865 5,782,287	2,183 6,768,010	— —	2.65%
8	BOSTON PROPERTIES INC 米国	投資証券 —	1,500	4,624 6,936,364	3,963 5,945,225	— —	2.32%
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC 米国	投資証券 —	1,000	5,262 5,262,854	4,896 4,896,594	— —	1.91%
10	VENTAS INC 米国	投資証券 —	1,800	2,132 3,839,277	2,575 4,635,824	— —	1.81%
11	LAND SECURITIES PLC 英国	投資証券 —	5,750	1,155 6,644,813	805 4,632,690	— —	1.81%
12	LINK REIT 香港	投資証券 —	27,000	169 4,571,299	169 4,584,195	— —	1.79%
13	HEALTH CARE REIT INC 米国	投資証券 —	1,300	3,396 4,415,531	3,313 4,307,355	— —	1.68%
14	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 —	19,500	247 4,835,289	210 4,103,406	— —	1.60%
15	KIMCO REALTY CORP 米国	投資証券 —	2,800	1,291 3,616,886	1,381 3,868,918	— —	1.51%
16	BRITISH LAND CO PLC 英国	投資証券 —	6,300	655 4,130,252	564 3,553,473	— —	1.39%
17	HOST HOTELS&RESORTS INC 米国	投資証券 —	6,500	644 4,191,914	515 3,352,752	— —	1.31%
18	FEDERAL REALTY INVS TRUST 米国	投資証券 —	700	5,042 3,529,524	4,732 3,312,902	— —	1.30%
19	PROLOGIS 米国	投資証券 —	3,300	473 1,562,754	922 3,043,805	— —	1.19%
20	REGENCY CENTERS CORP 米国	投資証券 —	900	3,213 2,892,017	3,315 2,983,627	— —	1.17%
21	NATIONWIDE HEALTH PPTYS 米国	投資証券 —	1,200	2,070 2,484,465	2,322 2,786,438	— —	1.09%
22	DIGITAL REALTY TRUST INC 米国	投資証券 —	900	2,473 2,226,034	3,010 2,709,604	— —	1.06%
23	CFS RETAIL PROPERTY TRUST オーストラリア	投資証券 —	24,500	119 2,916,690	102 2,499,666	— —	0.98%
24	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 —	54,500	53 2,904,802	44 2,448,508	— —	0.96%
25	REALTY INCOME CORP 米国	投資証券 —	1,300	1,788 2,325,659	1,748 2,272,421	— —	0.89%
26	CORIO NV ユーロ	投資証券 —	550	4,082 2,245,349	4,043 2,223,953	— —	0.87%
27	LIBERTY PROPERTY TRUST 米国	投資証券 —	1,200	1,722 2,067,523	1,849 2,219,049	— —	0.87%
28	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ 米国	投資証券 —	400	4,238 1,695,450	5,509 2,203,646	— —	0.86%
29	KLEPIERRE ユーロ	投資証券 —	1,000	1,859 1,859,421	2,185 2,185,828	— —	0.85%
30	SENIOR HOUSING PROP TRUST 米国	投資証券 —	1,400	1,261 1,766,464	1,485 2,079,888	— —	0.81%

（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	97.54%
合計	97.54%

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

ハ、投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2009年2月	買建	19,000	1,699,778	1,701,260	0.67%
		オーストラリアドル買/円売 2009年2月	買建	6,500	376,408	376,675	0.15%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ、主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	2 8 9 1 0 年国債 日本	国債証券 —	155,000,000	101.65 157,568,050	102.48 158,856,400	1.500000 17/12/20	1.61%
2	2 8 8 1 0 年国債 日本	国債証券 —	133,000,000	103.59 137,783,520	104.31 138,738,950	1.700000 17/09/20	1.41%
3	3 9 0 東北電力 日本	社債券 —	130,000,000	103.50 134,556,240	103.77 134,904,380	2.250000 11/09/22	1.37%
4	2 9 6 1 0 年国債 日本	国債証券 —	120,000,000	100.86 121,032,990	101.88 122,262,000	1.500000 18/09/20	1.24%
5	5 政保中部空港 日本	特殊債券 —	121,000,000	100.33 121,407,145	100.20 121,248,171	0.800000 13/03/28	1.23%
6	2 7 2 1 0 年国債 日本	国債証券 —	107,000,000	103.06 110,283,830	103.38 110,620,880	1.400000 15/09/20	1.12%
7	2 8 6 1 0 年国債 日本	国債証券 —	103,000,000	104.56 107,704,010	105.40 108,568,180	1.800000 17/06/20	1.10%
8	1 4 4 神奈川県公債 日本	地方債証券 —	100,000,000	104.66 104,661,000	104.14 104,149,300	1.830000 16/12/20	1.06%
9	1 8 共同発行地方 日本	地方債証券 —	100,000,000	102.47 102,478,400	103.03 103,038,900	1.600000 14/09/25	1.05%
10	2 6 公営企業 日本	特殊債券 —	100,000,000	103.07 103,070,000	102.86 102,868,600	1.780000 17/03/24	1.04%
11	2 成田国際空港 日本	特殊債券 —	100,000,000	102.06 102,061,600	102.24 102,245,000	1.660000 15/12/18	1.04%
12	7 9 3 政保公営企業 日本	特殊債券 —	100,000,000	102.00 102,000,700	102.13 102,137,800	1.800000 10/09/22	1.04%
13	1 2 - こ 名古屋市債 日本	地方債証券 —	100,000,000	101.51 101,513,700	102.05 102,056,500	1.400000 12/05/21	1.04%

14	4 国際協力銀行 日本	特殊債券 —	100,000,000	101.45 101,456,400	101.96 101,961,400	1.520000 12/03/20	1.03%
15	2 8 0 10年国債 日本	国債証券 —	95,000,000	107.08 101,731,750	107.17 101,814,350	1.900000 16/06/20	1.03%
16	1 公営企業 日本	特殊債券 —	100,000,000	101.28 101,283,500	101.73 101,736,500	1.420000 11/12/26	1.03%
17	1 3 首都高速道路 日本	特殊債券 —	100,000,000	101.03 101,032,000	101.64 101,646,200	1.480000 15/03/20	1.03%
18	2 1 東京瓦斯 日本	社債券 —	100,000,000	101.13 101,131,400	101.59 101,597,200	1.390000 11/11/15	1.03%
19	4 8 2 東京電力 日本	社債券 —	100,000,000	101.14 101,141,600	101.50 101,500,200	1.450000 11/05/25	1.03%
20	1 7 - 9 千葉県5年 日本	地方債証券 —	100,500,000	100.58 101,092,447	100.94 101,452,840	1.100000 11/03/25	1.03%
21	4 1 三菱電機 日本	社債券 —	100,000,000	100.39 100,393,200	101.05 101,056,700	1.400000 12/12/07	1.03%
22	2 8 トヨタファイナンス 日本	社債券 —	100,000,000	100.28 100,288,800	100.65 100,659,300	1.250000 10/09/17	1.02%
23	4 みずほコーポレート 日本	社債券 —	100,000,000	100.23 100,236,300	100.63 100,638,600	1.400000 12/01/27	1.02%
24	い 6 8 8 利付商工債 日本	特殊債券 —	100,000,000	100.05 100,050,100	100.52 100,525,200	1.350000 12/09/27	1.02%
25	1 2 三菱UFJフィナンシ ヤ 日本	社債券 —	100,000,000	100.07 100,071,200	100.33 100,331,400	1.210000 11/03/16	1.02%
26	1 6 ソニー 日本	社債券 —	100,000,000	99.85 99,859,200	100.21 100,213,400	1.160000 12/09/20	1.02%
27	1 9 3 しんきん中金 日本	特殊債券 —	100,000,000	99.74 99,745,900	99.97 99,979,900	0.950000 10/12/27	1.01%
28	1 7 国民生活債券 日本	特殊債券 —	100,000,000	99.66 99,665,300	99.95 99,951,100	0.630000 10/03/19	1.01%
29	7 日産フィナンシャル 日本	社債券 —	100,000,000	99.74 99,745,100	99.61 99,612,300	1.180000 10/03/19	1.01%
30	3 1 7 政保道路債 日本	特殊債券 —	100,000,000	98.01 98,018,300	98.81 98,810,800	0.500000 13/06/24	1.00%

（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	62.47%
地方債証券	9.00%
特殊債券	15.37%
社債券	12.28%
合計	99.11%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	395,811,000	109.17 432,115,922	107.96 427,349,220	3.750000 18/11/15	0.56%
2	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	375,751,800	110.89 416,671,171	111.04 417,257,344	4.000000 15/02/15	0.55%
3	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	384,252,780	107.43 412,816,302	108.49 416,910,424	5.000000 12/01/04	0.55%
4	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	408,706,200	101.21 413,670,152	101.22 413,716,938	1.500000 10/10/31	0.54%
5	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	351,573,300	112.23 394,584,778	112.50 395,519,963	4.250000 15/08/15	0.52%
6	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	360,222,540	111.30 400,934,891	108.96 392,512,888	6.000000 31/05/01	0.52%
7	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	270,888,750	143.28 388,132,110	142.89 387,072,935	8.000000 21/11/15	0.51%
8	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	331,340,040	117.31 388,721,508	114.97 380,951,584	6.500000 27/11/01	0.50%
9	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	332,051,400	111.87 371,487,392	111.54 370,390,055	4.125000 15/05/15	0.49%
10	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	339,080,550	108.10 366,556,247	109.08 369,879,236	5.000000 12/07/04	0.49%
11	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	347,976,360	103.63 360,635,740	105.63 367,584,828	5.000000 12/02/01	0.48%
12	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	346,243,410	102.98 356,561,651	105.14 364,068,021	4.750000 13/02/01	0.48%
13	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	343,782,450	105.31 362,071,206	105.62 363,120,213	3.500000 18/02/15	0.48%
14	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	340,715,220	103.32 352,026,965	105.78 360,408,560	4.250000 11/03/07	0.47%
15	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	320,480,220	106.93 342,711,933	108.05 346,307,721	4.500000 13/01/04	0.46%
16	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	332,767,800	102.07 339,669,404	102.15 339,942,274	2.000000 10/09/30	0.45%
17	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	308,411,500	109.53 337,803,116	110.12 339,622,744	5.000000 18/03/07	0.45%
18	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	313,895,010	107.49 337,427,719	108.17 339,549,649	4.250000 14/07/04	0.45%
19	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	311,845,360	106.71 332,774,101	108.39 338,009,186	5.000000 12/03/07	0.44%
20	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	243,040,980	138.39 336,368,716	138.85 337,486,705	8.000000 21/06/07	0.44%
21	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	304,190,490	106.76 324,781,144	107.71 327,667,912	5.000000 11/07/04	0.43%

22	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	314,410,050	102.62 322,663,314	102.67 322,820,519	2.375000 10/08/31	0.42%
23	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	302,573,070	105.73 319,940,764	106.08 320,990,693	4.000000 16/07/04	0.42%
24	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	312,855,240	101.46 317,444,826	102.30 320,066,553	4.250000 14/08/01	0.42%
25	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	284,142,150	109.32 310,646,930	110.07 312,777,996	4.000000 18/08/15	0.41%
26	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	306,616,620	102.81 315,244,812	101.52 311,289,457	5.250000 29/11/01	0.41%
27	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	300,708,900	103.28 310,599,216	103.18 310,292,493	2.750000 10/07/31	0.41%
28	SPANISH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	301,879,890	101.73 307,129,539	102.35 308,989,161	4.000000 10/01/31	0.41%
29	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	273,933,450	111.76 306,161,720	112.23 307,446,468	4.250000 13/11/15	0.40%
30	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	281,958,060	107.34 302,679,701	108.62 306,291,041	4.750000 15/09/07	0.40%

（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	96.28%
合計	96.28%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2009年2月	買建	316,011	39,504,509	40,180,777	0.05%
		英ポンド買/円売 2009年3月	買建	694,000	88,177,770	88,144,940	0.12%
		カナダドル買/円売 2009年2月	買建	1,228,133	92,080,614	89,580,024	0.12%
		カナダドル買/円売 2009年3月	買建	325,000	23,687,227	23,682,750	0.03%
		スイスフラン買/円売 2009年2月	買建	212,766	17,601,526	16,480,853	0.02%
		スイスフラン買/円売 2009年3月	買建	101,000	7,825,938	7,820,430	0.01%
		デンマーククローネ買/円売 2009年2月	買建	554,739	9,445,941	8,598,458	0.01%
		デンマーククローネ買/円売 2009年3月	買建	573,000	8,859,732	8,858,580	0.01%

オーストラリアドル買/円売 2009年2月	買建	192,705	11,499,677	11,167,261	0.01%
米ドル買/円売 2009年2月	買建	4,319,896	392,785,585	386,803,495	0.51%
米ドル買/円売 2009年3月	買建	3,665,000	327,870,601	327,980,850	0.43%
マレーシアリンギット買/円 売 2009年2月	買建	683,051	16,966,978	16,939,656	0.02%
ノルウェークローネ買/円売 2009年2月	買建	578,482	7,704,796	7,485,551	0.01%
ホーランドスロチ買/円 売 2009年2月	買建	658,000	19,178,681	17,581,760	0.02%
ホーランドスロチ買/円 売 2009年3月	買建	344,000	9,015,168	9,164,160	0.01%
スウェーデンクローナ買/円 売 2009年2月	買建	1,139,976	13,250,465	12,380,137	0.02%
スウェーデンクローナ買/円 売 2009年3月	買建	594,000	6,446,049	6,444,900	0.01%
シンガポールドル買/円 売 2009年2月	買建	326,989	19,545,617	19,396,971	0.03%
ユーロ買/円売 2009年2月	買建	7,025,638	848,766,281	811,531,451	1.07%
ユーロ買/円売 2009年3月	買建	4,342,000	500,866,713	501,023,380	0.66%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
設定時 (平成20年2月28日)	1,000,000	—	1.0000	—
平成20年2月末日	978,887	—	0.9789	—
3月末日	926,350	—	0.9264	—
4月末日	993,208	—	0.9932	—
5月末日	1,491,427	—	1.0138	—
6月末日	5,205,218	—	0.9638	—
7月末日	4,536,285	—	0.9604	—
8月末日	4,559,797	—	0.9422	—
9月末日	4,023,262	—	0.8346	—
10月末日	4,074,680	—	0.6814	—
11月末日	3,825,283	—	0.6525	—
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
12月末日	2,849,639	—	0.6612	—
平成21年1月末日	2,961,906	—	0.6219	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金（円）
第1計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	△34.7

第二部 【ファンドの詳細情報】

第1 【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

第2 【手続等】

1 【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

委託会社の各営業日の午後3時（半休日においては午前11時）までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

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ないません。受託会社は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

2 【換金（解約）手続等】

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

<一部解約>

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

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

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、半休日は9:00～12:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

第3 【管理及び運営】

1 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産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。

- ・お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年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】

① 信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、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します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②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。

② 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②の1. から7. までに定める以外の方法によって

変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。

③ 反対者の買取請求権

前①の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②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②の2. に規定する書面に付記します。

④ 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られたる受益者に対して交付します。

⑤ 公告

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

2 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

① 収益分配金にかかる請求権

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

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

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

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

② 償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

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

③ 換金請求権

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

第4 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 第1期計算期間は投資信託約款第29条により、平成20年2月28日から平成20年12月18日までとなっております。

(3) 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1期計算期間（平成20年2月28日から平成20年12月18日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2030

(1) 【貸借対照表】

	第1期 平成20年12月18日現在	
	金 額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		11,850
親投資信託受益証券		2,733,173
流動資産合計		2,745,023
資産合計		2,745,023
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,083
未払受託者報酬		605
未払委託者報酬		7,476
その他未払費用		113
流動負債合計		9,277
負債合計		9,277
純資産の部		
元本等		
元本	※1	4,189,357
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△1,453,611
元本等合計		2,735,746
純資産合計		2,735,746
負債純資産合計		2,745,023

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第1期 自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日 金 額 (円)	
営業収益		
有価証券売買等損益		△1,711,627
営業収益合計		△1,711,627
営業費用		
受託者報酬		1,224
委託者報酬		15,602
その他費用		294
営業費用合計		17,120
営業損失（△）		△1,728,747
経常損失（△）		△1,728,747
当期純損失（△）		△1,728,747
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）		△1,052,453
剰余金増加額又は欠損金減少額		542,383
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額		542,383
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,319,700
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額		1,319,700
分配金 ※1		—
期末剰余金又は期末欠損金（△）		△1,453,611

(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1期 自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期 平成20年12月18日現在
1. ※1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	8,866,423円
期中一部解約元本額	5,677,066円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,189,357口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,453,611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1期 自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日
※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は0円であるため、分配を行っておりません。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第1期 平成20年12月18日現在	
	貸借対照表計上額 (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	2,733,173	△691,328
合計	2,733,173	△691,328

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

第1期 自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日	
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	

（1口当たり情報）

	第1期 平成20年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6530円 (6,530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	2,374,482	1,026,251	
	外国株式インデックスマザーファンド	919,201	602,260	
	ダイワJ－REITマザーファンド	252,710	215,258	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	322,286	199,527	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	363,604	383,674	
	外国債券インデックスマザーファンド	170,644	306,203	
親投資信託受益証券 合計		4,402,927	2,733,173	
合計		4,402,927	2,733,173	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

（参考）

当ファンドは「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「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20年12月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,667,449,046
株式 ※3	70,428,473,261
派生商品評価勘定	87,064
未収配当金	9,603,100
差入委託証拠金	149,953,000
流動資産合計	72,255,565,471
資産合計	72,255,565,471
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,714,145
前受金	17,923,000
未払解約金	28,310,000
流動負債合計	49,947,145
負債合計	49,947,145
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	167,083,825,350
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△94,878,207,024
元本等合計	72,205,618,326
純資産合計	72,205,618,326
負債純資産合計	72,255,565,471

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20年2月28日 至 平成20年12月18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）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年12月18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	128,713,135,861円
同期中における追加設定元本額	50,288,478,303円
同期中における一部解約元本額	11,917,788,814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	1,801,523,218円
トピックス・インデックスファンド	12,609,219,532円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	35,058,156,820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	1,145,903,185円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）	415,240,345円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）	7,100,835,522円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）	429,248,687円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）	8,987,264,026円
DCダイワ日本株式インデックス	44,095,430,126円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,726,336,404円
ダイワ・ライフ・バランス50	10,299,513円
ダイワ・ライフ・バランス70	19,430,719円
年金ダイワ日本株式インデックス	405,832,421円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	3,617,596円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	2,374,482円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	748,644円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	548,870,842円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	3,885,792,783円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA（国内株式型）	2,163,821,630円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	118,307,032円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	695,784,596円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA（国内株式型）	381,501,440円
ダイワ世界バランスファンド40VA	4,419,547,326円
ダイワ世界バランスファンド60VA	593,587,033円

ダイワ・バランスファンド35V A	23,217,268,251円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	1,997,002,793円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	4,149,155,495円
ダイワライフスタイル25	127,870,941円
ダイワライフスタイル50	361,520,506円
ダイワライフスタイル75	309,115,727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）	10,303,217,715円
計	167,083,825,350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	167,083,825,350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94,878,207,024円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 66,700,000円

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年12月18日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	70,428,473,261	△22,699,785,218
合計	70,428,473,261	△22,699,785,218

（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20年9月20日から平成20年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。

5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
--------------------------	--

II 取引の時価等に関する事項

株式関連

種 類	平成20年12月18日 現在			
	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	1,812,277,000	—	1,809,000,000	△3,277,000
合計	1,812,277,000	—	1,809,000,000	△3,277,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成20年12月18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)	0.4322円 (4,322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	217	8,463,000	
日本水産	87,000	251	21,837,000	
マルハニチロホールディングス	137,000	149	20,413,000	
サカタのタネ	14,100	1,396	19,683,600	
ホクト	6,900	2,480	17,112,000	
ショーボンドHD	7,500	1,929	14,467,500	
日鉄鉱業	21,000	274	5,754,000	
三井松島	32,000	128	4,096,000	
国際石油開発帝石	337	623,000	209,951,000	
関東天然瓦斯	12,000	580	6,960,000	
石油資源開発	10,500	3,690	38,745,000	
間組	40,500	81	3,280,500	
東急建設	28,280	236	6,674,080	

コムシスホールディングス	37,000	831	30,747,000
ミサワホーム	10,000	259	2,590,000
高松コンストラクションGP	6,400	1,411	9,030,400
東建コーポレーション	2,730	2,285	6,238,050
大成建設	327,000	238	77,826,000
大 林 組	206,000	535	110,210,000
清水建設	209,000	513	107,217,000
長谷工コーポレーション	335,500	98	32,879,000
鹿島建設	303,000	304	92,112,000
不動テトラ	47,400	51	2,417,400
鉄建建設	51,000	92	4,692,000
安藤建設	37,000	137	5,069,000
太平工業	14,000	287	4,018,000
西松建設	87,000	133	11,571,000
大豊建設	34,000	48	1,632,000
前田建設	46,000	350	16,100,000
奥 村 組	70,000	423	29,610,000
東鉄工業	20,000	513	10,260,000
浅沼組	33,000	59	1,947,000
戸田建設	79,000	320	25,280,000
熊 谷 組	60,000	42	2,520,000
青木あすなろ建設	7,500	450	3,375,000
北野建設	22,000	226	4,972,000
三井ホーム	14,000	416	5,824,000
大東建託	32,600	4,470	145,722,000
N I P P Oコーポレーション	15,000	683	10,245,000
前田道路	22,000	839	18,458,000
日本道路	39,000	154	6,006,000
東亜建設	69,000	126	8,694,000
五洋建設	90,500	126	11,403,000
住友林業	50,700	697	35,337,900
日本基礎技術	17,300	194	3,356,200
パナホーム	29,000	495	14,355,000
大和ハウス	184,000	818	150,512,000
ライト工業	27,400	164	4,493,600
積水ハウス	207,000	741	153,387,000
コミュニチュア	9,000	520	4,680,000
ユアテック	14,000	534	7,476,000
西部電気工業	10,000	403	4,030,000
中電工	11,000	1,449	15,939,000
関 電 工	34,000	648	22,032,000
大明	11,000	820	9,020,000
きんでん	43,000	786	33,798,000
東京エネシス	11,000	642	7,062,000
トーエネック	15,000	541	8,115,000
日本電設工業	16,000	987	15,792,000
協和エクシオ	27,000	941	25,407,000
日本工営	31,000	202	6,262,000
東電通	26,000	166	4,316,000
九電工	16,000	716	11,456,000
三機工業	18,000	637	11,466,000
日 揮	74,000	1,350	99,900,000
中外炉工業	27,000	273	7,371,000
太平電業	12,000	975	11,700,000
高砂熱学	21,000	822	17,262,000

日立プラントテクノロジー	21,000	289	6,069,000
NEC ネットエスアイ	6,600	1,110	7,326,000
大 気 社	11,000	1,350	14,850,000
ダイダン	12,000	434	5,208,000
日比谷総合設	12,000	774	9,288,000
東芝プラントシステム	12,000	867	10,404,000
日本製粉	48,000	466	22,368,000
日清製粉G本社	67,000	1,127	75,509,000
昭和産業	37,000	301	11,137,000
日本農産工業	29,000	187	5,423,000
協同飼料	41,000	109	4,469,000
中部飼料	9,000	671	6,039,000
日本配合飼料	31,000	104	3,224,000
ユニ・チャーム ペットケア	4,300	3,240	13,932,000
日本甜菜糖	44,000	242	10,648,000
三井製糖	31,000	350	10,850,000
日本M&Aセンター	14	469,000	6,566,000
アコーディア・ゴルフ	212	54,400	11,532,800
パソナグループ	73	46,800	3,416,400
テンプホールディングス	9,100	674	6,133,400
森永製菓	85,000	196	16,660,000
明治製菓	113,000	433	48,929,000
江崎グリコ	27,000	941	25,407,000
名糖産業	3,000	1,735	5,205,000
山崎製パン	49,000	1,365	66,885,000
明治乳業	89,000	492	43,788,000
雪印乳業	81,000	349	28,269,000
森永乳業	64,000	348	22,272,000
ヤクルト	39,100	1,863	72,843,300
プリマハム	42,000	190	7,980,000
日本ハム	56,000	1,287	72,072,000
伊藤ハム	47,000	302	14,194,000
丸大食品	32,000	248	7,936,000
米 久	8,000	1,128	9,024,000
S F o o d s	6,500	809	5,258,500
スタジオアリス	4,100	889	3,644,900
NEC フィールドینگ	6,400	1,157	7,404,800
新日鉄ソリューションズ	4,700	1,188	5,583,600
総合警備保障	23,100	871	20,120,100
日本駐車場開発	990	3,330	3,296,700
カカクコム	53	342,000	18,126,000
新日本科学	3,600	769	2,768,400
ソネット・エムスリー	33	308,000	10,164,000
ディー・エヌ・エー	89	274,000	24,386,000
博報堂DYHLDGS	9,470	4,710	44,603,700
パシフィックゴルフGRP	182	30,850	5,614,700
サッポロホールディングス	105,000	543	57,015,000
アサヒビール	137,900	1,539	212,228,100
キリンHD	301,000	1,109	333,809,000
宝ホールディングス	64,000	519	33,216,000
オエノンホールディングス	23,000	258	5,934,000
メルシャン	30,000	183	5,490,000
養 命 酒	7,000	865	6,055,000
三国コカ・コーラ	11,100	858	9,523,800
コカ・コーラウエストHLDGS	22,500	1,960	44,100,000

コカコーラセントラルジャパン	18	650,000	11,700,000
ダイドードリンコ	3,500	2,435	8,522,500
伊 藤 園	20,300	1,282	26,024,600
キーコーヒー	7,000	1,572	11,004,000
日清オイリオグループ	32,000	489	15,648,000
不二製油	19,700	1,285	25,314,500
Jーオイルミルズ	28,000	377	10,556,000
ローソン	20,200	5,100	103,020,000
サンエー	2,900	3,590	10,411,000
カワチ薬品	5,000	1,990	9,950,000
エービーシー・マート	6,700	3,490	23,383,000
アスクル	6,500	1,595	10,367,500
ゲオ	123	76,200	9,372,600
ポイント	5,830	5,410	31,540,300
伊藤忠食品	2,000	3,380	6,760,000
JALUX	4,200	1,402	5,888,400
エディオン	25,800	455	11,739,000
サーラコーポレーション	10,500	550	5,775,000
バルス	39	147,200	5,740,800
双日	399,700	144	57,556,800
アルフレッサホールディングス	12,800	4,080	52,224,000
ハニーズ	5,330	975	5,196,750
キッコーマン	65,000	1,028	66,820,000
味の素	200,000	960	192,000,000
キューピー	38,000	1,194	45,372,000
ハウス食品	26,900	1,595	42,905,500
カゴメ	28,700	1,466	42,074,200
焼津水産化工	5,600	1,002	5,611,200
アリアケジャパン	6,300	1,480	9,324,000
ニチレイ	85,000	418	35,530,000
横浜冷凍	18,000	618	11,124,000
東洋水産	29,000	2,635	76,415,000
日清食品HD	25,400	3,300	83,820,000
永谷園	9,000	863	7,767,000
フジッコ	10,000	1,157	11,570,000
ロックフィールド	4,600	1,174	5,400,400
日本たばこ産業	1,631	282,000	459,942,000
わらべや日洋	5,100	1,580	8,058,000
片倉工業	8,500	978	8,313,000
グンゼ	53,000	290	15,370,000
昭栄	11,900	1,016	12,090,400
神栄	24,000	129	3,096,000
アルペン	5,200	1,855	9,646,000
ビックカメラ	185	29,590	5,474,150
DCM JAPAN HLDGS	32,700	729	23,838,300
あいホールディングス	18,400	280	5,152,000
J. フロント リテイリング	166,000	399	66,234,000
ドトール・日レスHD	9,800	1,839	18,022,200
マツモトキヨシHLDGS	12,400	1,716	21,278,400
ココカラファイン HD	4,800	1,300	6,240,000
三越伊勢丹HD	119,400	824	98,385,600
東洋紡績	241,000	132	31,812,000
ユニチカ	178,000	64	11,392,000
富士紡ホールディングス	35,000	99	3,465,000
日清紡績	49,000	629	30,821,000

倉敷紡績	77,000	139	10,703,000
大和紡績	44,000	455	20,020,000
日東紡績	70,000	134	9,380,000
トヨタ紡織	22,900	696	15,938,400
日本毛織	25,000	628	15,700,000
ダイドーリミテッド	10,800	670	7,236,000
野村不動産HLDGS	18,200	1,764	32,104,800
三井鉱山	42,000	144	6,048,000
JFE商事HLDGS	43,000	267	11,481,000
サークルKサンクス	16,100	1,688	27,176,800
グリーンホスピタルサプライ	75	37,700	2,827,500
セブン&アイ・HLDGS	259,100	2,960	766,936,000
ツルハホールディングス	4,600	3,110	14,306,000
サンマルクホールディングス	2,300	2,795	6,428,500
帝 人	283,000	245	69,335,000
東 レ	458,000	433	198,314,000
三菱レイヨン	172,000	246	42,312,000
ク ラ レ	101,500	639	64,858,500
旭 化 成	428,000	373	159,644,000
サカイ オーベックス	36,000	75	2,700,000
稲葉製作所	5,100	997	5,084,700
宮地エンジニアリングG	44,000	52	2,288,000
三協・立山HLDGS	91,000	91	8,281,000
トーカロ	4,900	733	3,591,700
SUMCO	36,600	968	35,428,800
住江織物	27,000	133	3,591,000
日本バイリーン	12,000	404	4,848,000
アツギ	72,000	126	9,072,000
セーレン	18,600	402	7,477,200
小松精練	16,000	434	6,944,000
ワコールホールディングス	41,000	1,192	48,872,000
ホギメディカル	3,400	5,750	19,550,000
サンエー・インターナショナル	3,800	971	3,689,800
レナウン	14,800	117	1,731,600
ITホールディングス	22,300	1,262	28,142,600
特種東海HLDGS	46,000	253	11,638,000
ドワンゴ	32	189,000	6,048,000
マクロミル	33	101,700	3,356,100
ティーガイア	64	111,300	7,123,200
インターネットイニシアティブ	40	106,000	4,240,000
ソネットエンタテインメント	36	231,600	8,337,600
王子製紙	281,000	542	152,302,000
三菱製紙	102,000	198	20,196,000
北越製紙	41,500	548	22,742,000
中越パルプ	36,000	188	6,768,000
巴川製紙	18,000	131	2,358,000
大王製紙	29,000	1,087	31,523,000
日本製紙G本社	319	350,000	111,650,000
レンゴー	57,000	714	40,698,000
トーモク	27,000	180	4,860,000
ザ・パックス	5,200	1,282	6,666,400
昭和電工	358,000	128	45,824,000
住友化学	506,000	293	148,258,000
日本化成	22,000	126	2,772,000
住友精化	18,000	299	5,382,000

日産化学	48,000	844	40,512,000
ラサ工業	37,000	119	4,403,000
クレハ	45,000	383	17,235,000
テイカ	17,000	220	3,740,000
石原産業	101,000	67	6,767,000
日本曹達	42,000	318	13,356,000
東ソー	186,000	219	40,734,000
トクヤマ	84,000	734	61,656,000
セントラル硝子	71,000	324	23,004,000
東亜合成	75,000	256	19,200,000
ダイソー	30,000	237	7,110,000
関東電化	17,000	282	4,794,000
電気化学	147,000	218	32,046,000
イビデン	45,800	1,590	72,822,000
信越化学	114,600	3,780	433,188,000
日本カーバイド	23,000	80	1,840,000
堺 化 学	27,000	234	6,318,000
エア・ウォーター	49,000	782	38,318,000
大陽日酸	106,000	579	61,374,000
日本化学工業	28,000	173	4,844,000
日本パーカライジング	16,000	757	12,112,000
高压ガス	26,000	456	11,856,000
戸田工業	18,000	190	3,420,000
ステラ ケミファ	3,900	975	3,802,500
保土谷化学	26,000	154	4,004,000
日本触媒	46,000	654	30,084,000
大日精化	28,000	239	6,692,000
カネカ	84,000	497	41,748,000
協和発酵キリン	102,000	875	89,250,000
三菱瓦斯化学	116,000	328	38,048,000
三井化学	210,000	336	70,560,000
J S R	61,700	878	54,172,600
東京応化工業	13,500	1,276	17,226,000
三菱ケミカルH L D G S	398,500	398	158,603,000
日本合成化学	20,000	228	4,560,000
ダイセル化学	88,000	416	36,608,000
住友ベークライト	70,000	342	23,940,000
積水化学	152,000	538	81,776,000
日本ゼオン	60,000	284	17,040,000
アイカ工業	21,900	953	20,870,700
宇部興産	290,000	210	60,900,000
積水樹脂	13,000	735	9,555,000
タキロン	25,000	289	7,225,000
旭有機材	32,000	281	8,992,000
日立化成	30,000	902	27,060,000
ニチバン	14,000	294	4,116,000
大倉工業	22,000	200	4,400,000
積水化成品	25,000	307	7,675,000
群栄化学	24,000	210	5,040,000
日本化薬	54,000	468	25,272,000
イーピーエス	20	398,000	7,960,000
フェイス	416	7,960	3,311,360
野村総合研究所	31,500	1,806	56,889,000
ドリームインキュベータ	34	60,000	2,040,000
サイバネットシステム	105	38,500	4,042,500

ケネディクス	183	19,890	3,639,870
電通	682	183,000	124,806,000
シンプレクス・テクノロジー	133	32,600	4,335,800
ADEKA	29,900	616	18,418,400
日油	61,000	315	19,215,000
ミヨシ油脂	36,000	140	5,040,000
ハリマ化成	10,000	411	4,110,000
花 王	176,000	2,705	476,080,000
三洋化成	23,000	506	11,638,000
武田薬品	249,400	4,460	1,112,324,000
アステラス製薬	154,100	3,410	525,481,000
大日本住友製薬	49,000	804	39,396,000
塩野義製薬	100,000	2,090	209,000,000
田辺三菱製薬	72,000	1,232	88,704,000
わかもと製薬	12,000	348	4,176,000
あすか製薬	9,000	789	7,101,000
日本新薬	17,000	1,017	17,289,000
中外製薬	91,100	1,604	146,124,400
科研製薬	29,000	933	27,057,000
エーザイ	84,600	3,530	298,638,000
ロート製薬	31,000	1,141	35,371,000
小野薬品	34,100	4,580	156,178,000
久光製薬	21,200	3,460	73,352,000
持田製薬	28,000	1,098	30,744,000
大正製薬	64,000	1,827	116,928,000
参天製薬	22,300	2,575	57,422,500
エスエス製薬	18,000	597	10,746,000
扶桑薬品	26,000	286	7,436,000
日本ケミファ	14,000	283	3,962,000
ツムラ	19,900	3,230	64,277,000
テ ル モ	47,300	4,110	194,403,000
みらかホールディングス	13,700	1,753	24,016,100
キッセイ薬品工業	14,000	2,515	35,210,000
生化学工業	13,700	984	13,480,800
栄研化学	6,900	690	4,761,000
鳥居薬品	4,900	1,381	6,766,900
東和薬品	2,800	3,850	10,780,000
沢井製薬	4,600	4,180	19,228,000
ゼリア新薬工業	11,000	1,002	11,022,000
第一三共	202,200	1,912	386,606,400
キョーリン	18,000	1,062	19,116,000
大日本塗料	49,000	90	4,410,000
日本ペイント	76,000	338	25,688,000
関西ペイント	77,000	441	33,957,000
中国塗料	20,000	477	9,540,000
日本特殊塗料	10,000	364	3,640,000
藤倉化成	9,400	453	4,258,200
太陽インキ製造	5,900	1,578	9,310,200
D I C	225,000	168	37,800,000
サカタインクス	17,000	329	5,593,000
東洋インキ	69,000	252	17,388,000
オリエンタルランド	19,300	7,430	143,399,000
ダスキン	21,000	1,543	32,403,000
パーク 2 4	39,800	575	22,885,000
フジ・メディア・HD	670	120,600	80,802,000

秀英予備校	7,300	339	2,474,700
ラウンドワン	110	61,000	6,710,000
リゾートトラスト	12,500	1,013	12,662,500
オービック	2,020	15,300	30,906,000
ヤフー	4,835	34,750	168,016,250
ビー・エム・エル	4,200	1,960	8,232,000
ワタベウェディング	4,200	1,178	4,947,600
トレンドマイクロ	31,500	2,980	93,870,000
もしもしホットライン	5,850	2,010	11,758,500
東急コミュニティー	2,800	1,682	4,709,600
リソー教育	1,328	3,830	5,086,240
日本オラクル	10,100	3,940	39,794,000
アルファシステムズ	2,200	2,265	4,983,000
フューチャーアーキテクト	99	36,100	3,573,900
シーエーシー	5,800	823	4,773,400
ユー・エス・エス	9,370	4,860	45,538,200
オービックビジネスC	2,150	3,880	8,342,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,000	2,175	17,400,000
東京個別指導学院	18,600	115	2,139,000
カルチュア・コンビニエンス	31,200	900	28,080,000
大塚商会	5,100	4,420	22,542,000
総合メディカル	2,100	3,000	6,300,000
セントラルスポーツ	4,000	789	3,156,000
電通国際情報S	7,000	600	4,200,000
富士フイルムHLDGS	167,900	1,908	320,353,200
コニカミノルタHLDGS	173,500	665	115,377,500
資 生 堂	117,000	1,850	216,450,000
ライオン	79,000	514	40,606,000
高砂香料	25,000	641	16,025,000
マンダム	7,300	2,525	18,432,500
ミルボン	3,300	2,485	8,200,500
ファンケル	13,400	1,166	15,624,400
コーセー	11,000	2,295	25,245,000
ドクターシーラボ	53	161,800	8,575,400
エスター	5,300	1,152	6,105,600
コ ニ シ	6,900	835	5,761,500
長谷川香料	8,400	1,182	9,928,800
小林製薬	9,400	3,520	33,088,000
荒川化学工業	6,900	974	6,720,600
日本高純度化学	23	196,300	4,514,900
アース製薬	5,600	2,685	15,036,000
イハラケミカル	17,000	260	4,420,000
大成ラミック	3,600	1,998	7,192,800
クミアイ化学	21,000	264	5,544,000
日本農薬	15,000	560	8,400,000
新日本石油	479,000	417	199,743,000
昭和シェル石油	54,800	853	46,744,400
コスモ石油	189,000	271	51,219,000
東燃ゼネラル石油	102,000	899	91,698,000
新日鉱ホールディングス	284,500	385	109,532,500
AOCホールディングス	16,400	448	7,347,200
出光興産	8,100	6,130	49,653,000
横浜ゴム	86,000	451	38,786,000
東洋ゴム	72,000	157	11,304,000
ブリヂストン	215,800	1,376	296,940,800

住友ゴム	58,900	800	47,120,000
オカモト	33,000	329	10,857,000
アキレス	69,000	123	8,487,000
ニッタ	6,800	1,131	7,690,800
東海ゴム	13,500	689	9,301,500
三ツ星ベルト	23,000	469	10,787,000
バンドー化学	31,000	219	6,789,000
鬼怒川ゴム	27,000	110	2,970,000
旭硝子	338,000	458	154,804,000
日本板硝子	219,000	300	65,700,000
有沢製作所	10,600	343	3,635,800
日本山村硝子	39,000	184	7,176,000
日本電気硝子	111,000	460	51,060,000
オハラ	4,100	973	3,989,300
住友大阪セメント	133,000	208	27,664,000
太平洋セメント	275,000	161	44,275,000
東海カーボン	60,000	335	20,100,000
日本カーボン	34,000	227	7,718,000
東洋炭素	3,000	3,020	9,060,000
ノリタケ	40,000	343	13,720,000
TOTO	107,000	574	61,418,000
日本碍子	83,000	901	74,783,000
日本特殊陶業	61,000	677	41,297,000
MARUWA	3,500	984	3,444,000
品川白煉瓦	27,000	183	4,941,000
黒崎播磨	24,000	261	6,264,000
フジミインコーポレーテッド	7,700	1,031	7,938,700
ニチアス	34,000	226	7,684,000
新日本製鐵	1,804,000	292	526,768,000
住友金属工業	1,174,000	223	261,802,000
神戸製鋼所	954,000	157	149,778,000
日新製鋼	261,000	162	42,282,000
中山製鋼所	38,000	229	8,702,000
合同製鐵	42,000	255	10,710,000
JFEホールディングス	175,300	2,600	455,780,000
東京製鐵	33,900	855	28,984,500
共英製鋼	6,100	1,699	10,363,900
大和工業	16,000	2,445	39,120,000
東京鐵鋼	16,000	212	3,392,000
大阪製鐵	5,600	1,246	6,977,600
淀川製鋼所	53,000	382	20,246,000
東洋鋼鋳	14,000	385	5,390,000
丸一鋼管	19,100	2,625	50,137,500
モリ工業	21,000	214	4,494,000
大同特殊鋼	105,000	268	28,140,000
日本高周波	31,000	87	2,697,000
日本金属工業	49,000	122	5,978,000
日本冶金工	37,000	267	9,879,000
山陽特殊鋼	34,000	259	8,806,000
愛知製鋼	38,000	308	11,704,000
日立金属	47,000	410	19,270,000
日本金属	23,000	122	2,806,000
大平洋金属	48,000	459	22,032,000
日本電工	27,000	515	13,905,000
栗本鉄工所	34,000	54	1,836,000

日本製鋼所	98,000	1,093	107,114,000
三菱製鋼	42,000	226	9,492,000
日本軽金属	157,000	80	12,560,000
三井金属	202,000	185	37,370,000
東邦亜鉛	38,000	220	8,360,000
三菱マテリアル	418,000	216	90,288,000
住友鉱山	178,000	939	167,142,000
DOWAホールディングス	88,000	301	26,488,000
古河機金	120,000	94	11,280,000
大阪チタニウム	6,700	2,320	15,544,000
東邦チタニウム	11,300	926	10,463,800
住友軽金属	107,000	80	8,560,000
古河スカイ	34,000	189	6,426,000
古河電工	216,000	421	90,936,000
住友電工	227,000	685	155,495,000
フジクラ	104,000	273	28,392,000
三菱電線工業	45,000	79	3,555,000
昭和電線HLDGS	84,000	58	4,872,000
タツタ電線	22,000	228	5,016,000
日立電線	54,000	194	10,476,000
リョービ	45,000	179	8,055,000
アサヒブリテック	9,700	1,125	10,912,500
東洋製罐	53,200	1,531	81,449,200
横河ブリッジHLDGS	14,000	783	10,962,000
三和ホールディングス	70,000	323	22,610,000
文化シャッター	21,000	365	7,665,000
川田工業	29,000	101	2,929,000
住生活グループ	81,900	1,377	112,776,300
日本ファイルコン	7,900	476	3,760,400
ノーリツ	12,200	1,171	14,286,200
長府製作所	7,700	2,080	16,016,000
リンナイ	13,300	3,510	46,683,000
ユニプレス	10,500	573	6,016,500
日東精工	13,000	274	3,562,000
三洋工業	27,000	147	3,969,000
岡 部	16,400	393	6,445,200
日立ツール	5,700	664	3,784,800
東 プ レ	14,900	700	10,430,000
高周波熱錬	11,200	592	6,630,400
東京製綱	50,000	229	11,450,000
日本発条	45,000	287	12,915,000
三浦工業	10,700	2,100	22,470,000
タ ク マ	30,000	144	4,320,000
ツ ガ ミ	29,000	159	4,611,000
オークマ	42,000	322	13,524,000
東芝機械	38,000	253	9,614,000
ア マ ダ	106,000	403	42,718,000
アイダエンジニア	22,000	325	7,150,000
牧野フライス	34,000	225	7,650,000
オーエスジー	29,100	708	20,602,800
旭ダイヤモンド	19,000	563	10,697,000
森精機製作所	29,600	696	20,601,600
ディスコ	6,100	1,728	10,540,800
日東工器	5,100	1,550	7,905,000
豊田自動織機	53,500	1,836	98,226,000

大阪機工	33,000	99	3,267,000
オーエム製作所	8,000	302	2,416,000
津田駒工業	21,000	94	1,974,000
島精機製作所	8,500	1,740	14,790,000
日阪製作所	8,000	1,165	9,320,000
やまびこ	2,583	727	1,877,841
ナブテスコ	29,000	545	15,805,000
三井海洋開発	4,500	1,525	6,862,500
SMC	20,400	8,390	171,156,000
新川	6,700	1,034	6,927,800
ホソカワミクロン	12,000	334	4,008,000
ユニオンツール	4,200	1,917	8,051,400
オイレス工業	8,500	1,315	11,177,500
サトー	7,800	984	7,675,200
日精樹脂工業	9,600	252	2,419,200
小松製作所	305,200	1,123	342,739,600
住友重機械	180,000	338	60,840,000
日立建機	34,900	1,091	38,075,900
井関農機	68,000	223	15,164,000
TOWA	7,600	154	1,170,400
丸山製作所	21,000	141	2,961,000
北川鉄工所	44,000	111	4,884,000
クボタ	314,000	580	182,120,000
東洋エンジニア	42,000	259	10,878,000
三菱化工機	25,000	205	5,125,000
月島機械	11,000	553	6,083,000
帝国電機製作所	3,400	972	3,304,800
東京機械	29,000	165	4,785,000
新東工業	15,100	592	8,939,200
アイチ コーポレーション	13,400	327	4,381,800
小森コーポレーション	20,100	1,030	20,703,000
住友精密	16,000	335	5,360,000
酒井重工業	22,000	154	3,388,000
荏原製作所	149,000	190	28,310,000
西島製作所	6,400	802	5,132,800
千代田化工建	58,000	469	27,202,000
ダイキン工業	71,700	2,070	148,419,000
オルガノ	12,000	527	6,324,000
トーヨーカネツ	50,000	160	8,000,000
栗田工業	37,600	2,370	89,112,000
椿本チエイン	37,000	251	9,287,000
T C M	27,000	129	3,483,000
日 機 装	20,000	481	9,620,000
木村化工機	6,500	668	4,342,000
新興プランテック	12,100	853	10,321,300
アネスト岩田	18,000	295	5,310,000
ダイフク	28,000	522	14,616,000
加藤製作所	20,000	233	4,660,000
油研工業	21,000	175	3,675,000
タダノ	32,000	452	14,464,000
フジテック	27,000	298	8,046,000
シーケーディ	21,500	286	6,149,000
平和	17,000	893	15,181,000
SANKYO	17,700	4,490	79,473,000
日本金銭機械	8,300	824	6,839,200

マースエンジニアリング	4,100	2,970	12,177,000
キヤノンファインテック	7,100	893	6,340,300
ダイコク電機	3,300	1,188	3,920,400
ア マ ノ	20,600	741	15,264,600
J U K I	37,000	86	3,182,000
サンデン	40,000	211	8,440,000
蛇の目ミシン	74,000	38	2,812,000
ブラザー工業	79,100	600	47,460,000
マックス	12,000	970	11,640,000
グローリー	20,800	1,774	36,899,200
大和冷機工業	14,000	322	4,508,000
セガサミーホールディングス	74,300	1,028	76,380,400
日本ピストンリング	44,000	87	3,828,000
リ ケ ン	34,000	210	7,140,000
帝国ピストン	9,800	423	4,145,400
大豊工業	6,800	409	2,781,200
日本精工	136,000	327	44,472,000
N T N	117,000	253	29,601,000
ジェイテクト	66,400	621	41,234,400
不 二 越	69,000	163	11,247,000
ミネベア	99,000	290	28,710,000
日本トムソン	22,000	350	7,700,000
T H K	40,700	920	37,444,000
ユーシン精機	3,700	768	2,841,600
イーグル工業	10,000	306	3,060,000
キッツ	33,000	271	8,943,000
日 立	1,099,000	384	422,016,000
東 芝	990,000	322	318,780,000
三菱電機	613,000	518	317,534,000
富士電機H L D G S	154,000	130	20,020,000
東洋電機製造	15,000	239	3,585,000
安川電機	72,000	333	23,976,000
神鋼電機	44,000	275	12,100,000
明 電 舎	63,000	258	16,254,000
オリジン電気	13,000	213	2,769,000
日立工機	23,100	694	16,031,400
三桜工業	11,300	378	4,271,400
マキタ	40,900	1,908	78,037,200
東芝テック	48,000	266	12,768,000
芝浦メカトロニクス	13,000	359	4,667,000
マブチモーター	10,200	3,810	38,862,000
日本電産	32,300	3,480	112,404,000
高岳製作所	38,000	159	6,042,000
ダイヘン	34,000	306	10,404,000
J V C ケンウッド H D	224,300	33	7,401,900
日新電機	18,000	415	7,470,000
大崎電気	11,000	516	5,676,000
オムロン	77,600	1,170	90,792,000
日東工業	10,500	771	8,095,500
I D E C	10,500	905	9,502,500
エルピーダメモリ	28,400	430	12,212,000
ジーエス・ユアサ コーポ	105,000	437	45,885,000
サクサホールディングス	28,000	113	3,164,000
メルコホールディングス	3,900	959	3,740,100
日本電気	661,000	254	167,894,000

富士通	675,000	447	301,725,000
沖電気	210,000	57	11,970,000
岩崎通信機	37,000	104	3,848,000
電気興業	19,000	557	10,583,000
サンケン電気	39,000	340	13,260,000
エプソントヨコム	25,000	166	4,150,000
アイホン	5,600	1,618	9,060,800
NECエレクトロニクス	12,300	797	9,803,100
セイコーエプソン	47,800	1,323	63,239,400
ワコム	128	88,000	11,264,000
アルバック	10,500	1,057	11,098,500
ナナオ	5,900	1,502	8,861,800
日本信号	18,200	577	10,501,400
京三製作所	20,000	323	6,460,000
能美防災	10,000	1,083	10,830,000
ホーチキ	10,000	683	6,830,000
マスプロ電工	8,000	876	7,008,000
日本無線	31,000	123	3,813,000
パナソニック	701,000	1,021	715,721,000
シャープ	317,000	586	185,762,000
アンリツ	35,000	226	7,910,000
富士通ゼネラル	20,000	158	3,160,000
日立国際電気	19,000	506	9,614,000
ソニー	348,600	1,815	632,709,000
NECトーキン	21,000	291	6,111,000
T D K	34,200	3,050	104,310,000
帝国通信工業	23,000	186	4,278,000
三洋電機	648,000	141	91,368,000
ミツミ電機	23,300	1,318	30,709,400
タムラ製作所	23,000	157	3,611,000
アルプス電気	56,400	406	22,898,400
池上通信機	26,000	79	2,054,000
パイオニア	52,800	152	8,025,600
日本電波工業	5,100	998	5,089,800
日本トリム	1,700	2,155	3,663,500
ローランド ディー. ジー.	2,700	1,115	3,010,500
フオスター電機	6,400	677	4,332,800
クラリオン	46,000	64	2,944,000
S M K	21,000	258	5,418,000
ヨコオ	8,900	423	3,764,700
東光	37,000	102	3,774,000
ホシデン	16,100	1,265	20,366,500
ヒロセ電機	11,300	9,020	101,926,000
日本航空電子	15,000	357	5,355,000
日立マクセル	14,500	821	11,904,500
ユニデン	21,000	152	3,192,000
アルパイン	14,800	628	9,294,400
スミダコーポレーション	5,500	453	2,491,500
アイコム	4,000	1,829	7,316,000
船井電機	6,000	1,371	8,226,000
横河電機	71,600	575	41,170,000
新電元工業	27,000	148	3,996,000
山武	17,900	2,125	38,037,500
日本光電工業	13,100	1,988	26,042,800
チノール	19,000	207	3,933,000

堀場製作所	9,500	1,224	11,628,000
アドバンテスト	44,500	1,361	60,564,500
小野測器	11,000	391	4,301,000
エスベック	7,400	582	4,306,800
サンクス	8,400	294	2,469,600
キーエンス	12,200	17,270	210,694,000
日置電機	3,500	1,705	5,967,500
シスメックス	12,500	3,280	41,000,000
メガチップス	6,100	1,596	9,735,600
O B A R A	4,900	558	2,734,200
ミヤチテクノス	4,700	465	2,185,500
東京電波	3,200	480	1,536,000
デンソー	144,200	1,437	207,215,400
コーセル	9,500	725	6,887,500
日立メディコ	7,000	905	6,335,000
新日本無線	11,000	171	1,881,000
オプテックス	5,400	789	4,260,600
千代田インテグレ	4,600	1,094	5,032,400
スタンレー電気	45,800	999	45,754,200
岩崎電気	33,000	121	3,993,000
ウシオ電機	36,700	1,142	41,911,400
日本セラミック	5,600	857	4,799,200
新神戸電機	8,000	816	6,528,000
日本デジタル研究所	7,200	933	6,717,600
双信電機	5,600	298	1,668,800
山一電機	6,600	218	1,438,800
図 研	6,600	598	3,946,800
日本電子	26,000	259	6,734,000
カ シ オ	63,200	545	34,444,000
ファナック	63,500	6,340	402,590,000
F D K	32,000	109	3,488,000
日本シイエムケイ	13,300	277	3,684,100
エンプラス	6,000	968	5,808,000
ロ ー ム	33,600	3,980	133,728,000
浜松ホトニクス	23,800	1,627	38,722,600
三井ハイテック	10,600	450	4,770,000
新光電気工業	18,700	691	12,921,700
京 セ ラ	58,400	6,190	361,496,000
太陽誘電	32,000	455	14,560,000
村田製作所	73,100	3,040	222,224,000
ユーシン	9,400	310	2,914,000
双葉電子工業	11,900	1,118	13,304,200
日東電工	59,900	1,548	92,725,200
北陸電気工業	34,000	170	5,780,000
パナソニック電工	110,000	815	89,650,000
東海理化電機	17,300	724	12,525,200
ニチコン	21,600	524	11,318,400
日本ケミコン	34,000	189	6,426,000
K O A	10,700	524	5,606,800
三井造船	238,000	140	33,320,000
日立造船	278,000	78	21,684,000
佐世保重工業	40,000	186	7,440,000
三菱重工業	1,169,000	383	447,727,000
川崎重工業	544,000	183	99,552,000
I H I	457,000	107	48,899,000

日本車輛	49,000	259	12,691,000	
近畿車輛	14,000	452	6,328,000	
日産自動車	829,100	304	252,046,400	
いすゞ自動車	315,000	109	34,335,000	
トヨタ自動車	845,000	2,960	2,501,200,000	※
日野自動車	97,000	179	17,363,000	
三菱自動車工業	1,471,000	120	176,520,000	
武蔵精密工業	6,600	777	5,128,200	
トヨタ車体	14,600	1,334	19,476,400	
日産車体	24,000	535	12,840,000	
関東自動車	11,400	1,190	13,566,000	
新明和工業	34,000	235	7,990,000	
極東開発工業	15,600	309	4,820,400	
日信工業	12,300	610	7,503,000	
トピー工業	61,000	165	10,065,000	
ティラド	25,000	136	3,400,000	
曙ブレーキ	19,100	533	10,180,300	
タチエス	9,400	424	3,985,600	
N O K	35,000	620	21,700,000	
フタバ産業	14,400	181	2,606,400	
カヤバ工業	51,000	167	8,517,000	
市光工業	25,000	123	3,075,000	
大同メタル工業	16,000	256	4,096,000	
プレス工業	27,000	110	2,970,000	
カルソニックカンセイ	41,000	128	5,248,000	
太平洋工業	18,000	248	4,464,000	
ケーヒン	15,300	635	9,715,500	
アイシン精機	59,700	1,149	68,595,300	
マ ツ ダ	261,000	146	38,106,000	
ダイハツ	69,000	815	56,235,000	
愛知機械	21,000	171	3,591,000	
今仙電機製作所	6,200	545	3,379,000	
本田技研	561,900	1,825	1,025,467,500	
スズキ	133,000	1,154	153,482,000	
富士重工業	225,000	232	52,200,000	
ヤマハ発動機	75,400	900	67,860,000	
ショーワ	15,600	304	4,742,400	
小糸製作所	33,000	538	17,754,000	
エクセディ	8,100	884	7,160,400	
ミツバ	14,000	293	4,102,000	
豊田合成	18,500	984	18,204,000	
愛三工業	9,400	434	4,079,600	
ヨ ロ ズ	5,800	734	4,257,200	
エフ・シー・シー	10,000	732	7,320,000	
シマノ	25,400	3,590	91,186,000	
タカタ	11,800	613	7,233,400	
テイ・エス テック	10,700	525	5,617,500	
小 野 建	6,100	897	5,471,700	
はるやま商事	5,400	389	2,100,600	
佐島電機	7,500	473	3,547,500	
カッパクリエイト	4,700	2,075	9,752,500	
伯東	5,500	705	3,877,500	
ライトオン	5,600	1,736	9,721,600	
ナガイレーベン	4,700	1,821	8,558,700	
ジーンズメイト	5,400	508	2,743,200	

菱食	6,500	2,230	14,495,000
良品計画	6,800	4,550	30,940,000
三城	10,100	859	8,675,900
松田産業	5,000	875	4,375,000
メディセオ・パルタックHD	69,200	1,009	69,822,800
アドヴァン	11,200	364	4,076,800
アズワン	4,900	1,834	8,986,600
シモジマ	5,900	1,363	8,041,700
ドウシシャ	5,000	1,119	5,595,000
コナカ	10,900	280	3,052,000
コジマ	12,200	255	3,111,000
コーナン商事	7,800	1,185	9,243,000
黒田電気	10,000	801	8,010,000
ネットワンシステムズ	156	181,400	28,298,400
ワタミ	8,900	2,440	21,716,000
ドン・キホーテ	14,800	1,814	26,847,200
丸文	7,400	379	2,804,600
メガネトップ	6,100	1,011	6,167,100
西松屋チェーン	17,200	850	14,620,000
ゼンショー	22,100	478	10,563,800
ハピネット	3,300	1,518	5,009,400
幸楽苑	7,000	1,124	7,868,000
トーメンエレクトロニクス	2,900	940	2,726,000
ユニマットライフ	5,000	805	4,025,000
サイゼリヤ	7,400	1,325	9,805,000
エクセル	4,500	751	3,379,500
ガリバーインターナショナル	1,910	1,491	2,847,810
日本エム・ディ・エム	13,600	159	2,162,400
ユナイテッドアローズ	9,500	681	6,469,500
シークス	6,700	283	1,896,100
京都きもの友禅	74	57,800	4,277,200
コロワイド	17,000	530	9,010,000
壺番屋	3,600	2,090	7,524,000
マクニカ	3,500	1,278	4,473,000
スギホールディングス	10,500	2,460	25,830,000
島津製作所	72,000	559	40,248,000
アロカ	5,000	697	3,485,000
モリテックス	5,500	392	2,156,000
長野計器	4,700	884	4,154,800
スター精密	13,100	935	12,248,500
東京計器	27,000	108	2,916,000
東京精密	12,400	823	10,205,200
ニコン	114,000	998	113,772,000
トプコン	15,400	397	6,113,800
オリンパス	72,000	1,826	131,472,000
大日本スクリーン	71,000	158	11,218,000
キャノン電子	6,300	1,236	7,786,800
タムロン	6,000	858	5,148,000
HOYA	150,300	1,433	215,379,900
ノーリツ銅機	6,900	615	4,243,500
エー・アンド・デイ	7,000	276	1,932,000
キャノン	381,200	2,695	1,027,334,000
リコー	213,000	1,008	214,704,000
日本電産コパル	7,000	691	4,837,000
日本電産サンキョー	22,000	355	7,810,000

シチズンホールディングス	91,800	324	29,743,200
リズム時計	48,000	81	3,888,000
バンダイナムコHLDGS	70,900	926	65,653,400
フランスベッドHLDGS	51,000	138	7,038,000
パイロットコーポレーション	64	139,600	8,934,400
エイベックス・グループHD	12,600	975	12,285,000
トッパン・フォームズ	14,100	1,155	16,285,500
フジシールインターナショナル	7,300	1,445	10,548,500
タカラトミー	21,300	570	12,141,000
廣済堂	9,800	258	2,528,400
アーク	21,400	134	2,867,600
スルガ	3,900	960	3,744,000
タカノ	5,500	477	2,623,500
プロネクス	10,900	765	8,338,500
ウッドワン	16,000	328	5,248,000
大建工業	37,000	193	7,141,000
き も と	7,700	248	1,909,600
凸版印刷	200,000	664	132,800,000
大日本印刷	200,000	951	190,200,000
共同印刷	29,000	215	6,235,000
日本写真印刷	10,700	3,980	42,586,000
光村印刷	14,000	330	4,620,000
藤森工業	5,600	646	3,617,600
宝印刷	6,500	788	5,122,000
前澤化成工業	6,300	811	5,109,300
アシックス	65,000	753	48,945,000
ツ ツ ミ	3,300	1,740	5,742,000
ニ チ ハ	9,300	461	4,287,300
ローランド	5,500	1,187	6,528,500
エフピコ	3,400	4,170	14,178,000
ヤマハ	52,900	851	45,017,900
河合楽器	45,000	80	3,600,000
クリナップ	8,900	377	3,355,300
ピジョン	4,200	2,690	11,298,000
天馬	6,800	1,430	9,724,000
パラマウントベッド	7,500	1,191	8,932,500
兼松日産農林	34,000	65	2,210,000
リンテック	12,500	1,093	13,662,500
信越ポリマー	14,700	400	5,880,000
東 リ	29,000	186	5,394,000
イトーキ	17,200	295	5,074,000
任 天 堂	34,700	34,550	1,198,885,000
三菱鉛筆	6,800	1,016	6,908,800
タカラスタANDARD	32,000	559	17,888,000
コ ク ヨ	34,700	636	22,069,200
ナカバヤシ	25,000	181	4,525,000
ニ フ コ	14,400	903	13,003,200
ダイワ精工	45,000	126	5,670,000
岡村製作所	29,000	506	14,674,000
日本バルカー	35,000	228	7,980,000
MUTOHホールディングス	11,000	221	2,431,000
伊 藤 忠	483,000	429	207,207,000
丸 紅	565,000	324	183,060,000
高 島	23,000	117	2,691,000
三陽商会	34,000	361	12,274,000

長瀬産業	34,000	802	27,268,000
豊田通商	65,000	925	60,125,000
オンワードホールディングス	46,000	700	32,200,000
三共生興	21,800	147	3,204,600
兼 松	131,000	86	11,266,000
美 津 濃	34,000	407	13,838,000
フアミリーマート	19,800	4,040	79,992,000
ルック	22,000	74	1,628,000
三井物産	557,000	840	467,880,000
日本紙パルプ	36,000	290	10,440,000
東京エレクトロン	47,700	2,880	137,376,000
日立ハイテクノロジーズ	22,300	1,459	32,535,700
東都水産	21,000	120	2,520,000
セイコーHD	27,000	190	5,130,000
山 善	27,400	322	8,822,800
住友商事	381,900	771	294,444,900
日本ユニシス	15,600	800	12,480,000
内田洋行	18,000	322	5,796,000
三菱商事	483,600	1,206	583,221,600
第一実業	21,000	269	5,649,000
キャノンマーケティングJPN	24,700	1,388	34,283,600
西華産業	33,000	218	7,194,000
菱洋エレクトロ	7,400	718	5,313,200
ユアサ商事	86,000	85	7,310,000
神鋼商事	25,000	166	4,150,000
阪和興業	64,000	284	18,176,000
菱電商事	14,000	503	7,042,000
ニプロ	16,000	1,544	24,704,000
岩谷産業	76,000	196	14,896,000
すてきナイスグループ	33,000	144	4,752,000
昭光通商	54,000	111	5,994,000
ニチモウ	28,000	129	3,612,000
富士通ビジネス	5,200	1,246	6,479,200
兼松エレクトロニクス	6,300	768	4,838,400
三愛石油	20,000	395	7,900,000
稲畑産業	20,100	285	5,728,500
G S I クレオス	32,000	98	3,136,000
明和産業	16,500	124	2,046,000
東京スタイル	26,000	632	16,432,000
ユニ・チャーム	13,800	6,720	92,736,000
デサント	22,000	427	9,394,000
東邦薬品	14,500	1,157	16,776,500
サンゲツ	11,200	2,035	22,792,000
ミツウロコ	13,600	588	7,996,800
シナネン	21,000	407	8,547,000
伊藤忠エネクス	18,600	573	10,657,800
ザ・トーカイ	19,000	429	8,151,000
サンリオ	18,600	821	15,270,600
リョーサン	10,500	2,000	21,000,000
新光商事	7,600	751	5,707,600
三信電気	8,700	786	6,838,200
東陽テクニカ	7,700	1,256	9,671,200
モスフード サービス	10,400	1,268	13,187,200
加賀電子	8,600	1,030	8,858,000
三益半導体	5,900	723	4,265,700

木曾路	8,300	1,828	15,172,400
千 趣 会	12,400	700	8,680,000
ケーヨー	15,600	627	9,781,200
アデランスホールディングス	8,300	923	7,660,900
上新電機	16,000	759	12,144,000
日本瓦斯	7,900	1,331	10,514,900
ベスト電器	22,000	276	6,072,000
マルエツ	14,000	516	7,224,000
ロイヤルホールディングス	12,000	1,045	12,540,000
いなげや	10,000	901	9,010,000
島 忠	15,700	2,200	34,540,000
チヨダ	9,600	1,462	14,035,200
ライフコーポレーション	4,900	1,783	8,736,700
カ ス ミ	17,000	501	8,517,000
リンガーハット	6,500	1,169	7,598,500
AOKIホールディングス	7,300	910	6,643,000
オークワ	10,000	1,298	12,980,000
コメリ	8,800	2,295	20,196,000
青山商事	16,400	1,283	21,041,200
しまむら	6,600	7,620	50,292,000
CFSコーポレーション	11,500	629	7,233,500
高 島 屋	89,000	703	62,567,000
丸 善	43,000	65	2,795,000
松 屋	13,400	1,906	25,540,400
エイチ・ツー・オーリテイリング	47,000	672	31,584,000
丸 栄	19,000	198	3,762,000
ニッセンHD	18,000	408	7,344,000
パ ル コ	19,500	801	15,619,500
丸井グループ	89,300	517	46,168,100
クレディセゾン	55,700	1,382	76,977,400
オーエムシーカード	24,800	171	4,240,800
ダイエー	30,000	475	14,250,000
イズミヤ	23,000	589	13,547,000
イオン	261,700	874	228,725,800
ユ ニ ー	50,000	932	46,600,000
イ ズ ミ	18,800	1,366	25,680,800
平 和 堂	14,100	1,400	19,740,000
フ ジ	8,400	1,747	14,674,800
ヤオコー	4,200	2,790	11,718,000
ゼビオ	6,900	1,918	13,234,200
ケースホールディングス	11,300	1,547	17,481,100
新生銀行	387,000	156	60,372,000
あおぞら銀行	250,000	91	22,750,000
三菱UFJフィナンシャルG	3,776,100	542	2,046,646,200
りそなホールディングス	2,093	148,000	309,764,000
中央三井トラストHD	333,000	421	140,193,000
三井住友フィナンシャルG	2,738	384,000	1,051,392,000
第四銀行	91,000	389	35,399,000
北越銀行	80,000	199	15,920,000
西日本シティ銀行	209,000	227	47,443,000
札幌北洋ホール	97	364,000	35,308,000
千葉銀行	256,000	515	131,840,000
横浜銀行	447,000	529	236,463,000
常陽銀行	249,000	496	123,504,000
群馬銀行	150,000	555	83,250,000

武蔵野銀行	9,900	3,300	32,670,000
千葉興業銀行	13,200	1,196	15,787,200
関東つくば銀行	19,700	324	6,382,800
東京都民銀行	12,300	1,397	17,183,100
七十七銀行	108,000	462	49,896,000
青森銀行	43,000	396	17,028,000
秋田銀行	47,000	388	18,236,000
山形銀行	41,000	596	24,436,000
岩手銀行	4,500	5,450	24,525,000
東邦銀行	53,000	376	19,928,000
みちのく銀行	39,000	207	8,073,000
ふくおかフィナンシャルG	282,000	355	100,110,000
静岡銀行	203,000	1,036	210,308,000
十六銀行	84,000	408	34,272,000
スルガ銀行	75,000	895	67,125,000
八十二銀行	121,000	493	59,653,000
山梨中央銀行	44,000	523	23,012,000
大垣共立銀行	75,000	415	31,125,000
福井銀行	58,000	325	18,850,000
北國銀行	75,000	334	25,050,000
清水銀行	2,700	4,030	10,881,000
滋賀銀行	61,000	571	34,831,000
南都銀行	64,000	514	32,896,000
百五銀行	64,000	540	34,560,000
京都銀行	110,000	938	103,180,000
三重銀行	33,000	369	12,177,000
池田銀行	6,000	4,080	24,480,000
ほくほくフィナンシャルG	450,000	206	92,700,000
広島銀行	189,000	374	70,686,000
山陰合同銀行	40,000	708	28,320,000
中国銀行	53,000	1,377	72,981,000
鳥取銀行	33,000	288	9,504,000
伊予銀行	73,000	1,075	78,475,000
百十四銀行	76,000	508	38,608,000
四国銀行	48,000	452	21,696,000
阿波銀行	59,000	620	36,580,000
鹿児島銀行	46,000	703	32,338,000
大分銀行	36,000	565	20,340,000
宮崎銀行	36,000	329	11,844,000
肥後銀行	52,000	545	28,340,000
佐賀銀行	45,000	325	14,625,000
十八銀行	44,000	321	14,124,000
沖縄銀行	5,600	3,430	19,208,000
琉球銀行	15,100	891	13,454,100
住友信託	616,000	495	304,920,000
みずほ信託銀行	635,000	110	69,850,000
八千代銀行	40	304,000	12,160,000
みずほフィナンシャルG	3,646	256,800	936,292,800
紀陽ホールディングス	258,000	129	33,282,000
山口フィナンシャルG	60,000	973	58,380,000
芙蓉総合リース	6,900	1,724	11,895,600
興銀リース	9,700	1,489	14,443,300
センチュリーリーシングシステム	10,600	810	8,586,000
S B I ホールディングス	5,110	13,500	68,985,000
日本証券金融	26,400	421	11,114,400

大阪証券金融	15,000	200	3,000,000
アイフル	33,350	280	9,338,000
ポケットカード	11,200	254	2,844,800
長野銀行	30,000	246	7,380,000
名古屋銀行	63,000	525	33,075,000
愛知銀行	2,500	7,180	17,950,000
第三銀行	44,000	290	12,760,000
中京銀行	34,000	324	11,016,000
東日本銀行	35,000	253	8,855,000
愛媛銀行	45,000	299	13,455,000
みなと銀行	71,000	120	8,520,000
京葉銀行	58,000	468	27,144,000
関西アーバン銀行	68,000	145	9,860,000
栃木銀行	37,000	531	19,647,000
北日本銀行	3,200	2,895	9,264,000
香川銀行	26,000	520	13,520,000
東和銀行	60,000	69	4,140,000
徳島銀行	21,000	434	9,114,000
武富士	40,850	737	30,106,450
リコーリース	5,000	1,449	7,245,000
イオン クレジットサービス	28,800	1,038	29,894,400
ア コ ム	29,210	3,670	107,200,700
プロミス	30,150	2,165	65,274,750
東京リース	9,300	579	5,384,700
ジャックス	40,000	172	6,880,000
日立キャピタル	15,500	1,062	16,461,000
セントラルファイナンス	30,000	147	4,410,000
オリックス	31,910	5,360	171,037,600
三菱UFJリース	16,620	2,375	39,472,500
ジャフコ	9,900	2,425	24,007,500
S F C G	1,400	3,190	4,466,000
大和証券G本社	428,000	473	202,444,000
野村ホールディングス	680,300	665	452,399,500
新光証券	165,000	183	30,195,000
みずほインベスタズ証	132,000	73	9,636,000
岡三証券グループ	55,000	348	19,140,000
丸三証券	22,900	429	9,824,100
東洋証券	30,000	174	5,220,000
東海東京証券	75,000	227	17,025,000
光世証券	33,000	76	2,508,000
水戸証券	25,000	279	6,975,000
いちよし証券	16,000	727	11,632,000
松井証券	49,900	721	35,977,900
マネックスG	331	29,600	9,797,600
カブドットコム証券	165	115,700	19,090,500
岩井証券	8,100	688	5,572,800
三井住友海上HD	154,700	2,440	377,468,000
SONY FH	236	318,000	75,048,000
日本興亜損害保険	249,000	597	148,653,000
損害保険ジャパン	302,000	532	160,664,000
ニッセイ同和損害保険	72,000	474	34,128,000
あいおい損害保険	167,000	393	65,631,000
富士火災	70,000	133	9,310,000
東京海上HD	278,900	2,610	727,929,000
T & Dホールディングス	85,400	3,300	281,820,000

三井不動産	288,000	1,400	403,200,000
三菱地所	452,000	1,450	655,400,000
平和不動産	50,500	234	11,817,000
東京建物	96,000	427	40,992,000
ダイビル	17,300	950	16,435,000
サンケイビル	12,300	437	5,375,100
東急不動産	131,000	343	44,933,000
京阪神不動産	13,000	395	5,135,000
住友不動産	165,000	1,337	220,605,000
藤和不動産	30,500	61	1,860,500
大京	57,000	81	4,617,000
テーオーシー	26,000	490	12,740,000
レオパレス 2 1	45,200	859	38,826,800
空港施設	9,600	548	5,260,800
明和地所	5,600	441	2,469,600
住友不動産販売	3,020	2,725	8,229,500
ゴールドクレスト	5,110	2,320	11,855,200
日本エスリード	3,900	476	1,856,400
日本総合地所	11,700	160	1,872,000
東急リバブル	8,100	409	3,312,900
飯田産業	5,700	450	2,565,000
日神不動産	9,100	202	1,838,200
アーネストワン	13,200	157	2,072,400
タカラレーベン	7,100	244	1,732,400
イオンモール	29,500	1,851	54,604,500
リサ・パートナーズ	94	41,800	3,929,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	424	98,100	41,594,400
サンフロンティア不動産	71	21,610	1,534,310
大和システム	6,700	191	1,279,700
アトリウム	7,900	333	2,630,700
東武鉄道	284,000	518	147,112,000
相模鉄道	91,000	398	36,218,000
東京急行	363,000	414	150,282,000
京浜急行	164,000	799	131,036,000
小田急電鉄	213,000	763	162,519,000
京王電鉄	174,000	518	90,132,000
京成電鉄	110,000	542	59,620,000
富士急行	21,000	421	8,841,000
東日本旅客鉄道	1,223	684,000	836,532,000
西日本旅客鉄道	614	402,000	246,828,000
東海旅客鉄道	546	760,000	414,960,000
西日本鉄道	89,000	377	33,553,000
ハマキョウレックス	2,800	1,887	5,283,600
近畿鉄道	592,000	413	244,496,000
阪急阪神HLDGS	441,000	494	217,854,000
南海電鉄	139,000	426	59,214,000
京阪電鉄	148,000	406	60,088,000
名古屋鉄道	232,000	285	66,120,000
日本通運	283,000	379	107,257,000
ヤマトホールディングス	131,000	1,167	152,877,000
山 九	79,000	354	27,966,000
日 新	29,000	247	7,163,000
丸全昭和運輸	22,000	287	6,314,000
センコー	27,000	356	9,612,000
トナミホールディングス	25,000	240	6,000,000

日本梱包運輸	19,000	948	18,012,000	
福山通運	53,000	421	22,313,000	
セイノーホールディングス	51,000	561	28,611,000	
神奈川中央交通	14,000	527	7,378,000	
日立物流	13,900	1,249	17,361,100	
日本郵船	352,000	526	185,152,000	
商船三井	344,000	571	196,424,000	
川崎汽船	157,000	392	61,544,000	
新和海運	27,000	241	6,507,000	
乾 汽 船	8,100	686	5,556,600	
明治海運	8,500	425	3,612,500	
飯野海運	32,700	631	20,633,700	
太平洋海運	18,000	105	1,890,000	
第一中央汽船	42,000	258	10,836,000	
全日本空輸	679,000	349	236,971,000	
日本航空	954,000	207	197,478,000	
パスコ	21,000	117	2,457,000	
三菱倉庫	47,000	1,068	50,196,000	
三井倉庫	30,000	411	12,330,000	
住友倉庫	53,000	430	22,790,000	
渋沢倉庫	22,000	488	10,736,000	
ヤマタネ	37,000	104	3,848,000	
東陽倉庫	24,000	174	4,176,000	
日本トランスシティ	22,000	329	7,238,000	
東洋埠頭	31,000	150	4,650,000	
上 組	78,000	776	60,528,000	
郵船航空サービス	5,500	1,052	5,786,000	
近鉄エクスプレス	6,100	1,617	9,863,700	
バンテックHD	36	161,700	5,821,200	
東京放送	38,600	1,284	49,562,400	
日本テレビ放送網	6,140	9,310	57,163,400	
テレビ朝日	164	113,000	18,532,000	
テレビ東京	2,600	4,150	10,790,000	
スカパーJ S A T H D	517	38,750	20,033,750	
イー・アクセス	323	45,500	14,696,500	
NECモバイルリング	3,400	1,355	4,607,000	
日本電信電話	2,984	464,000	1,384,576,000	
KDDI	1,009	616,000	621,544,000	
光通信	8,800	1,479	13,015,200	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,417	173,000	1,110,141,000	※
GMOインターネット	14,100	466	6,570,600	
学習研究社	26,000	141	3,666,000	
ゼンリン	9,600	997	9,571,200	
昭文社	7,000	429	3,003,000	
角川グループHLDGS	5,800	1,820	10,556,000	
東京電力	414,300	2,895	1,199,398,500	
中部電力	222,700	2,715	604,630,500	
関西電力	272,900	2,575	702,717,500	
中国電力	98,000	2,340	229,320,000	
北陸電力	67,400	2,510	169,174,000	
東北電力	163,500	2,385	389,947,500	
四国電力	69,300	2,955	204,781,500	
九州電力	144,600	2,355	340,533,000	
北海道電力	61,500	2,225	136,837,500	
沖縄電力	4,900	6,150	30,135,000	

電源開発	47,400	3,330	157,842,000
東京瓦斯	833,000	449	374,017,000
大阪瓦斯	708,000	393	278,244,000
東邦瓦斯	172,000	596	102,512,000
西部瓦斯	85,000	242	20,570,000
静岡瓦斯	21,500	574	12,341,000
松 竹	38,000	614	23,332,000
東 宝	47,000	1,881	88,407,000
エイチ・アイ・エス	6,500	1,760	11,440,000
東 映	29,000	406	11,774,000
N T Tデータ	410	373,000	152,930,000
共立メンテナンス	3,900	1,650	6,435,000
東京テアトル	36,000	196	7,056,000
テクモ	5,100	765	3,901,500
光 栄	5,600	908	5,084,800
吉本興業	11,000	1,176	12,936,000
よみうりランド	21,000	270	5,670,000
東京都競馬	55,000	137	7,535,000
常磐興産	39,000	142	5,538,000
カナモト	14,000	315	4,410,000
東京ドーム	54,000	332	17,928,000
D T S	6,700	812	5,440,400
スクウェア・エニックス・HD	19,000	2,740	52,060,000
シーイーシー	6,500	784	5,096,000
日立ソフトウェア	9,600	1,436	13,785,600
カプコン	14,800	1,999	29,585,200
日本空港ビルデング	18,400	1,146	21,086,400
トランス・コスモス	9,700	584	5,664,800
乃村工藝社	16,000	282	4,512,000
住商情報システム	7,000	1,427	9,989,000
藤田観光	22,000	518	11,396,000
近畿日本ツーリスト	27,000	160	4,320,000
日本管財	3,100	1,612	4,997,200
セコム	66,600	4,470	297,702,000
C S Kホールディングス	20,200	479	9,675,800
日立情報	5,500	1,861	10,235,500
アイネス	9,800	453	4,439,400
メイテック	11,800	1,661	19,599,800
T K C	6,900	1,800	12,420,000
アサツー ディ・ケイ	13,900	2,020	28,078,000
富士ソフト	8,100	1,890	15,309,000
ソラン	8,900	554	4,930,600
応用地質	8,800	1,182	10,401,600
日システム	11,800	750	8,850,000
コナミ	29,300	2,180	63,874,000
ベネッセコーポレーション	23,800	4,110	97,818,000
イオンディライト	5,200	2,420	12,584,000
ニチイ学館	8,900	1,290	11,481,000
ダイセキ	10,300	1,855	19,106,500
トラスコ中山	8,500	1,027	8,729,500
ヤマダ電機	31,330	6,280	196,752,400
オートバックスセブン	10,500	2,100	22,050,000
アークランドサカモト	5,600	902	5,051,200
ニ ト リ	13,950	7,260	101,277,000
ユーエスシー	3,400	939	3,192,600

愛 眼	9,200	499	4,590,800
吉野家ホールディングス	165	109,700	18,100,500
日商エレクトロニクス	8,000	538	4,304,000
加藤産業	9,500	1,484	14,098,000
富士エレクトロニクス	5,600	667	3,735,200
松屋フーズ	5,200	1,212	6,302,400
J B C Cホールディングス	8,700	764	6,646,800
J Kホールディングス	7,200	603	4,341,600
バイタルネット	8,200	591	4,846,200
因幡電機産業	6,400	2,390	15,296,000
住金物産	35,000	238	8,330,000
プレナス	8,300	1,618	13,429,400
ミニストップ	5,700	1,859	10,596,300
アークス	8,600	1,405	12,083,000
バ ロ ー	13,800	988	13,634,400
ミスミグループ本社	22,200	1,146	25,441,200
大 庄	4,600	1,331	6,122,600
ファーストリテイリング	15,100	14,550	219,705,000
ソフトバンク	264,800	1,485	393,228,000
スズケン	24,000	2,605	62,520,000
サンドラッグ	12,400	2,375	29,450,000
ベルーナ	9,850	244	2,403,400
合計	87,769,257		70,428,473,261

[次へ](#)

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

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

（2） 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成20年12月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	144,124,935
コール・ローン	278,362,642
株式	28,876,603,112
投資証券	378,905,238
派生商品評価勘定	10,443,351
未収入金	294,463
未収配当金	48,968,263
差入委託証拠金	166,213,680
流動資産合計	29,903,915,684
資産合計	29,903,915,684
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,600
未払金	192,917,571
未払解約金	2,507,000
流動負債合計	195,443,171
負債合計	195,443,171
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	45,340,673,673
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△15,632,201,160
元本等合計	29,708,472,513
純資産合計	29,708,472,513
負債純資産合計	29,903,915,684

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20年2月28日 至 平成20年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として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。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成20年12月18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	27,952,807,068円
同期中における追加設定元本額	22,190,636,218円
同期中における一部解約元本額	4,802,769,613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	1,748,925,037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）	132,796,893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）	1,801,657,709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）	272,628,517円

ダイワ国際分散バランスファンド 50VA（一般投資家私募）	5,527,468,369円
DCダイワ外国株式インデックス	7,845,756,362円
ダイワ・ライフ・バランス30	542,690,850円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,363,642円
ダイワ・ライフ・バランス70	6,834,314円
大和DC海外株式インデックス ファンド	1,049,771,561円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	1,366,209円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	919,201円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	312,706円
ダイワ世界分散バランスファンド 15VA	159,594,150円
ダイワ世界分散バランスファンド 20VA	2,302,422,697円
ダイワ世界分散バランスファンド 25VA	46,897,529円
ダイワ世界分散バランスファンド 30VA	434,717,086円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	8,351,683,090円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	1,869,051,925円
ダイワ・バランスファンド35V A	11,317,927,850円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	1,795,458,099円
ダイワライフスタイル25	20,196,069円
ダイワライフスタイル50	57,893,613円
ダイワライフスタイル75	49,340,195円
計	45,340,673,673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	45,340,673,673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15,632,201,160円であります。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年12月18日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	28,876,603,112	62,718,698
投資証券	378,905,238	29,398,028
合計	29,255,508,350	92,116,726

（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20年12月2日から平成20年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、信託約款に従って外国の取引所における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。また、為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

II 取引の時価等に関する事項

1. 株式関連

種 類	平成20年12月18日 現在			
	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	384,430,200	—	394,836,750	10,406,550
合計	384,430,200	—	394,836,750	10,406,550

(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20年12月18日 現在		
	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	42,383,200	—	42,401,400	18,200
オーストラリア・ドル	38,266,400	—	38,247,800	△18,600
ニュージーランド・ドル	4,116,800	—	4,153,600	36,800
合計	42,383,200	—	42,401,400	18,200

(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。
- ① 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。
 - ② 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成20年12月18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)	0.6552円 (6,552円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	FIRST SOLAR INC	1,000	141.940	141,940.000	
	AVON PRODUCTS	9,700	22.830	221,451.000	
	ABBOTT LABS	31,300	52.060	1,629,478.000	
	ALCOA	17,100	10.350	176,985.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	2,000	7.500	15,000.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	5,500	23.280	128,040.000	
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	4,229	16.720	70,708.880	
	ALLEGHENY ENERGY INC	3,400	31.680	107,712.000	

AFLAC INC	11,900	46.520	553,588.000
DARDEN RESTAURANTS INC	2,500	24.130	60,325.000
HANSEN NATURAL CORPORATIO	1,700	32.240	54,808.000
ADOBE SYSTEMS	11,000	21.690	238,590.000
CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,100	55.500	61,050.000
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,400	17.850	185,640.000
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,300	67.400	87,620.000
ASSOCIATED BANC-CORP	2,500	19.730	49,325.000
GARMIN LTD	3,900	20.000	78,000.000
AETNA INC	10,100	24.420	246,642.000
DST SYSTEMS INC	800	38.940	31,152.000
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	4,700	49.370	232,039.000
ALTERA CORPORATION	9,400	16.700	156,980.000
FORTUNE BRANDS INC	3,100	40.430	125,333.000
HONEYWELL INTERNATIONAL	17,800	32.820	584,196.000
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,051	13.550	41,341.050
WR BERKLEY CORP	4,700	30.050	141,235.000
AUTOZONE INC	1,200	134.270	161,124.000
PINNACLE WEST CAPITAL	3,400	30.560	103,904.000
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	3,000	25.810	77,430.000
CELANESE CORP-SERIES A	5,400	12.680	68,472.000
D.R.HORTON INC	7,366	8.400	61,874.400
WYETH	29,600	37.100	1,098,160.000
DENTSPLY INTERNATIONAL IN	4,600	26.830	123,418.000
AUTODESK INC	7,100	19.210	136,391.000
MOODY'S CORP	3,800	21.910	83,258.000
DYNEGY INC	9,000	2.080	18,720.000
DEVON ENERGY CORPORATION	8,900	68.660	611,074.000
CONSOL ENERGY INC	5,600	32.370	181,272.000
ALLIANT ENERGY CORP	2,000	30.020	60,040.000
CITIGROUP INC	114,033	7.830	892,878.390
AUTOMATIC DATA PROCESSING	12,300	37.250	458,175.000
AMERICAN ELEC POWER	8,300	30.200	250,660.000
DUN&BRADSTREET CORP	1,700	73.680	125,256.000
HESS CORP	6,100	52.410	319,701.000
COVIDIEN LTD	12,425	37.650	467,801.250
DAVITA INC	1,900	50.080	95,152.000
DANAHER CORP	5,400	53.960	291,384.000
AVNET INC	5,200	17.440	90,688.000
INTERCONTINENTALEXCHANGE	1,600	81.880	131,008.000
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,100	28.350	343,035.000
PEABODY ENERGY CORP	6,700	25.480	170,716.000
BUNGE LIMITED	2,500	47.750	119,375.000
TYCO ELECTRONICS LTD	10,325	16.610	171,498.250
HUNTSMAN CORP	4,000	3.160	12,640.000
APPLE INC	19,000	89.160	1,694,040.000
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	8,900	8.580	76,362.000
BOEING CO	17,100	41.020	701,442.000
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,515	29.990	105,414.850
MEADWESTVACO CORP	3,500	12.450	43,575.000
SPECTRA ENERGY CORP	14,696	15.640	229,845.440
BECTON DICKINSON & CO	5,000	67.400	337,000.000
BURLINGTON NORTHERN SANTA	7,300	76.470	558,231.000
BJ SERVICES CO	9,800	11.720	114,856.000
NISOURCE INC	9,100	11.380	103,558.000
JOY GLOBAL INC	3,600	25.510	91,836.000
BMC SOFTWARE INC	5,800	25.510	147,958.000

C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	3,200	51.750	165,600.000
BARD(C.R.) INC	2,600	81.540	212,004.000
BLACK & DECKER CORP	1,900	44.250	84,075.000
BANK OF NEW YORK MELLON	23,771	28.000	665,588.000
VERIZON COMMUNICATIONS	61,200	34.050	2,083,860.000
BARR PHARMACEUTICALS INC	2,100	66.490	139,629.000
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	240	3,300.000	792,000.000
H&R BLOCK INC	8,800	22.050	194,040.000
BB&T CORPORATION	11,400	30.240	344,736.000
BECKMAN COULTER INC	2,100	41.800	87,780.000
HOSPIRA INC	5,220	27.810	145,168.200
BROADCOM CORP-CL A	10,650	18.900	201,285.000
BAKER HUGHES INC	6,300	31.030	195,489.000
BRISTOL MYERS SQUIBB	47,700	22.480	1,072,296.000
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,200	47.940	57,528.000
FIDELITY NATIONAL FINL-A	7,138	15.530	110,853.140
JPMORGAN CHASE & CO	78,120	31.860	2,488,903.200
XTO ENERGY INC	12,466	38.150	475,577.900
HEALTH NET INC	1,900	10.770	20,463.000
LEGG MASON INC	2,850	20.860	59,451.000
PACTIV CORPORATION	3,300	23.530	77,649.000
T ROWE PRICE GROUP INC	5,300	33.680	178,504.000
CIGNA CORP	8,800	15.840	139,392.000
COMPUTER SCIENCES CORP	4,900	32.770	160,573.000
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,400	47.100	65,940.000
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,760	21.940	104,434.400
WHITE MOUNTAINS INSURANCE	200	274.100	54,820.000
CATERPILLAR INC DEL	15,100	44.650	674,215.000
GENWORTH FINANCIAL INC-A	7,900	3.130	24,727.000
PETROHAWK ENERGY CORP	6,500	16.510	107,315.000
CHARLES RIVER LABORATORIE	1,400	24.940	34,916.000
VIRGIN MEDIA INC	10,200	4.390	44,778.000
MOSAIC CO/THE	3,300	37.170	122,661.000
CORNING INC	39,900	9.190	366,681.000
CISCO SYSTEMS	131,800	16.840	2,219,512.000
DU PONT	22,000	27.110	596,420.000
MORGAN STANLEY	20,600	16.500	339,900.000
DOW CHEMICAL	20,300	20.600	418,180.000
DELL INC	40,800	11.680	476,544.000
ENSCO INTERNATIONAL INC	4,400	32.030	140,932.000
DTE ENERGY COMPANY	5,000	34.530	172,650.000
TELEPHONE AND DATA SYSTEM	1,500	30.620	45,930.000
AGCO CORP	1,900	24.650	46,835.000
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,500	34.340	497,930.000
DENBURY RESOURCES INC	5,300	9.390	49,767.000
DEERE & CO	8,900	40.380	359,382.000
AMERICAN CAPITAL LTD	4,500	3.050	13,725.000
TIME WARNER INC	69,100	10.380	717,258.000
SANDRIDGE ENERGY INC	3,300	6.400	21,120.000
URBAN OUTFITTERS INC	2,300	16.310	37,513.000
NASDAQ STOCK MARKET INC	3,000	25.070	75,210.000
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	3,550	10.200	36,210.000
CONSOLIDATED EDISON INC	5,700	38.620	220,134.000
NYSE EURONEXT	2,700	29.100	78,570.000
COLGATE PALMOLIVE CO	12,300	62.180	764,814.000
COSTCO WHOLESALE CORP	9,000	53.940	485,460.000
SCANA CORP	2,700	34.070	91,989.000

LEUCADIA NATIONAL CORP	3,900	21.260	82,914.000
CUMMINS INC	6,000	26.050	156,300.000
ACTIVISION BLIZZARD INC	14,000	9.720	136,080.000
APOLLO GROUP INC-CL A	3,500	75.510	264,285.000
LORILLARD INC	4,500	55.270	248,715.000
PROGRESS ENERGY INC	5,100	39.250	200,175.000
FOREST OIL CORP	2,900	18.560	53,824.000
CABOT OIL & GAS CORP	3,600	26.900	96,840.000
METROPCS COMMUNICATIONS	7,300	15.760	115,048.000
ABERCROMBIE & FITCH -CL A	1,800	22.720	40,896.000
COCA COLA CO	45,900	45.480	2,087,532.000
COCA-COLA ENTERPRISES	5,400	10.690	57,726.000
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,700	33.180	189,126.000
COOPER INDUSTRIES LTD-A	5,400	30.830	166,482.000
FMC TECHNOLOGIES INC	4,000	24.590	98,360.000
FRANKLIN RESOURCES INC	3,800	64.550	245,290.000
CSX CORP	10,300	35.300	363,590.000
FLUOR CORP	5,300	50.980	270,194.000
EASTMAN KODAK CO	6,100	6.300	38,430.000
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,200	63.650	140,030.000
EXPEDIA INC	6,950	8.510	59,144.500
AMAZON.COM INC	6,500	53.180	345,670.000
FLOWERVE CORP	1,200	53.740	64,488.000
EXXON MOBIL CORP	116,900	81.060	9,475,914.000
RALCORP HOLDINGS INC	1,600	57.130	91,408.000
FLIR SYSTEMS INC	3,000	26.300	78,900.000
AES CORP	20,800	7.530	156,624.000
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	2,700	70.150	189,405.000
EVEREST RE GROUP LTD	1,300	76.450	99,385.000
EOG RESOURCES INC	5,200	69.600	361,920.000
FTI CONSULTING INC	1,400	42.680	59,752.000
EQUITABLE RESOURCES INC	2,600	31.910	82,966.000
AKAMAI TECHNOLOGIES	5,700	16.060	91,542.000
AMERICAN TOWER CORP-CL A	8,100	28.680	232,308.000
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,100	34.070	105,617.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,490	16.330	154,971.700
FORD MOTOR CO	30,523	3.140	95,842.220
MACY'S INC	7,898	10.010	79,058.980
ARCH COAL INC	3,000	17.020	51,060.000
FOSTER WHEELER LTD	4,600	27.520	126,592.000
DISCOVERY COMMUNICATION-A	4,840	13.460	65,146.400
FOREST LABORATORIES INC	9,000	24.870	223,830.000
LIBERTY GLOBAL INC	3,135	13.000	40,755.000
DISCOVERY COMMUNICATION-C	4,240	12.510	53,042.400
FPL GROUP INC	8,500	47.340	402,390.000
FREEPORT-MCMORAN COPPER-B	8,504	26.010	221,189.040
WACHOVIA CORP	35,522	5.880	208,869.360
US BANCORP	40,700	25.200	1,025,640.000
FAMILY DOLLAR STORES	4,500	25.790	116,055.000
FASTENAL CO	2,700	34.120	92,124.000
FISERV INC	5,200	35.980	187,096.000
GENERAL ELECTRIC CO	235,600	17.390	4,097,084.000
EMBARQ CORP	3,046	31.600	96,253.600
GENZYME CORP-GENL DIVISIO	5,600	67.520	378,112.000
GOODYEAR TIRE&RUBBER	7,900	6.650	52,535.000
GENERAL DYNAMICS CORP	8,500	55.490	471,665.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,700	78.780	685,386.000

GENENTECH INC	10,900	78.750	858,375.000
GAMESTOP CORP-CLASS A	4,900	25.670	125,783.000
GOODRICH CORP	4,100	35.940	147,354.000
GOOGLE INC-CL A	5,100	315.240	1,607,724.000
GENERAL MILLS INC	6,900	61.350	423,315.000
FIRSTENERGY CORP	6,300	52.490	330,687.000
GENUINE PARTS CO	4,400	38.170	167,948.000
FIFTH THIRD BANCORP	12,500	7.510	93,875.000
HARRIS CORP	4,300	37.180	159,874.000
HARSCO CORP	3,000	25.440	76,320.000
HALLIBURTON CO	22,100	18.410	406,861.000
HOME DEPOT INC	40,900	24.700	1,010,230.000
ASSURANT INC	2,100	25.100	52,710.000
HUNTINGTON BANCSHARES INC	11,700	7.750	90,675.000
HERSHEY CO/THE	4,300	36.140	155,402.000
HARLEY-DAVIDSON INC	7,200	16.940	121,968.000
HUMANA INC	5,200	34.110	177,372.000
STARWOOD HOTELS & RESORTS	6,100	18.530	113,033.000
HELMERICH & PAYNE	3,300	23.100	76,230.000
WINDSTREAM CORP	11,500	8.930	102,695.000
HEWLETT-PACKARD CO	51,000	36.470	1,859,970.000
DIRECTV GROUP INC/THE	14,500	23.240	336,980.000
HEINZ H J CO	6,800	39.280	267,104.000
INT'L BUSINESS MACHINES	30,000	85.840	2,575,200.000
INTERNATIONAL PAPER	9,700	13.160	127,652.000
ITT CORP	3,200	45.110	144,352.000
INGERSOLL-RAND CO-CL A	8,629	16.350	141,084.150
LEGGETT & PLATT INC	3,600	14.590	52,524.000
LIBERTY GLOBAL INC-C	3,435	12.060	41,426.100
JUNIPER NETWORKS INC	14,200	17.320	245,944.000
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3,100	40.860	126,666.000
JOHNSON & JOHNSON	59,400	58.780	3,491,532.000
HOLOGIC INC	8,800	13.520	118,976.000
KIMBERLY-CLARK CORP	8,400	50.740	426,216.000
KROGER CO	14,300	26.310	376,233.000
KLA-TENCOR CORPORATION	5,600	22.320	124,992.000
LOCKHEED MARTIN CORP	6,800	78.910	536,588.000
TIM HORTONS INC	5,783	27.500	159,032.500
LIMITED BRANDS	6,200	9.340	57,908.000
LEXMARK INT'L INC-A	2,000	27.690	55,380.000
LOWE'S COS INC	35,600	22.980	818,088.000
ELI LILLY & CO	24,800	36.940	916,112.000
LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN	29,700	0.720	21,384.000
LAM RESEARCH CORP	3,200	22.900	73,280.000
RANGE RESOURCES CORP	3,900	34.930	136,227.000
LSI CORP	22,500	3.770	84,825.000
LOEWS CORP	8,500	28.450	241,825.000
LAMAR ADVERTISING CO-CL A	1,400	14.110	19,754.000
LINCOLN NATIONAL CORP	5,249	17.770	93,274.730
MCDONALD'S CORP	25,300	62.630	1,584,539.000
3M CO	16,000	58.580	937,280.000
MERRILL LYNCH&CO INC	31,600	12.550	396,580.000
MANPOWER INC	2,700	35.100	94,770.000
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	7,300	24.520	178,996.000
MARTIN MARIETTA MATERIALS	800	95.690	76,552.000
MCAFEE INC	3,300	32.500	107,250.000
MURPHY OIL CORP	3,900	45.720	178,308.000

MGM MIRAGE	1,700	13.850	23,545.000
MATTEL INC	9,800	14.890	145,922.000
KBR INC	3,600	15.760	56,736.000
MCCORMICK & CO-NON VTG SH	3,800	30.520	115,976.000
METLIFE INC	19,100	33.890	647,299.000
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	16,600	7.180	119,188.000
MOTOROLA INC	45,700	4.410	201,537.000
MONSANTO CO	12,206	75.810	925,336.860
MCDERMOTT INTL INC	7,400	10.540	77,996.000
MIRANT CORP	3,800	19.330	73,454.000
ROCKWELL INTL CORP	2,800	31.350	87,780.000
MERCK & CO INC	44,100	27.120	1,195,992.000
MASCO CORP	12,100	10.880	131,648.000
M & T BANK CORP	1,500	61.380	92,070.000
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	11,436	41.100	470,019.600
MARSH & MCLENNAN COS	11,700	22.890	267,813.000
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	5,200	18.210	94,692.000
NETAPP INC	6,800	13.970	94,996.000
NIKE INC -CL B	7,800	50.640	394,992.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,800	47.950	374,010.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,700	20.570	76,109.000
NATIONAL SEMICONDUCTOR	7,700	11.340	87,318.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,600	41.630	274,758.000
NEWMONT MINIG CORP	9,000	39.170	352,530.000
MCKESSON CORP	5,800	37.820	219,356.000
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	45,500	42.030	1,912,365.000
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	4,500	16.660	74,970.000
NUCOR CORP	6,500	47.260	307,190.000
NABORS INDUSTRIES LTD	8,900	12.990	115,611.000
WESTERN UNION CO	15,546	14.060	218,576.760
NEWELL RUBBERMAID INC	5,900	9.580	56,522.000
OCCIDENTAL PETROLEUM	18,500	57.460	1,063,010.000
OLD REPUBLIC INTL CORP	7,675	10.770	82,659.750
PAYCHEX INC	8,500	26.610	226,185.000
J.C.PENNY CO INC(HLDG CO)	6,700	21.490	143,983.000
PATTERSON COS INC	2,100	18.660	39,186.000
ALTRIA GROUP INC	50,000	14.670	733,500.000
OWENS-ILLINOIS INC	5,400	24.560	132,624.000
PG & E CORPORATION	7,400	38.000	281,200.000
PFIZER INC	147,160	17.250	2,538,510.000
JANUS CAPITAL GROUP INC	5,600	8.090	45,304.000
XCEL ENERGY INC	8,700	18.050	157,035.000
STRYKER CORP	5,900	39.630	233,817.000
AFFILIATED COMPUTER SVCS-A	1,600	41.500	66,400.000
PARKER HANNIFIN CORP	5,100	38.280	195,228.000
PALL CORP	4,000	27.430	109,720.000
PIONEER NATURAL RESOURCES	2,200	17.790	39,138.000
PATTERSON-UTI ENERGY INC	2,800	11.910	33,348.000
PROCTER & GAMBLE CO	66,037	60.700	4,008,445.900
EXELON CORP	13,500	53.100	716,850.000
CONOCOPHILLIPS	31,600	53.420	1,688,072.000
PEPSICO INC	34,100	54.330	1,852,653.000
PLAINS EXPLORATION&PRODUC	2,800	22.840	63,952.000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,600	29.180	250,948.000
ACCENTURE LTD-CL A	13,800	30.240	417,312.000
QUESTAR CORP	3,500	32.650	114,275.000
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,600	28.900	132,940.000

PENTAIR INC	1,900	24.890	47,291.000
QUALCOMM INC	33,400	35.100	1,172,340.000
PARTNERRE LTD	1,200	69.020	82,824.000
PHARMACEUTICAL PRODUCT	2,000	27.150	54,300.000
INVESCO LTD	7,950	13.220	105,099.000
ADVANCE AUTO PARTS	3,250	33.040	107,380.000
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,300	20.150	167,245.000
MDU RESOURCES GROUP INC	3,800	21.360	81,168.000
ENERGEN CORP	1,500	29.370	44,055.000
RAYTHEON CO	8,500	50.490	429,165.000
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	3,100	20.640	63,984.000
REPUBLIC SERVICES INC	9,000	22.660	203,940.000
PRICELINE.COM INC	1,300	70.310	91,403.000
ROSS STORES INC	2,700	29.650	80,055.000
QUEST DIAGNOSTICS	3,100	49.420	153,202.000
ROBERT HALF INTL INC	3,200	19.610	62,752.000
ROHM AND HAAS CO	2,500	70.500	176,250.000
REYNOLDS AMERICAN INC	4,700	38.460	180,762.000
POLO RALPH LAUREN CORP	1,100	47.450	52,195.000
PEPSI BOTTLING GROUP INC	7,000	19.500	136,500.000
ROWAN COS INC	2,300	16.840	38,732.000
QWEST COMMUNICATIONS INTL	31,500	3.080	97,020.000
ROCKWELL COLLINS INC.	4,900	37.570	184,093.000
REGIONS FINANCIAL CORP	13,935	8.770	122,209.950
RELIANT RESOURCES INC	7,100	5.230	37,133.000
SUNOCO INC	2,100	41.040	86,184.000
CHEVRON CORP	45,718	76.820	3,512,056.760
EDISON INTERNATIONAL	6,800	31.250	212,500.000
SCHERING PLOUGH CORP	36,300	17.580	638,154.000
SYMANTEC CORP	19,100	13.390	255,749.000
STANLEY WORKS/THE	1,400	33.190	46,466.000
SYNOPSYS INC	2,900	18.120	52,548.000
TEREX CORP	1,800	17.800	32,040.000
TRANSOCEAN INC	6,522	55.060	359,101.320
SLM CORP	3,600	9.280	33,408.000
SANDISK CORP	4,100	9.790	40,139.000
SOUTHERN CO	16,900	36.300	613,470.000
SYSCO CORP	12,400	23.870	295,988.000
SMITH INTERNATIONAL INC	4,500	25.410	114,345.000
TRAVELERS COS INC	12,423	42.730	530,834.790
SOUTHWESTERN ENERGY CO	7,300	27.060	197,538.000
SPX CORP	1,100	37.190	40,909.000
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,400	15.080	51,272.000
SCHLUMBERGER LTD	25,400	42.540	1,080,516.000
SOVEREIGN BANCORP INC	10,880	3.020	32,857.600
SUPERVALU INC	3,873	13.080	50,658.840
AT&T INC	129,195	28.120	3,632,963.400
SIGMA-ALDRICH	2,600	42.530	110,578.000
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,700	56.910	153,657.000
SEMPRA ENERGY	4,900	41.330	202,517.000
TIFFANY & CO	2,400	25.740	61,776.000
SEAGATE TECHNOLOGY	16,300	4.770	77,751.000
TEXAS INSTRUMENTS INC	29,100	16.250	472,875.000
SALESFORCE.COM INC	2,400	33.180	79,632.000
TIME WARNER CABLE-A	5,900	20.160	118,944.000
TYCO INTERNATIONAL LTD	10,325	21.350	220,438.750
UNION PACIFIC CORP	9,800	48.790	478,142.000

MARATHON OIL CORP	14,300	26.900	384,670.000
UNITED TECHNOLOGIES	16,400	50.600	829,840.000
UNITED PARCEL SERVICE-B	16,600	52.460	870,836.000
SPRINT NEXTEL CORP	56,522	1.850	104,565.700
UNUM GROUP	7,100	17.490	124,179.000
AMEREN CORPORATION	4,300	32.620	140,266.000
UNITEDHEALTH GROUP INC	24,526	23.900	586,171.400
USX-US STEEL GRP	2,600	42.120	109,512.000
VERISIGN INC	4,200	22.140	92,988.000
VALERO ENERGY CORP	12,892	22.350	288,136.200
WEYERHAEUSER CO	4,000	40.110	160,440.000
WELLPOINT INC	11,800	38.810	457,958.000
THE WALT DISNEY CO.	42,800	23.580	1,009,224.000
WELLS FARGO & CO	72,400	29.980	2,170,552.000
WASTE MANAGEMENT INC	10,400	31.420	326,768.000
WILLIAMS COMPANY	12,400	14.280	177,072.000
WHIRLPOOL CORP	1,400	43.000	60,200.000
WAL-MART STORES	50,900	55.190	2,809,171.000
ZIMMER HOLDINGS INC	4,800	39.940	191,712.000
WEATHERFORD INTERNATIONAL	13,900	10.930	151,927.000
WYNN RESORTS LTD	1,900	47.590	90,421.000
XEROX CORP	16,500	7.780	128,370.000
TJX COMPANIES INC	9,000	20.940	188,460.000
WATERS CORP	1,900	36.700	69,730.000
WHOLE FOODS MARKET INC	3,300	11.080	36,564.000
WASHINGTON POST -CL B	140	390.400	54,656.000
WALGREEN CO	20,400	25.730	524,892.000
WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	4,700	24.490	115,103.000
WESTERN DIGITAL CORP	4,400	12.720	55,968.000
WISCONSIN ENERGY CORP	2,200	40.890	89,958.000
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	10,500	28.090	294,945.000
VISA INC-CLASS A SHS	9,400	55.360	520,384.000
PPL CORPORATION	7,700	29.250	225,225.000
PITNEY BOWES INC	6,300	24.530	154,539.000
PEPCO HOLDINGS INC	4,600	16.830	77,418.000
PULTE HOMES INC	3,900	11.920	46,488.000
ULTRA PETROLEUM CORP	4,100	33.170	135,997.000
PPG INDUSTRIES INC	4,300	44.500	191,350.000
NORTHERN TRUST CORP	4,300	50.530	217,279.000
PRECISION CASTPARTS CORP	2,800	58.310	163,268.000
NATIONAL CITY CORP	9,700	1.780	17,266.000
NVIDIA CORP	10,350	9.320	96,462.000
PNC FINANCIAL SERVICES	7,213	45.980	331,653.740
LIBERTY MEDIA-INTERACTI A	13,450	3.120	41,964.000
LIBERTY MEDIA CORP-ENT A	10,580	18.290	193,508.200
TERADATA CORP	3,600	15.460	55,656.000
TYSON FOODS INC-CL A	5,200	7.910	41,132.000
NII HOLDINGS INC	5,300	18.520	98,156.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC	8,400	33.130	278,292.000
NRG ENERGY INC	4,600	21.580	99,268.000
TORCHMARK CORP	2,100	42.960	90,216.000
SUNPOWER CORP-CLASS A	700	36.820	25,774.000
SUNPOWER CORP-CLASS B	1,000	29.300	29,300.000
TEXTRON INC	5,000	15.430	77,150.000
NEWS CORP INC-CL A	38,950	8.450	329,127.500
NEWS CORP-CLASS B	12,100	8.910	107,811.000
OMNICOM GROUP	6,800	27.600	187,680.000

ORACLE CORPORATION	89,483	16.740	1,497,945.420
MASTERCARD INC-CLASS A	2,200	148.680	327,096.000
ONEOK INC	2,200	28.550	62,810.000
ROPER INDUSTRIES INC	1,800	42.120	75,816.000
CEPHALON INC	1,900	76.800	145,920.000
YUM! BRANDS INC	9,900	30.540	302,346.000
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,500	45.160	67,740.000
MOLSON COORS BREWING CO-B	2,300	46.070	105,961.000
NOBLE ENERGY INC	4,400	49.460	217,624.000
BANK OF AMERICA CORP	101,841	14.620	1,488,915.420
NORDSTROM INC	3,300	13.980	46,134.000
AMERICAN EXPRESS CO	21,400	19.810	423,934.000
ANALOG DEVICES	7,800	19.680	153,504.000
ADVANCED MICRO DEVICES	20,927	2.290	47,922.830
TD AMERITRADE HOLDING COR	4,300	13.020	55,986.000
AMERICAN INTL GROUP	39,450	1.750	69,037.500
ANADARKO PETROLEUM CORP	9,600	39.230	376,608.000
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	2,900	11.710	33,959.000
HUDSON CITY BANCORP INC	12,300	16.020	197,046.000
NEWFIELD EXPLORATION COMP	2,400	20.920	50,208.000
AVERY DENNISON CORP	3,000	33.560	100,680.000
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	5,300	17.540	92,962.000
EMERSON ELECTRIC CO	16,900	36.200	611,780.000
AON CORP	6,100	42.370	258,457.000
AMGEN	24,300	58.420	1,419,606.000
ALLERGAN INC	6,200	36.890	228,718.000
COACH INC	9,000	22.020	198,180.000
EATON CORP	4,600	44.490	204,654.000
CROWN CASTLE INTL CORP	5,100	18.070	92,157.000
CELGENE CORP	11,100	53.040	588,744.000
CONSTELLATION BRANDS INC-	4,300	15.360	66,048.000
APPLIED MATERIALS INC	27,400	10.670	292,358.000
CIMAREX ENERGY CO	2,800	27.960	78,288.000
CME GROUP INC	1,300	222.980	289,874.000
NATIONAL OILWELL VARCO IN	8,344	26.090	217,694.960
ECOLAB INC	5,900	35.530	209,627.000
EQUIFAX INC	2,600	25.180	65,468.000
GAP INC	10,300	14.070	144,921.000
GILEAD SCIENCES INC	19,100	47.650	910,115.000
MARSHALL & ILSLEY CORP	7,399	12.840	95,003.160
COVENTRY HEALTH CARE INC	3,050	13.080	39,894.000
ST JUDE MEDICAL INC	7,200	32.410	233,352.000
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	4,648	16.040	74,553.920
SAFEWAY INC	11,400	23.550	268,470.000
STATE STREET CORP	8,943	40.310	360,492.330
STAPLES INC	14,700	18.610	273,567.000
SUNTRUST BANKS INC	6,948	29.370	204,062.760
CHARLES SCHWAB	22,300	16.550	369,065.000
BAXTER INTL INC	13,000	52.430	681,590.000
CONSTELLATION ENERGY	3,400	23.000	78,200.000
CAMPBELL SOUP CO	6,000	28.870	173,220.000
CHUBB CORP	8,300	49.300	409,190.000
CARDINAL HEALTH INC	7,400	32.900	243,460.000
FEDEX CORP	6,100	63.970	390,217.000
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	8,554	29.470	252,086.380
FLEXTRONICS INTL LTD	17,000	2.420	41,140.000
CITRIX SYSTEMS INC	3,500	24.740	86,590.000

INTEL CORP	124,600	15.260	1,901,396.000
CAMERON INTERNATIONAL COR	4,200	21.670	91,014.000
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	16,600	4.230	70,218.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS	7,400	17.520	129,648.000
IRON MOUNTAIN INC	3,450	19.840	68,448.000
ILLINOIS TOOL WORKS	8,500	33.040	280,840.000
ILLUMINA INC	2,800	23.640	66,192.000
CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,700	16.090	188,253.000
SUN MICROSYSTEMS INC	14,225	4.190	59,602.750
SEALED AIR CORP	3,000	14.940	44,820.000
INTUITIVE SURGICAL INC	900	132.080	118,872.000
SARA LEE CORP	18,700	9.630	180,081.000
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	7,500	15.180	113,850.000
COVANCE INC	1,700	42.780	72,726.000
CARMAX INC	7,700	8.060	62,062.000
COMERICA INC	4,900	19.150	93,835.000
UST INC	2,900	68.750	199,375.000
DUKE ENERGY CORP	26,292	14.610	384,126.120
TARGET CORP	15,500	35.730	553,815.000
DOVER CORP	3,800	31.340	119,092.000
RR DONNELLEY & SONS CO	4,300	12.970	55,771.000
WW GRAINGER INC	2,000	73.980	147,960.000
GANNETT CO	7,900	8.100	63,990.000
JACOBS ENGINEERING GROUP	4,000	50.100	200,400.000
JOHNSON CONTROLS INC	12,000	17.780	213,360.000
CINTAS CORP	4,600	25.700	118,220.000
CA INC	11,005	18.020	198,310.100
CONAGRA INC	9,400	16.250	152,750.000
CLOROX COMPANY	3,600	52.710	189,756.000
ENTERGY CORP	3,900	80.970	315,783.000
MICROSOFT CORP	173,200	19.660	3,405,112.000
IMS HEALTH INC	3,600	15.080	54,288.000
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,200	22.110	92,862.000
CVS CAREMARK CORP	34,174	26.510	905,952.740
MEDTRONIC INC	26,900	31.360	843,584.000
MILLIPORE CORP	1,900	50.180	95,342.000
MICRON TECH	16,900	2.170	36,673.000
CENTERPOINT ENERGY INC	10,700	12.510	133,857.000
HASBRO INC	2,900	28.960	83,984.000
KELLOGG CO	6,100	42.770	260,897.000
KEYCORP	8,400	8.330	69,972.000
KRAFT FOODS INC-A	30,211	27.020	816,301.220
KOHL'S CORP	6,400	37.470	239,808.000
SEARS HOLDING CORP	1,425	40.200	57,285.000
NEW YORK COMMUNITY BANCOR	7,000	12.360	86,520.000
APACHE CORP	7,610	74.020	563,292.200
ACE LTD	6,900	51.000	351,900.000
ARROW ELECTRONICS INC	2,600	17.740	46,124.000
ALLSTATE	10,800	29.810	321,948.000
EBAY INC	23,100	15.020	346,962.000
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1,400	31.350	43,890.000
XILINX INC	5,600	17.840	99,904.000
EXPRESS SCRIPTS INC CL-A	4,400	59.410	261,404.000
DISH NETWORK CORP	4,100	11.490	47,109.000
YAHOO! INC	27,100	13.110	355,281.000
ZION BANCORPORATION	3,300	26.390	87,087.000
ESTEE LAUDER COMPANIES-A	1,900	30.250	57,475.000

	TOLL BROTHERS INC	3,400	22.670	77,078.000	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	6,900	23.660	163,254.000	
	NOBLE CORP	5,500	25.240	138,820.000	
	PROGRESSIVE CORP	16,800	14.350	241,080.000	
	PRAXAIR INC	6,300	58.800	370,440.000	
	PACCAR INC	7,037	28.540	200,835.980	
	PETSMART INC	2,700	18.070	48,789.000	
	EL PASO CORPORATION	15,100	7.350	110,985.000	
	EMC CORP/MASS	51,900	10.990	570,381.000	
	PRIDE INTERNATIONAL INC	5,600	16.910	94,696.000	
	BIOGEN IDEC INC	6,530	47.650	311,154.500	
	INTL GAME TECHNOLOGY	6,200	12.000	74,400.000	
	DEAN FOODS CO	3,200	16.610	53,152.000	
	STARBUCKS CORP	13,100	9.830	128,773.000	
	INTUIT INC	5,800	23.190	134,502.000	
	AMYLIN PHARMACEUTICALS IN	2,700	11.380	30,726.000	
	BORG-WARNER AUTOMOTIVE	2,100	21.800	45,780.000	
	BEST BUY COMPANY INC	7,300	28.580	208,634.000	
	BALL CORP	3,100	41.760	129,456.000	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	27,847	7.770	216,371.190	
	BED BATH & BEYOND INC	4,900	25.710	125,979.000	
	XL CAPITAL LTD-CLASS A	5,600	3.560	19,936.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	6,600	17.220	113,652.000	
	VULCAN MATERIALS CO	2,200	67.790	149,138.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS IN	3,800	27.640	105,032.000	
	VF CORP	1,600	56.320	90,112.000	
	CBS CORP-CL B	11,071	7.750	85,800.250	
	VIACOM INC-CLASS B	11,971	17.400	208,295.400	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,200	39.780	47,736.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	2,600	35.460	92,196.000	
	CARNIVAL CORP	9,100	23.470	213,577.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	2,700	29.000	78,300.000	
	COMCAST CORP -CL A	47,970	16.340	783,829.800	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	19,400	15.650	303,610.000	
アメリカ・ドル 小計		株 6,704,008		アメリカ・ドル 182,116,343.980 (15,926,074,280)	
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	2.557	15,086.300	
	BP PLC	437,400	5.355	2,342,277.000	
	UNILEVER PLC	27,660	15.050	416,283.000	
	DRAX GROUP PLC	7,000	5.265	36,855.000	
	BARCLAYS PLC	206,300	1.450	299,135.000	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	37,900	3.245	122,985.500	
	TUI TRAVEL PLC	11,000	2.187	24,057.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	32,000	2.275	72,800.000	
	REXAM PLC	13,500	3.442	46,467.000	
	PRUDENTIAL PLC	51,100	3.700	189,070.000	
	LONMIN PLC	3,200	7.285	23,312.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	422,815	0.505	213,521.570	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,400	10.790	69,056.000	
	BAE SYSTEMS PLC	74,400	3.470	258,168.000	
	AVIVA PLC	55,700	4.010	223,357.000	
	EURASIAN NATURAL RESOURCE	6,200	3.330	20,646.000	
	CAIRN ENERGY PLC	4,400	19.160	84,304.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	121,102	12.000	1,453,224.000	

THOMSON REUTERS PLC	3,704	14.310	53,004.240
CABLE & WIRELESS	64,000	1.469	94,016.000
UNITED BUSINESS MEDIA LTD	6,695	4.725	31,633.870
REED ELSEVIER PLC	29,046	4.835	140,437.410
BG GROUP PLC	74,500	9.820	731,590.000
DIAGEO PLC	54,300	9.305	505,261.500
RIO TINTO PLC-REG	22,300	15.580	347,434.000
BRITISH AIRWAYS PLC	21,300	1.720	36,636.000
STANDARD CHARTERED PLC	44,300	7.610	337,123.000
TESCO PLC	186,000	3.305	614,730.000
LADBROKES PLC	16,835	1.840	30,976.400
SMITH & NEPHEW PLC	23,600	4.252	100,347.200
SMITHS GROUP PLC	8,433	8.960	75,559.680
PEARSON PLC	21,563	6.280	135,415.640
SAINSBURY (J) PLC	25,125	3.140	78,892.500
NEXT PLC	5,200	11.120	57,824.000
WHITBREAD PLC	6,111	9.185	56,129.530
IMI PLC	6,100	2.985	18,208.500
TOMKINS PLC	31,700	1.257	39,846.900
CADBURY PLC	28,956	5.560	160,995.360
BUNZL PLC	7,555	5.945	44,914.470
GKN PLC	13,200	0.850	11,220.000
VODAFONE GROUP PLC	1,229,737	1.287	1,582,671.510
BALFOUR BEATTY PLC	17,400	3.445	59,943.000
KINGFISHER PLC	49,011	1.401	68,664.410
WPP PLC	27,800	3.930	109,254.000
LOGICA PLC	53,340	0.602	32,110.680
UNITED UTILITIES GROUP PL	14,627	5.835	85,348.540
SEVERN TRENT PLC	7,533	11.210	84,444.930
RECKITT BENCKISER PLC	12,900	25.100	323,790.000
SCHROEDERS PLC	2,600	8.350	21,710.000
TATE&LYLE PLC	9,900	4.105	40,639.500
INTERNATIONAL POWER PLC	47,600	2.327	110,765.200
AMEC PLC	11,200	5.185	58,072.000
SCOTTISH & SOUTHERN ENERG	18,000	11.150	200,700.000
ASTRAZENECA PLC	30,500	26.220	799,710.000
WOLSELEY PLC	21,900	3.885	85,081.500
HAYS PLC	27,800	0.742	20,627.600
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	178,500	0.748	133,518.000
3I GROUP PLC	8,191	2.575	21,091.820
BRITISH SKY BROADCASTING	21,800	4.720	102,896.000
SAGE GROUP PLC (THE)	27,300	1.676	45,754.800
NATIONAL GRID PLC	50,228	6.550	328,993.400
LLOYDS TSB GROUP PLC	122,800	1.252	153,745.600
BRITISH ENERGY PLC	22,300	7.675	171,152.500
RSA INSURANCE GROUP PLC	88,900	1.377	122,415.300
IMPERIAL TOBACCO GROUP	25,300	16.440	415,932.000
CENTRICA PLC	120,460	2.410	290,308.600
BERKELEY GROUP HOLDINGS-U	1,600	9.035	14,456.000
BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	36,260	16.280	590,312.800
NATIONAL EXPRESS GROUP PL	2,700	4.592	12,398.400
ICAP PLC	9,900	2.832	28,036.800
SABMILLER PLC	19,400	11.490	222,906.000
BHP BILLITON PLC	47,077	12.980	611,059.460
DAILY MAIL&GENERAL TST-A	10,400	2.630	27,352.000
STAGECOACH HOLDINGS PLC	11,700	1.290	15,093.000
HSBC HOLDINGS PLC	275,400	6.720	1,850,688.000

	SHIRE PLC	14,600	9.375	136,875.000	
	OLD MUTUAL PLC	101,000	0.513	51,813.000	
	ANGLO AMERICAN PLC	29,583	16.500	488,119.500	
	MORRISON SUPERMARKETS	63,100	2.680	169,108.000	
	CARNIVAL PLC	4,461	14.460	64,506.060	
	FIRSTGROUP PLC	9,200	3.922	36,082.400	
	COMPASS GROUP PLC	37,800	3.390	128,142.000	
	FRIENDS PROVIDENT PLC	48,900	0.806	39,413.400	
	HBOS PLC	90,918	0.678	61,642.400	
	BT GROUP PLC	199,600	1.411	281,635.600	
	MAN GROUP PLC	37,325	2.367	88,348.270	
	XSTRATA PLC	13,200	7.135	94,182.000	
	BURBERRY GROUP PLC	15,389	2.217	34,117.410	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	5,400	5.700	30,780.000	
	CAPITA GROUP PLC	12,690	7.230	91,748.700	
	SERCO GROUP PLC	10,600	4.307	45,654.200	
	ITV PLC	69,384	0.372	25,810.840	
	TULLOW OIL PLC	19,700	6.340	124,898.000	
	VEDANTA RESOURCES PLC	3,600	6.855	24,678.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,349	5.785	25,158.960	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	77,300	18.040	1,394,492.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	61,281	17.390	1,065,676.590	
	MEGGITT PLC	12,500	1.610	20,125.000	
	G4S PLC	26,100	2.005	52,330.500	
	COBHAM PLC	38,200	2.007	76,667.400	
	INVESTEC PLC	12,500	2.600	32,500.000	
	CARPHONE WAREHOUSE GROUP	15,300	0.880	13,464.000	
	ANTOFAGASTA PLC	13,900	4.470	62,133.000	
	STANDARD LIFE PLC	44,400	2.600	115,440.000	
	EXPERIAN PLC	27,154	4.245	115,268.730	
	HOME RETAIL GROUP	29,454	2.242	66,035.860	
イギリス・ポンド 小計		株 6,035,452		イギリス・ポンド 23,511,290.740 (3,193,538,621)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP BILLITON LTD	76,900	30.950	2,380,055.000	
	LEND LEASE	12,900	7.100	91,590.000	
	ASCIANO GROUP	13,600	1.370	18,632.000	
	ALUMINA LTD	37,600	1.400	52,640.000	
	WOODSIDE PETROLEUM	11,500	36.000	414,000.000	
	OZ MINERALS LTD	60,579	0.550	33,318.450	
	FORTESCUE METALS GROUP	30,900	2.470	76,323.000	
	CSR LIMITED	28,700	1.560	44,772.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	6,300	10.920	68,796.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	46,000	19.320	888,720.000	
	WESTPAC BANKING	62,298	15.720	979,324.560	
	SANTOS LIMITED	12,900	14.650	188,985.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	51,400	13.700	704,180.000	
	RIO TINTO LTD	5,300	40.320	213,696.000	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	20,500	16.380	335,790.000	
	AMCOR	24,100	5.800	139,780.000	
	FOSTER'S GROUP LTD	41,100	5.340	219,474.000	
	NEWCREST MINING	13,700	29.550	404,835.000	
	INCITEC PIVOT LTD	45,600	2.500	114,000.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	26,400	29.150	769,560.000	
	ORICA LIMITED	9,200	16.390	150,788.000	

	QBE INSURANCE	22,900	25.300	579,370.000	
	LEIGHTON HOLDINGS	3,100	26.410	81,871.000	
	WOOLWORTHS	25,300	25.750	651,475.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	13,300	8.400	111,720.000	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	11,500	6.230	71,645.000	
	CROWN LTD	10,800	5.140	55,512.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	18,300	2.260	41,358.000	
	TELSTRA CORPORATION	103,700	3.560	369,172.000	
	AMP LIMITED	34,600	5.290	183,034.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES N	15,900	3.850	61,215.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	8,800	27.430	241,384.000	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,800	3.760	25,568.000	
	FAIRFAX MEDIA LTD	28,500	1.520	43,320.000	
	CSL LIMITED	14,000	30.200	422,800.000	
	ONESTEEL LIMITED	16,600	2.260	37,516.000	
	WESFARMERS LIMITED	15,400	16.660	256,564.000	
	WESFARMERS LTD-PPS	4,400	16.650	73,260.000	
	COCHLEAR LIMITED	1,300	50.560	65,728.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	16,900	3.090	52,221.000	
	SUNCORP-METWAY LIMITED	30,200	7.230	218,346.000	
	BORAL LIMITED	13,000	4.090	53,170.000	
	ASX LTD	4,100	31.850	130,585.000	
	COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	6.920	96,188.000	
	MACQUARIE INFRASTRUCTURE	68,000	1.600	108,800.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	38,300	4.000	153,200.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	10,100	12.900	130,290.000	
	TRANSURBAN GROUP	24,400	5.000	122,000.000	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	14,300	5.900	84,370.000	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	5,400	15.890	85,806.000	
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	18,700	4.450	83,215.000	
	WORLEYPARSONS LTD	3,300	14.650	48,345.000	
	PERPETUAL LTD	800	31.200	24,960.000	
	TATTS GROUP LTD	25,700	2.680	68,876.000	
	AGL ENERGY LTD	14,500	14.950	216,775.000	
	BRAMBLES LTD	28,400	7.260	206,184.000	
オーストラリア・ドル 小計		株 1,322,677		オーストラリア・ドル 13,545,102.010 (835,732,794)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,900	42.750	337,725.000	
	SINO-FOREST CORPORATION	3,400	9.050	30,770.000	
	SILVER WHEATON CORP	4,400	7.750	34,100.000	
	BCE INC	3,230	21.700	70,091.000	
	ADDAX PETROLEUM CORP	3,000	18.600	55,800.000	
	SUNCOR ENERGY INC	23,500	26.710	627,685.000	
	METRO INC-A	2,500	36.690	91,725.000	
	SHERITT INTERNATIONAL CO	6,200	3.230	20,026.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,800	27.760	133,248.000	
	GROUPE AEROPLAN INC	4,800	7.050	33,840.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	24,300	29.800	724,140.000	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	8,100	48.950	396,495.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	19,400	40.730	790,162.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,100	20.650	167,265.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	29,600	34.660	1,025,936.000	
	TRANSCANADA CORP	14,900	32.820	489,018.000	
	BOMBARDIER INC 'B'	44,500	4.290	190,905.000	

BARRICK GOLD CORP	22,200	42.760	949,272.000
CAE INC	9,200	7.350	67,620.000
THOMSON REUTERS CORP	7,000	32.550	227,850.000
POTASH CORP OF SASKATCHEW	6,600	94.810	625,746.000
INMET MINING CRP	1,600	19.330	30,928.000
PETRO-CANADA	11,100	29.280	325,008.000
LOBLAW COMPANIES LTD	2,600	35.400	92,040.000
ROGERS COMMUNICATIONS-B	11,000	32.900	361,900.000
NOVA CHEMICALS CORP	3,000	6.500	19,500.000
AGNICO-EAGLE MINES	4,700	57.160	268,652.000
KINROSS GOLD CORP	14,300	22.250	318,175.000
BANK OF MONTREAL	11,000	30.140	331,540.000
POWER CORP OF CANADA	9,300	20.680	192,324.000
METHANEX CORP	3,300	13.480	44,484.000
CAMECO CORP	10,500	22.150	232,575.000
TELUS CORP	900	33.500	30,150.000
POWER FINANCIAL CORP	5,200	21.650	112,580.000
TECK COMINCO LIMITED-CL B	8,500	6.050	51,425.000
NEXEN INC	11,100	22.380	248,418.000
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,800	40.320	72,576.000
TALISMAN ENERGY INC	26,800	12.280	329,104.000
IVANHOE MINES LTD	9,100	2.950	26,845.000
AGRIUM INC	4,000	42.130	168,520.000
CANADIAN NATURAL RESOURCE	11,600	48.490	562,484.000
GERDAU AMERISTEEL CORP	3,400	7.340	24,956.000
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS L	400	360.240	144,096.000
MAGNA INTERNATIONAL INC-A	3,600	35.700	128,520.000
TRANSALTA CORP	5,000	22.900	114,500.000
WESTON (GEORGE) LTD	1,400	58.490	81,886.000
MDS INC	3,600	7.300	26,280.000
PAN AMERICAN SILVER CORP	1,700	21.250	36,125.000
RESEARCH IN MOTION	10,800	49.350	532,980.000
SUN LIFE FINANCIAL SVSC	13,700	24.500	335,650.000
ENBRIDGE INC	8,000	39.860	318,880.000
BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	12,400	17.000	210,800.000
BROOKFIELD PROPERTIES COR	4,950	7.950	39,352.500
MANULIFE FINANCIAL CORP	29,600	20.600	609,760.000
BIOVAIL CORPORATION	5,200	11.220	58,344.000
GOLDCORP INC	15,159	39.350	596,506.650
ENCANA CORP	16,000	57.080	913,280.000
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	4,500	42.290	190,305.000
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,500	11.620	29,050.000
CANADIAN NATL RAILWAY CO	11,400	44.240	504,336.000
CGI GROUP INC - CL A	6,200	8.950	55,490.000
HUSKY ENERGY INC	5,700	30.900	176,130.000
ONEX CORPORATION	3,500	15.500	54,250.000
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,600	21.000	222,600.000
TELUS CORPORATION-NON VOT	3,200	29.720	95,104.000
FINNING INTERNATIONAL INC	4,000	12.150	48,600.000
SHOPPERS DRUG MART CORP	5,500	44.530	244,915.000
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	37.950	170,775.000
ELDORADO GOLD CORPORATION	12,400	9.400	116,560.000
IGM FINANCIAL INC	2,800	29.500	82,600.000
TMX GROUP INC	1,800	24.600	44,280.000
SAPUTO INC	4,800	21.290	102,192.000
FIRST QUANTUM MINERALS LT	1,500	18.250	27,375.000
ALIMENTATION COUCHE-TARD	4,700	13.300	62,510.000

	ENSIGN ENERGY SERVICES IN	4,400	12.110	53,284.000	
	TRICAN WELL SERVICE LTD	4,500	7.280	32,760.000	
	YAMANA GOLD INC	22,600	8.680	196,168.000	
	FORTIS INC	3,900	25.100	97,890.000	
	NIKO RESOURCES LTD	1,200	48.120	57,744.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	2,500	26.400	66,000.000	
カナダ・ドル 小計		株 682,639		カナダ・ドル 17,811,481.150 (1,306,294,028)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK	30,000	13.200	396,000.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	25,000	9.720	243,000.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	11.120	183,146.400	
	FRASER & NEAVE LTD	33,000	2.840	93,720.000	
	KEPPEL CORP	29,000	4.480	129,920.000	
	UOL GROUP LIMITED	19,400	1.990	38,606.000	
	CITY DEVELOPMENT	17,000	6.390	108,630.000	
	CAPITALAND LIMITED	51,000	2.830	144,330.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	49,000	3.150	154,350.000	
	O.C.B.C.	52,000	5.120	266,240.000	
	SINGAPORE TELECOM	189,450	2.650	502,042.500	
	SINGAP. TECH ENGINEERING	30,000	2.300	69,000.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	25,000	2.450	61,250.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	110,000	0.235	25,850.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	5.300	106,000.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	20,000	0.980	19,600.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	18,000	2.970	53,460.000	
シンガポール・ドル 小計		株 734,320		シンガポール・ドル 2,595,144.900 (157,966,470)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ADECCO SA-REG	3,950	37.020	146,229.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	16,150	160.200	2,587,230.000	
	ABB LTD	49,850	16.200	807,570.000	
	ARYZTA AG	1,800	35.000	63,000.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	83,000	40.780	3,384,740.000	
	OC OERLIKON CORP AG-REG	150	76.600	11,490.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,250	48.750	60,937.500	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	26,300	29.060	764,278.000	
	JULIUS BAER HOLDING AG	4,750	41.000	194,750.000	
	SULZER AG-REG	600	58.500	35,100.000	
	SGS SA	150	1,076.000	161,400.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	950	148.800	141,360.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	3,332	237.200	790,350.400	
	BALOISE HOLDING -R	1,600	80.000	128,000.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	51,600	53.150	2,742,540.000	
	SWISS RE-REG	7,600	49.740	378,024.000	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	9,750	21.580	210,405.000	
	UBS AG-REGISTERED	71,400	14.570	1,040,298.000	
	SWISSCOM AG-REG	670	335.750	224,952.500	
	GEBERIT AG-REG	900	114.800	103,320.000	
	GIVAUDAN REG	190	871.000	165,490.000	
	ACTELION LTD-REG	2,100	59.100	124,110.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	200	178.000	35,600.000	
	SYNGENTA AG	2,262	215.100	486,556.200	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,050	63.950	67,147.500	

	LOGITECH INTL-REG	3,650	15.290	55,808.500	
	SYNTHES INC	1,300	135.500	176,150.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,350	94.500	127,575.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	29.250	43,875.000	
	HOLCIM LTD-REG	4,500	61.350	276,075.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	750	69.750	52,312.500	
	NOBEL BIO CARE HOLDING AG	2,750	21.000	57,750.000	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,200	67.650	81,180.000	
スイス・フラン 小計		株 358,554		スイス・フラン 15,725,604.100 (1,282,423,014)	
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	74,780	59.800	4,471,844.000	
	VOLVO AB-B SHS	20,950	41.800	875,710.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	1,600	338.500	541,600.000	
	S.K.F. AB-B SHS	11,400	71.250	812,250.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,400	70.000	448,000.000	
	NORDEA AB	38,600	57.600	2,223,360.000	
	SCANIA AB-B SHS	7,700	69.500	535,150.000	
	SWEDISH MATCH AB	5,200	110.250	573,300.000	
	TELE2 AB-B SHS	6,650	67.250	447,212.500	
	GETINGE AB-B SHS	6,200	98.500	610,700.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	9,900	56.750	561,825.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	10,200	128.500	1,310,700.000	
	SWEDBANK AB	7,400	47.400	350,760.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B	11,500	303.500	3,490,250.000	
	SVENSKA CELLULOSEA AB-B	12,500	65.500	818,750.000	
	SKANSKA AB-B	9,000	74.250	668,250.000	
	SANDVIK AB	30,500	48.800	1,488,400.000	
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	121.250	1,491,375.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	14,600	64.750	945,350.000	
	SECURITAS AB-B SHS	6,400	65.250	417,600.000	
	TELIASONERA AB	54,000	39.600	2,138,400.000	
	ALFA LAVAL AB	9,000	66.000	594,000.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,200	58.500	538,200.000	
	ASSA ABLOY AB-B	7,600	91.250	693,500.000	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,100	158.000	173,800.000	
	SSAB SVENSKT STAL AB-SR A	6,100	66.250	404,125.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,000	43.600	218,000.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,700	48.800	278,160.000	
スウェーデン・クローナ 小計		株 401,480		スウェーデン・クローナ 28,120,571.500 (322,261,750)	
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	8,350	278.500	2,325,475.000	
	DANSKE BANK A/S	12,300	57.000	701,100.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	19	29,800.000	566,200.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	3,950	282.000	1,113,900.000	
	CARLSBERG AS-B	1,700	185.500	315,350.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,600	416.500	666,400.000	
	COLOPLAST-B	550	367.000	201,850.000	
	DANISCO A/S	1,150	231.750	266,512.500	
	DSV A/S	4,000	55.250	221,000.000	
	FLSMIDTH & CO A/S	1,350	167.250	225,787.500	
	TOPDANMARK A/S	350	707.000	247,450.000	

	WILLIAM DEMANT HOLDING	525	233.000	122,325.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	25	29,600.000	740,000.000	
	JYSKE BANK-REG	1,050	115.250	121,012.500	
デンマーク・クローネ 小計		株 36,919		デンマーク・クローネ 7,834,362.500 (132,635,758)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	TELECOM CORP OF NZ	58,589	2.350	137,684.150	
	FLETCHER BUILDING LTD	16,800	6.070	101,976.000	
ニュージーランド・ドル 小計		株 75,389		ニュージーランド・ドル 239,660.150 (12,445,551)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	21,750	27.000	587,250.000	
	DNB NOR ASA	20,200	27.000	545,400.000	
	ORKLA ASA	16,550	42.250	699,237.500	
	TELENOR ASA	26,500	43.700	1,158,050.000	
	STATOILHYDRO ASA	25,073	114.500	2,870,858.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,710	140.250	520,327.500	
	SEADRILL LTD	9,650	58.900	568,385.000	
	AKER SOLUTIONS ASA	4,300	42.800	184,040.000	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	3,900	58.900	229,710.000	
ノルウェー・クローネ 小計		株 131,633		ノルウェー・クローネ 7,363,258.500 (98,078,603)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG	18,400	40.040	736,736.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	13,650	25.530	348,484.500	
	COMMERZBANK AG	15,050	6.085	91,579.250	
	VOLKSWAGEN AG	3,050	308.060	939,583.000	
	VOLKSWAGEN AG PFD	2,250	35.980	80,955.000	
	TUI AG	4,950	7.710	38,164.500	
	M.A.N.	2,300	34.530	79,419.000	
	SIEMENS AG	19,500	49.160	958,620.000	
	E.ON AG	41,000	26.750	1,096,750.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	7,700	22.070	169,939.000	
	GEA GROUP AG	3,400	12.180	41,412.000	
	BASF SE	23,350	26.420	616,907.000	
	LINDE	2,900	56.980	165,242.000	
	K+S AG	3,250	38.230	124,247.500	
	ALLIANZ SE-REG	10,300	72.570	747,471.000	
	THYSSENKRUPP AG	7,800	17.230	134,394.000	
	HENKEL AG & CO KGAA	3,900	21.850	85,215.000	
	R.W.E. AG	10,700	63.070	674,849.000	
	LUFTHANSA	6,750	10.580	71,415.000	
	FRESENIUS SE	850	33.620	28,577.000	
	HOCHTIEF AG	900	32.830	29,547.000	
	SAP AG	17,542	24.250	425,393.500	
	MUNCHENER RUECK AG-REG	4,250	112.000	476,000.000	
	HEIDELBERGCEMENT AG	550	30.000	16,500.000	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	1,800	48.380	87,084.000	
	BEIERSDORF AG	1,900	40.570	77,083.000	
	CELESIO AG	2,800	17.010	47,628.000	
	MERCK KGAA	1,350	58.900	79,515.000	
	ADIDAS-SALOMON AG	4,520	26.640	120,412.800	

FRESENIUS SE-PFD	1,900	39.500	75,050.000
PUMA AG	230	135.050	31,061.500
HENKEL KGAA	3,750	18.750	70,312.500
METRO AG	2,500	28.600	71,500.000
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	59,900	11.045	661,595.500
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	3,950	33.050	130,547.500
DAIMLER AG	18,450	25.000	461,250.000
INFINEON TECHNOLOGIES AG	16,400	0.660	10,824.000
DEUTSCHE POST AG	17,900	11.155	199,674.500
DEUTSCHE BOERSE AG	4,250	56.000	238,000.000
RWE AG-NON VTG PFD	1,150	48.830	56,154.500
HYPO REAL ESTATE HOLDING	3,782	3.000	11,346.000
DEUTSCHE POSTBANK AG	1,500	12.940	19,410.000
SALZGITTER AG	800	50.860	40,688.000
SOLARWORLD AG	1,750	13.430	23,502.500
Q-CELLS SE	2,150	19.630	42,204.500
WACKER CHEMIE AG	400	71.060	28,424.000
PHILIPS ELECTRONICS NV	21,326	13.930	297,071.180
UNILEVER NV-CVA	38,750	17.370	673,087.500
HEINEKEN NV	4,950	21.330	105,583.500
REED ELSEVIER NV	13,977	8.230	115,030.710
AEGON NV	30,044	4.743	142,498.690
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	28,960	8.939	258,873.440
AKZO NOBEL	5,800	28.940	167,852.000
KONINKLIJKE DSM NV	3,450	18.500	63,825.000
WOLTERS KLUWER	6,550	13.580	88,949.000
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	1,250	15.800	19,750.000
ING GROEP N.V.	40,550	6.962	282,309.100
KONINKLIJKE KPN NV	41,550	10.410	432,535.500
ASML HOLDING NV	11,288	11.975	135,173.800
TNT NV	8,250	13.480	111,210.000
RANDSTAD HOLDING NV	1,800	14.310	25,758.000
SBM OFFSHORE NV	3,700	10.005	37,018.500
FUGRO NV-CVA	1,550	21.845	33,859.750
TOTAL SA	46,050	41.500	1,911,075.000
MICHELIN (CGDE) - B	3,900	38.070	148,473.000
AIR LIQUIDE	5,188	64.710	335,715.480
PPR	2,350	46.045	108,205.750
SCHNEIDER ELECTRIC SA	5,150	54.800	282,220.000
BOUYGUES	5,150	30.935	159,315.250
LAFARGE SA	3,150	45.000	141,750.000
BNP PARIBAS	17,300	34.220	592,006.000
PEUGEOT SA	4,900	12.015	58,873.500
NATIXIS	34,600	1.260	43,596.000
THALES SA	2,250	28.850	64,912.500
GROUPE DANONE	9,300	42.825	398,272.500
CARREFOUR	13,450	29.290	393,950.500
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	5,475	12.035	65,891.620
VIVENDI SA	29,000	23.295	675,555.000
L'OREAL	5,150	61.730	317,909.500
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	7,500	34.295	257,212.500
ALCATEL-LUCENT	49,300	1.617	79,718.100
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,000	49.240	49,240.000
PERNOD-RICARD	3,710	51.150	189,766.500
EURAZEO	750	34.945	26,208.750
SOCIETE GENERALE-A	10,500	34.810	365,505.000
LVMH	5,350	46.900	250,915.000

ACCOR SA	4,400	34.635	152,394.000
CAP GEMINI SA	4,400	26.015	114,466.000
VALEO	1,650	10.530	17,374.500
PUBLICIS GROUPE	4,700	18.745	88,101.500
VALLOUREC	1,250	83.495	104,368.750
BUREAU VERITAS SA	850	28.570	24,284.500
EIFFAGE	1,300	35.120	45,656.000
SODEXO	2,100	39.270	82,467.000
ZODIAC SA	950	26.775	25,436.250
ESSILOR INTERNATIONAL	5,450	32.065	174,754.250
AXA	38,350	15.420	591,357.000
TELEVISION FRANCAISE	4,200	10.910	45,822.000
LAGARDERE S.C.A.	3,800	27.890	105,982.000
TECHNIP S.A.	3,350	22.405	75,056.750
RENAULT	4,000	17.340	69,360.000
HERMES INTERNATIONAL	1,450	106.850	154,932.500
ERAMET	200	135.110	27,022.000
STMICROELECTRONICS NV	21,650	4.820	104,353.000
ATOS ORIGIN	2,500	17.670	44,175.000
DASSAULT SYSTEMS SA	2,150	29.985	64,467.750
WENDEL	700	35.145	24,601.500
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ	4,650	11.495	53,451.750
FRANCE TELECOM SA	39,050	19.750	771,237.500
ALSTOM RGPT	4,550	44.760	203,658.000
CNP ASSURANCES	800	54.075	43,260.000
AIR FRANCE-KLM	2,950	9.740	28,733.000
NEOPOST SA	1,000	65.980	65,980.000
SANOFI-AVENTIS	23,075	45.600	1,052,220.000
VINCI	10,800	30.400	328,320.000
EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	8,650	11.020	95,323.000
VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,750	20.200	176,750.000
CREDIT AGRICOLE SA	18,400	8.340	153,456.000
GDF SUEZ	23,223	31.680	735,704.640
IMERYS SA	650	31.000	20,150.000
PAGESJAUNES GROUPE SA	2,500	7.220	18,050.000
ELECTRICITE DE FRANCE	4,200	42.255	177,471.000
SES	6,050	14.150	85,607.500
SAFRAN SA	4,300	9.499	40,845.700
ADP	700	47.765	33,435.500
ARCELORMITTAL	17,400	18.000	313,200.000
SCOR SE	5,900	15.500	91,450.000
UCB SA	3,350	23.840	79,864.000
KBC GROUPE	4,600	24.870	114,402.000
DELHAIZE GROUP	2,400	44.540	106,896.000
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	2,450	58.365	142,994.250
SOLVAY SA	1,750	54.200	94,850.000
UMICORE	4,250	14.175	60,243.750
DEXIA	17,350	2.893	50,193.550
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	4,300	14.775	63,532.500
FORTIS	42,400	0.960	40,704.000
BELGACOM SA	4,900	26.580	130,242.000
MOBISTAR SA	1,050	52.360	54,978.000
FONDIARIA-SAI SPA	2,500	13.130	32,825.000
BANCO POPOLARE SCARL	13,300	5.055	67,231.500
FIAT SPA	15,800	5.040	79,632.000
PARMALAT SPA	38,950	1.225	47,713.750
PRYSMIAN SPA	2,550	8.750	22,312.500

ASSICURAZIONI GENERALI	21,645	19.620	424,674.900
SAIPEM	5,800	12.460	72,268.000
MEDIOBANCA SPA	10,850	7.535	81,754.750
TENARIS SA	10,200	7.620	77,724.000
UNICREDIT SPA	260,696	1.565	407,989.240
UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO	20,700	1.056	21,859.200
ALLEANZA ASSICURAZIONI	10,400	5.745	59,748.000
TELECOM ITALIA SPA	211,082	1.077	227,335.310
TELECOM ITALIA-RNC	129,850	0.760	98,686.000
ITALCEMENTI SPA	2,200	8.720	19,184.000
INTESA SANPAOLO-RNC	21,350	1.620	34,587.000
INTESA SANPAOLO	162,547	2.305	374,670.830
ATLANTIA SPA	8,300	12.960	107,568.000
BANCA POPOLARE DI MILANO	13,850	4.170	57,754.500
ENI SPA	59,950	18.220	1,092,289.000
MEDIASET SPA	18,200	3.952	71,926.400
FINMECCANICA SPA	11,225	10.770	120,893.250
MONTE DEI PASCHI SIENA	77,300	1.494	115,486.200
ENEL SPA	108,500	4.400	477,400.000
SNAM RETE GAS	16,550	3.730	61,731.500
LUXOTTICA GROUP SPA	3,750	13.570	50,887.500
UNIONE DI BANCHE ITALIANE	13,750	11.290	155,237.500
LOTTOMATICA SPA	1,350	18.150	24,502.500
TERNA SPA	39,000	2.125	82,875.000
PIRELLI & C.	54,300	0.264	14,335.200
UNIPOL GRUPPO FINAN PR	19,900	0.730	14,527.000
TELEFONICA S.A.	102,827	16.350	1,681,221.450
BANCO POPULAR ESPANOL	23,600	6.150	145,140.000
BANCO BILIBAO VIZCAYA	68,500	8.610	589,785.000
ACERINOX SA	4,900	12.050	59,045.000
IBERDROLA SA	81,100	5.940	481,734.000
BANCO DE SABADELL SA	22,250	5.230	116,367.500
BANKINTER SA	8,850	6.520	57,702.000
REPSOL YPF SA	15,450	15.080	232,986.000
GRIFOLS SA	2,900	12.090	35,061.000
BANCO SANTANDER SA	177,850	6.700	1,191,595.000
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	6,400	13.370	85,568.000
GAS NATURAL SDG SA	3,550	19.490	69,189.500
MAPFRE SA	17,100	2.530	43,263.000
CRITERIA CAIXACORP SA	19,400	2.840	55,096.000
ZARDOYA OTIS SA	3,050	13.500	41,175.000
UNION FENOSA S.A.	9,800	17.560	172,088.000
SACYR VALLEHERMOSO SA	1,650	6.660	10,989.000
FOMENTO DE CONSTRUC Y CO	1,300	24.440	31,772.000
ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	4,726	32.360	152,933.360
ACCIONA SA	600	86.850	52,110.000
INDRA SISTEMAS SA	2,400	15.850	38,040.000
GRUPO FERROVIAL	1,400	21.210	29,694.000
INDITEX	4,550	31.360	142,688.000
GAMESA CORP TECNOLOGICA	3,600	13.360	48,096.000
ENAGAS	4,300	14.750	63,425.000
RED ELECTRICA DE ESPANA	2,200	35.500	78,100.000
GESTVISION TELECINCO SA	3,500	8.040	28,140.000
CINTRA CONCESIONES DE INF	5,550	5.990	33,244.500
UPM-KYMMENE OYJ	15,450	8.570	132,406.500
NOKIA OYJ	84,750	11.360	962,760.000
WARTSILA OYJ	1,850	19.570	36,204.500

	RAUTARUUKKI OYJ	1,900	12.000	22,800.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	14,250	5.330	75,952.500	
	METSO OYJ	4,450	8.760	38,982.000	
	ELISA OYJ-A SHARES	3,550	12.010	42,635.500	
	SAMPO OYJ-A SHS	9,350	13.080	122,298.000	
	FORTUM OYJ	9,100	14.390	130,949.000	
	KESKO OYJ-B SHS	1,300	16.160	21,008.000	
	KONE OYJ-B	3,400	14.430	49,062.000	
	OUTOKUMPU OYJ	2,700	7.930	21,411.000	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	3,800	7.530	28,614.000	
	NESTE OIL OYJ	3,100	10.290	31,899.000	
	WIENERBERGER AG	1,500	11.450	17,175.000	
	OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	1,700	31.000	52,700.000	
	OMV AG	3,350	20.390	68,306.500	
	ERSTE GROUP BANK AG	5,950	13.500	80,325.000	
	TELEKOM AUSTRIA AG	7,300	10.490	76,577.000	
	VOESTALPINE AG	2,450	16.020	39,249.000	
	STRABAG SE-BR	1,900	16.890	32,091.000	
	RAIFFEISEN INTL BANK HOLD	1,900	20.000	38,000.000	
	MARFIN INVESTMENT GROUP S	12,000	2.890	34,680.000	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA	13,200	6.280	82,896.000	
	BRISA	7,200	5.430	39,096.000	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	38,000	2.550	96,900.000	
	ZON MULTIMEDIA SERVICOS D	4,436	3.680	16,324.480	
	BANCO COMERCIAL PORTUGUES	52,900	0.804	42,531.600	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGAN	5,500	12.580	69,190.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	10,713	12.240	131,127.120	
	ELAN CORPORATION PLC	6,500	4.740	30,810.000	
	KERRY GROUP PLC-A	4,600	14.000	64,400.000	
	CRH PLC	12,500	20.770	259,625.000	
	BANK OF IRELAND	27,200	0.864	23,500.800	
	ALLIED IRISH BANKS PLC	27,800	1.840	51,152.000	
	ANGLO IRISH BANK CORP PLC	21,500	0.390	8,385.000	
	PUBLIC POWER CORP	2,400	13.140	31,536.000	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	5,450	6.200	33,790.000	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	1,300	13.460	17,498.000	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLI	4,800	10.700	51,360.000	
	EFG EUROBANK ERGASIAS	6,428	5.440	34,968.320	
	OPAP SA	4,500	19.940	89,730.000	
	PIRAEUS BANK S.A.	6,650	5.760	38,304.000	
	ALPHA BANK A.E.	8,051	5.600	45,085.600	
ユーロ 小計		株 3,755,716		ユーロ 42,009,130.320 (5,296,931,242)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	HONGKONG ELECTRIC	32,500	42.100	1,368,250.000	
	MTR CORP	31,500	18.900	595,350.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	37,000	68.700	2,541,900.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	15,000	23.150	347,250.000	
	SINO LAND	60,000	8.100	486,000.000	
	CHEUNG KONG	36,000	80.500	2,898,000.000	
	WHARF HOLDINGS	36,000	20.000	720,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	20,000	57.500	1,150,000.000	
	KINGBOARD CHEMICALS HLDGS	12,500	11.400	142,500.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	47,000	50.250	2,361,750.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	8.320	341,120.000	

HUTCHISON WHAMPOA	46,300	41.500	1,921,450.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMNT	24,000	33.050	793,200.000	
HK & CHINA GAS	84,960	12.480	1,060,300.800	
HANG SENG BANK	20,200	105.000	2,121,000.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	64,000	7.560	483,840.000	
MONGOLIA ENERGY CO LTD	59,000	2.520	148,680.000	
WING HANG BANK LIMITED	4,500	50.000	225,000.000	
HONG KONG EX & CL	26,900	78.200	2,103,580.000	
LI & FUNG LTD	65,000	15.400	1,001,000.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	18.100	832,600.000	
KERRY PROPERTIES LTD	15,500	17.200	266,600.000	
BANK OF EAST ASIA	46,400	17.200	798,080.000	
PCCW LTD	86,336	3.500	302,176.000	
FOXCONN INTERNATIONAL HLD	56,000	2.680	150,080.000	
SHANGRI-LA ASIA	42,000	8.700	365,400.000	
HUTCHISON TELECOMMUNICATI	37,000	2.170	80,290.000	
PACIFIC BASIN SHIPPING LT	36,000	4.340	156,240.000	
BANK OF CHINA HONG KONG	100,500	8.660	870,330.000	
ESPRIT HOLDINGS LTD	23,800	44.000	1,047,200.000	
香港・ドル 小計	株 1,252,896		香港・ドル 27,679,166.800 (312,221,001)	
合計	株 21,491,683		28,876,603,112 [28,876,603,112]	

[次へ](#)

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,500.000	102,180.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	5,000.000	282,800.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,300.000	139,173.000	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	2,109.000	29,715.810	
		VORNADO REALTY TRUST	2,700.000	173,016.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	5,000.000	166,450.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	11,250.000	92,250.000	
		KIMCO REALTY CORP	7,100.000	133,906.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	5,100.000	184,212.000	
		VENTAS INC	2,800.000	84,280.000	
		AMB PROPERTY CORP	2,400.000	54,168.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,100.000	35,101.000	
		DEVELOPERS DIV REALTY	2,800.000	13,328.000	
		DUKE REALTY CORP	5,200.000	60,736.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,000.000	131,800.000	
		HCP INC	7,200.000	197,784.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	1,900.000	46,322.000	
		MACERICH CO/THE	1,500.000	29,325.000	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	14,300.000	227,227.000	
		PROLOGIS	5,100.000	41,820.000	
		PUBLIC STORAGE	3,100.000	238,669.000	
		REGENCY CENTERS CORP	1,300.000	57,941.000	
		SL GREEN REALTY CORP	1,200.000	31,512.000	
		UDR INC	4,600.000	71,990.000	
	アメリカ・ドル 小計		98,559.000	アメリカ・ドル 2,625,705.810 (229,617,973)	
	イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
		LAND SECURITIES PLC	11,400.000	102,714.000	
		SEGRO	9,507.000	23,025.950	
		HAMMERSON PLC	6,600.000	35,277.000	
		BRITISH LAND CO PLC	16,100.000	86,215.500	
		LIBERTY INTERNATIONAL PLC	8,600.000	43,344.000	
	イギリス・ポンド 小計		52,207.000	イギリス・ポンド 290,576.450 (39,469,000)	
	オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST	51,200.000	92,672.000	
		DEXUS PROPERTY GROUP	66,600.000	56,943.000	
		GPT GROUP	95,500.000	86,427.500	
		MIRVAC GROUP	43,800.000	52,779.000	
		STOCKLAND	41,600.000	146,848.000	
		WESTFIELD GROUP	33,096.000	431,902.800	
		GOODMAN GROUP	69,300.000	41,926.500	
	オーストラリア・ドル 小計		401,096.000	オーストラリア・ドル 909,498.800 (56,116,076)	
	シンガポール・ドル	CAPITAMALL TRUST	39,000.000	シンガポール・ドル 64,350.000	
	シンガポール・ドル 小計		39,000.000	シンガポール・ドル 64,350.000 (3,916,984)	

ユーロ	CORIO NV	1,000.000	ユーロ 32,605.000	
	ICADE	600.000	34,800.000	
	UNIBAIL-RODAMCO	2,150.000	224,675.000	
	KLEPIERRE	1,950.000	34,125.000	
	ユーロ 小計	5,700.000	ユーロ 326,205.000 (41,131,189)	
香港・ドル	LINK REIT	56,000.000	香港・ドル 767,200.000	
香港・ドル 小計		56,000.000	香港・ドル 767,200.000 (8,654,016)	
投資証券 合計			378,905,238 [378,905,238]	
合計			378,905,238 [378,905,238]	

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 24銘柄	98.6%	1.4%	55.2%
イギリス・ポンド	株式 106銘柄 投資証券 5銘柄	98.8%	1.2%	11.1%
オーストラリア・ドル	株式 56銘柄 投資証券 7銘柄	93.7%	6.3%	3.0%
カナダ・ドル	株式 80銘柄	100%	-%	4.5%
シンガポール・ドル	株式 17銘柄 投資証券 1銘柄	97.6%	2.4%	0.6%
スイス・フラン	株式 33銘柄	100%	-%	4.4%
スウェーデン・クローナ	株式 28銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式 14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%	-%	0.3%
ユーロ	株式 241銘柄 投資証券 4銘柄	99.2%	0.8%	18.2%
香港・ドル	株式 30銘柄 投資証券 1銘柄	97.3%	2.7%	1.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

「ダイワＪ－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20年12月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	152,149,806
投資証券	19,736,881,300
未収配当金	255,564,253
流動資産合計	20,144,595,359
資産合計	20,144,595,359
負債の部	
流動負債	
未払解約金	50,000,000
流動負債合計	50,000,000
負債合計	50,000,000
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	23,591,169,931
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△3,496,574,572
元本等合計	20,094,595,359
純資産合計	20,094,595,359
負債純資産合計	20,144,595,359

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20年2月28日 至 平成20年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場の ないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表 する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基 づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想 配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年12月18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	26,703,725,713円
同期中における追加設定元本額	436,738,894円
同期中における一部解約元本額	3,549,294,676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	7,638,220,271円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）	15,318,476,817円
ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	633,676,734円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	501,530円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	252,710円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	41,869円
計	23,591,169,931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	23,591,169,931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3,496,574,572円であります。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年12月18日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
投資証券	19,736,881,300	△5,585,495,503
合計	19,736,881,300	△5,585,495,503

（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20年9月17日から平成20年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成20年12月18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)	0.8518円 (8,518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	842	316,592,000	
	M I Dリート投資法人	1,362	221,052,600	
	日本コマース投資	1,909	171,810,000	
	森ヒルズリート	1,181	330,680,000	
	野村不レジデンシャル	718	213,964,000	
	産業ファンド	586	155,583,000	
	日本ビルファンド	4,019	3,918,525,000	
	ジャパンリアルエステイト	3,285	2,756,115,000	
	日本リテールファンド	2,866	1,149,266,000	
	オリックス不動産投資	1,866	774,390,000	
	日本プライムリアルティ	4,635	1,043,802,000	
	プレミアム投資法人	974	258,110,000	
	東急リアル・エステート	1,256	659,400,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	719	539,969,000	
	野村不動産オフィスF	2,263	1,303,488,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,493	512,099,000	
	森トラスト総合リート	1,350	1,042,200,000	
	日本レジデンシャル	1,833	136,558,500	
	東京グロースリート	400	43,440,000	
	フロンティア不動産投資	1,187	608,931,000	
	クレッシェンド投資法人	806	89,788,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	907	474,361,000	
	福岡リート投資法人	794	289,810,000	
	プロスペクト・レジデンシャル投資法人	557	30,356,500	
	ジャパン・シングルレジデンス投資法人	416	20,384,000	
	ケネディクス不動産投資法人	1,483	366,004,400	
	ジョイントリート投資法人	776	99,328,000	
	ラサールジャパン投資法人	894	65,262,000	
	F Cレジデンシャル投資法人	242	33,783,200	
	D Aオフィス投資法人	2,550	495,210,000	
	阪急リート投資法人	633	258,264,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	564	158,484,000	
	エルシーピー投資法人	681	40,179,000	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	680	72,760,000	
	トップリート投資法人	1,149	337,806,000	
	クリード・オフィス投資法人	989	90,592,400	
	ビ・ライフ投資法人	365	76,686,500	
	日本ホテルファンド投資法人	313	51,958,000	
	リプラス・レジデンシャル投資法人	1,242	88,678,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	1,146	441,210,000	
投資証券 合計		51,931	19,736,881,300	
合計		51,931	19,736,881,300	

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20年12月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	750,596
コール・ローン	3,803,378
投資証券	244,435,115
未収配当金	759,708
流動資産合計	249,748,797
資産合計	249,748,797
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	—
負債合計	—
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	403,382,499
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△153,633,702
元本等合計	249,748,797
純資産合計	249,748,797
負債純資産合計	249,748,797

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20年2月28日 至 平成20年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として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。
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。

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年12月18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	365,293,489円
同期中における追加設定元本額	48,253,096円
同期中における一部解約元本額	10,164,086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）	296,559,384円
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	45,258,853円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	60,555,157円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	634,251円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	322,286円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	52,568円
計	403,382,499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	403,382,499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153,633,702円であります。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年12月18日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
投資証券	244,435,115	16,294,052
合計	244,435,115	16,294,052

(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20年12月2日から平成20年12月18日まで）を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

II 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成20年12月18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)	0.6191円 (6,191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	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	800.000	54,496.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	2,500.000	141,400.000	
		GRAMERCY CAPITAL CORP	433.000	571.560	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,300.000	78,663.000	
		BIOMED REALTY TRUST INC	700.000	6,811.000	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	1,006.000	14,174.540	
		VORNADO REALTY TRUST	1,500.000	96,120.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	2,900.000	96,541.000	

ENTERTAINMENT PROPERTIES	400.000	12,356.000
HOST HOTELS&RESORTS INC	5,500.000	45,100.000
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	300.000	702.000
KIMCO REALTY CORP	2,500.000	47,150.000
SOVRAN SELF STORAGE INC	200.000	7,150.000
VENTAS INC	1,500.000	45,150.000
SUN COMMUNITIES INC	200.000	2,604.000
ASSOCIATED ESTATES REALTY	100.000	886.000
ACADIA REALTY TRUST	300.000	4,686.000
AMB PROPERTY CORP	1,100.000	24,827.000
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ	300.000	16,533.000
BRANDYWINE REALTY TRUST	900.000	6,309.000
SAUL CENTERS INC	100.000	4,083.000
BRE PROPERTIES-CL A	500.000	16,345.000
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	700.000	5,019.000
MACK-CALI REALTY CORP	700.000	16,814.000
COLONIAL PROPERTIES TRUST	500.000	3,900.000
CAMDEN PROPERTY TRUST	600.000	19,146.000
COUSINS PROPERTIES INC	400.000	5,988.000
DEVELOPERS DIV REALTY	1,200.000	5,712.000
DUKE REALTY CORP	1,500.000	17,520.000
EASTGROUP PROPERTIES INC	300.000	10,221.000
EQUITY ONE INC	300.000	5,454.000
ESSEX PROPERTY TRUST INC	300.000	24,537.000
FELCOR LODGING TRUST INC	600.000	1,374.000
FIRST INDUSTRIAL REALTY	400.000	3,136.000
FEDERAL REALTY INVS TRUST	600.000	39,540.000
GLIMCHER REALTY TRUST	400.000	1,444.000
GETTY REALTY CORP	200.000	4,134.000
HEALTH CARE REIT INC	1,100.000	43,175.000
HCP INC	2,700.000	74,169.000
HIGHWOODS PROPERTIES INC	600.000	16,068.000
HOME PROPERTIES INC	300.000	12,501.000
HOSPITALITY PROPERTIES	1,000.000	14,540.000
HEALTHCARE REALTY TRUST	500.000	11,415.000
HRPT PROPERTIES TRUST	2,200.000	7,150.000
KILROY REALTY CORP	300.000	10,134.000
LASALLE HOTEL PROPERTIES	400.000	4,668.000
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,000.000	24,380.000
LTC PROPERTIES INC	200.000	3,818.000
LEXINGTON REALTY TRUST	600.000	3,156.000
MID-AMERICA APARTMENT COM	300.000	11,415.000
MACERICH CO/THE	800.000	15,640.000
EQUITY LIFESTYLE PROPERTI	300.000	12,003.000
MAGUIRE PROPERTIES INC	400.000	932.000
MISSION WEST PROPERTIES	200.000	1,520.000
NATL HEALTHINVESTORS INC	300.000	8,220.000
NATIONWIDE HEALTH PPTYS	1,000.000	26,810.000
NATIONAL RETAIL PROPERTIE	800.000	12,736.000
REALTY INCOME CORP	1,100.000	26,400.000
CORPORATE OFFICE PROPERTI	500.000	15,290.000
PENN REAL ESTATE INVEST	400.000	2,572.000
PARKWAY PROPERTIES INC	200.000	3,604.000
PROLOGIS	2,700.000	22,140.000
POST PROPERTIES INC	500.000	9,630.000
PUBLIC STORAGE	1,400.000	107,786.000
PS BUSINESS PARKS INC/CA	200.000	9,494.000

	REGENCY CENTERS CORP	800.000	35,656.000	
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTI	200.000	1,270.000	
	TANGER FACTORY OUTLET CEN	300.000	11,634.000	
	SL GREEN REALTY CORP	600.000	15,756.000	
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	1,200.000	18,708.000	
	TAUBMAN CENTERS INC	600.000	18,390.000	
	URSTADT BIDDLE-CL A	200.000	3,066.000	
	UDR INC	1,400.000	21,910.000	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INC	100.000	3,334.000	
	WASHINGTON REAL ESTATE IN	500.000	14,570.000	
	WEINGARTEN REALTY INVESTO	800.000	17,128.000	
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,000.000	1,550.000	
	AGREE REALTY CORP	100.000	1,623.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTOR	900.000	13,599.000	
	INLAND REAL ESTATE CORP	600.000	7,698.000	
	STRATEGIC HOTELS&RESORTS	700.000	1,253.000	
	U-STORE-IT TRUST	500.000	1,985.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS	500.000	3,080.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	800.000	25,280.000	
	CEDAR SHOPPING CENTERS	400.000	2,360.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	800.000	8,072.000	
	FIRST POTOMAC REALTY TRUS	200.000	1,582.000	
	WINTHROP REALTY TRUST	100.000	1,091.000	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	500.000	1,355.000	
	SUPERTEL HOSPITALITY INC	200.000	344.000	
	INVESTORS REAL ESTATE TRU	600.000	5,868.000	
	KITE REALTY GROUP TRUST	300.000	1,533.000	
	MONMOUTH REIT -CL A	200.000	1,372.000	
	ONE LIBERTY PROPERTIES IN	100.000	837.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITI	422.000	9,376.840	
	EDUCATION REALTY TRUST	300.000	1,476.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	100.000	854.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY	900.000	5,013.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	700.000	4,816.000	
	CAPLEASE INC	400.000	812.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIE	600.000	7,890.000	
	DOUGLAS EMMETT	1,300.000	17,823.000	
	COGDELL SPENCER INC	200.000	1,788.000	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	1,700.000	8,160.000	
アメリカ・ドル 小計		77,561.000	アメリカ・ドル 1,697,875.940 (148,479,251)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	MUCKLOW<A&J>GROUP PLC	250.000	600.000	
	LOCAL SHOPPING REIT PLC	800.000	221.600	
	LAND SECURITIES PLC	5,000.000	45,050.000	
	SEGRO	4,600.000	11,141.200	
	HAMMERSON PLC	3,100.000	16,569.500	
	BRITISH LAND CO PLC	5,500.000	29,452.500	
	GREAT PORTLAND ESTATES PL	1,900.000	4,617.000	
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	2,950.000	14,868.000	
	BRIXTON PLC	2,650.000	3,635.800	
	DERWENT LONDON PLC	850.000	6,098.750	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	250.000	657.500	
	WORKSPACE GROUP PLC	1,600.000	1,091.200	
	WARNER ESTATE HOLDINGS PL	350.000	89.250	
	SHAFTESBURY PLC	1,350.000	5,092.200	

	BIG YELLOW GROUP PLC	800.000	1,813.600
イギリス・ポンド 小計		31,950.000	イギリス・ポンド 140,998.100 (19,151,773)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	TRINITY GROUP	1,500.000	375.000
	PRIME RETIREMENT&AGED CAR	5,500.000	522.500
	CROMWELL GROUP	7,000.000	4,410.000
	TISHMAN SPEYER OFFICE FUN	3,000.000	315.000
	BUNNINGS WAREHOUSE PROPER	2,000.000	3,540.000
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	20,500.000	37,105.000
	COMMONWEALTH PROPERTY OFF	15,000.000	16,200.000
	DEXUS PROPERTY GROUP	32,000.000	27,360.000
	GPT GROUP	46,000.000	41,630.000
	ING INDUSTRIAL FUND	11,000.000	1,760.000
	ING OFFICE FUND	17,500.000	12,775.000
	MACQUARIE COUNTRYWIDE TRU	12,000.000	2,640.000
	MACQUARIE DDR TRUST	8,500.000	297.500
	MACQUARIE OFFICE TRUST	19,500.000	4,387.500
	MIRVAC GROUP	15,500.000	18,677.500
	STOCKLAND	16,000.000	56,480.000
	THAKRAL HOLDINGS GROUP	3,500.000	1,452.500
	VALAD PROPERTY GROUP	15,500.000	635.500
	WESTFIELD GROUP	21,000.000	274,050.000
	ABACUS PROPERTY GROUP	6,000.000	1,080.000
	MIRVAC REAL ESTATE INVE	5,000.000	1,675.000
	MACQUARIE LEISURE TRUST	2,500.000	2,250.000
	WESTPAC OFFICE TRUST-PP	4,000.000	1,080.000
	GOODMAN GROUP	29,000.000	17,545.000
	BABCOCK & BROWN JAPAN PRO	5,000.000	1,700.000
	CHARTER HALL GROUP	4,000.000	1,040.000
	APN EUROPEAN RETAIL PROPE	4,500.000	301.500
	ALE PROPERTY GROUP	1,000.000	1,970.000
	ASPEN GROUP	2,000.000	920.000
	ING REAL ESTATE COMMUNITY	4,000.000	208.000
	CHALLENGER DIVERSIFIED PR	5,000.000	2,550.000
オーストラリア・ドル 小計		344,500.000	オーストラリア・ドル 536,932.500 (33,128,735)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	ARTIS REAL ESTATE INVESTM	200.000	990.000
	CALLOWAY REAL ESTATE INVE	400.000	4,120.000
	CAN APARTMENT PROP REAL	300.000	4,149.000
	CAN REAL ESTATE INVEST TR	300.000	7,170.000
	CHARTWELL SENIORS HOUSING	400.000	1,704.000
	COMINAR REAL ESTATE INV-T	200.000	2,904.000
	H&R REAL ESTATE INVSTMT-	800.000	4,960.000
	INNVEST REAL ESTATE INVES	400.000	1,092.000
	MORGUARD REAL ESTATE-TR U	300.000	2,475.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVST	1,100.000	15,092.000
	DUNDEE REAL ESTATE INVEST	100.000	925.000
	BOARDWALK REAL ESTATE INV	300.000	6,798.000
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA	300.000	2,748.000
	NORTHERN PROPERTY REAL ES	100.000	1,680.000
	CROMBIE REAL ESTATE INVES	100.000	750.000
	ALLIED PROPERTIES REAL ES	200.000	2,122.000
	EXTENDICARE REAL ESTATE I	300.000	1,113.000

カナダ・ドル 小計		5,800.000	カナダ・ドル 60,792.000 (4,458,485)
シンガポール・ドル	FIRST REAL ESTATE INVT TR	2,000.000	シンガポール・ドル 820.000
	MACARTHURCOOK INDUSTRIAL	2,000.000	500.000
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	9,000.000	7,695.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	10,000.000	13,000.000
	CAPITAMALL TRUST	13,000.000	21,450.000
	SUNTEC REIT	15,000.000	10,650.000
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	16,000.000	5,440.000
	K-REIT ASIA	2,000.000	1,330.000
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	6,200.000	1,426.000
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	3,000.000	1,590.000
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUS	8,000.000	2,080.000
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	4,000.000	2,600.000
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	3,000.000	1,770.000
	MACQUARIE PRIME REIT	6,000.000	3,120.000
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	3,000.000	1,440.000
	SAIZEN REIT	3,000.000	405.000
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	4,000.000	2,880.000
	LIPPO-MAPLETREE INDONESIA	6,000.000	1,920.000
シンガポール・ドル 小計		115,200.000	シンガポール・ドル 80,116.000 (4,876,660)
ニュージーランド・ドル	ING PROPERTY TRUST	4,500.000	ニュージーランド・ドル 2,970.000
	KIWI INCOME PROPERTY TRU	7,500.000	7,575.000
	GOODMAN PROPERTY TRUST	6,500.000	6,500.000
	AMP NZ OFFICE TRUST	5,500.000	5,170.000
ニュージーランド・ドル 小計		24,000.000	ニュージーランド・ドル 22,215.000 (1,153,625)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT	250.000	ユーロ 922.500
	WERELDHAVE NV	200.000	12,789.000
	CORIO NV	450.000	14,672.250
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-C	350.000	8,890.000
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS	400.000	4,176.000
	VASTNED OFFICES/INDUSTRIA	200.000	1,272.000
	VASTNED RETAIL NV	200.000	5,816.000
	ICADE	200.000	11,600.000
	ANF	105.000	2,803.500
	UNIBAIL-RODAMCO	900.000	94,050.000
	GECINA SA	100.000	4,778.000
	KLEPIERRE	900.000	15,750.000
	FONCIERE DES REGIONS	250.000	10,805.000
	SILIC	100.000	6,321.500
	CEGEREAL	50.000	976.500
	AFFINE	50.000	595.000
	ACANTHE DEVELOPPEMENT SA	250.000	310.000
	STE DE LA TOUR EIFFEL	50.000	1,850.000
	MERCIALYS	150.000	3,810.000
	COFINIMMO	100.000	9,635.000
	BEFIMMO S.C.A	150.000	9,799.500
	INTERVEST OFFICES	50.000	923.500
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	50.000	1,600.000

	IMMOBILIARE GRANDE DISTRI	1,300.000	1,326.000	
	EUROBANK PROPERTIES REAL	200.000	1,080.000	
ユーロ 小計		7,005.000	ユーロ 226,551.250 (28,565,847)	
香港・ドル	GZI REAL ESTATE INVMNT TR	6,000.000	香港・ドル 10,500.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVE	10,000.000	13,400.000	
	RREEF CHINA COMMERCIAL TR	4,000.000	8,880.000	
	PROSPERITY REIT	9,000.000	7,740.000	
	LINK REIT	23,000.000	315,100.000	
	REGAL REAL ESTATE INV	8,000.000	6,800.000	
	CHAMPION REIT	22,000.000	40,260.000	
	FORTUNE REAL ESTATE INVES	4,000.000	6,960.000	
香港・ドル 小計		86,000.000	香港・ドル 409,640.000 (4,620,739)	
投資証券 合計			244,435,115 [244,435,115]	
合計			244,435,115 [244,435,115]	

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 104銘柄	100%	60.7%
イギリス・ポンド	投資証券 15銘柄	100%	7.8%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	100%	13.6%
カナダ・ドル	投資証券 17銘柄	100%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券 18銘柄	100%	2.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券 4銘柄	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 25銘柄	100%	11.7%
香港・ドル	投資証券 8銘柄	100%	1.9%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成20年12月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	70,698,206
国債証券	6,603,984,240
地方債証券	780,996,018
特殊債券	1,308,946,534
社債券	1,204,675,848
未収利息	40,844,556
前払費用	6,868,362
流動資産合計	10,017,013,764
資産合計	10,017,013,764
負債の部	
流動負債	
未払金	7,025,690
未払解約金	2,710,000
流動負債合計	9,735,690
負債合計	9,735,690
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	9,484,212,087
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	523,065,987
元本等合計	10,007,278,074
純資産合計	10,007,278,074
負債純資産合計	10,017,013,764

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20年2月28日 至 平成20年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年12月18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	10,606,084,635円

同期中における追加設定元本額	4,680,865,851円
同期中における一部解約元本額	5,802,738,399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	1,994,144,967円
ダイワ・ライフ・バランス 50	5,626,589円
ダイワ・ライフ・バランス 70	3,529,807円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／安定コース）	59,843,053円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／6分散コース）	55,847,031円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース）	9,837,158円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	1,719,799円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	363,604円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	41,043円
ダイワ世界バランスファンド 40 VA	4,537,313,601円
ダイワ世界バランスファンド 60 VA	365,633,893円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 50 VA	790,839,869円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 75 VA	1,659,471,673円
計	9,484,212,087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	9,484,212,087口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年12月18日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	6,603,984,240	57,858,620
地方債証券	780,996,018	2,537,537
特殊債券	1,308,946,534	4,141,426
社債券	1,204,675,848	1,949,594
合計	9,898,602,640	66,487,177

（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20年12月2日から平成20年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成20年12月18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)	1.0552円 (10,552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	1 40年国債	18,000,000	18,718,560	
	1 30年国債	2,000,000	2,266,100	
	2 30年国債	8,000,000	8,500,960	
	3 30年国債	4,000,000	4,179,840	
	4 30年国債	8,000,000	9,216,080	
	5 30年国債	3,000,000	3,073,800	
	6 30年国債	9,000,000	9,535,500	
	7 30年国債	9,000,000	9,355,770	
	8 30年国債	4,000,000	3,775,880	
	9 30年国債	7,000,000	6,063,540	
	10 30年国債	7,000,000	5,653,200	
	11 30年国債	8,000,000	7,363,360	
	12 30年国債	8,000,000	7,974,000	
	13 30年国債	10,000,000	9,772,000	
	14 30年国債	10,000,000	10,555,700	
	15 30年国債	5,000,000	5,372,150	
	16 30年国債	10,000,000	10,749,100	
	17 30年国債	12,000,000	12,658,440	
	18 30年国債	13,000,000	13,451,100	
	19 30年国債	14,000,000	14,476,560	
	20 30年国債	9,000,000	9,682,740	
	20 利付国債20年	40,000,000	47,211,600	
	21 30年国債	4,000,000	4,134,240	
	22 30年国債	12,000,000	12,887,400	
	23 30年国債	10,000,000	10,753,300	
	24 30年国債	13,000,000	13,985,010	
	25 30年国債	15,000,000	15,501,450	
	26 30年国債	25,000,000	26,352,750	
	27 30年国債	23,000,000	24,759,730	
	28 30年国債	24,000,000	25,855,920	
	29 30年国債	10,000,000	10,558,800	
	30 利付国債20年	16,000,000	18,919,840	
	32 利付国債20年	8,000,000	9,577,520	
	33 利付国債20年	5,000,000	6,036,050	
	34 利付国債20年	27,000,000	32,087,070	
	36 利付国債20年	33,000,000	37,999,170	
	37 利付国債20年	5,000,000	5,799,600	
	38 利付国債20年	11,000,000	12,387,210	
	39 20年国債	32,000,000	35,754,240	
	40 20年国債	36,000,000	39,315,960	
	41 20年国債	30,000,000	30,555,600	

4 2	2 0年国債	11,000,000	12,369,940
4 3	2 0年国債	26,000,000	30,076,020
4 4	2 0年国債	23,000,000	25,731,020
4 5	5年国債	29,000,000	29,065,830
4 5	2 0年国債	15,000,000	16,625,700
4 6	5年国債	37,000,000	37,038,480
4 6	2 0年国債	19,000,000	20,637,610
4 7	5年国債	31,000,000	31,031,930
4 7	2 0年国債	18,000,000	19,530,900
4 8	5年国債	25,000,000	25,099,750
4 8	2 0年国債	11,000,000	12,292,830
4 9	5年国債	3,000,000	3,008,010
4 9	2 0年国債	18,000,000	19,286,460
5 0	5年国債	33,000,000	33,199,320
5 0	2 0年国債	13,000,000	13,636,480
5 1	5年国債	28,000,000	28,265,720
5 1	2 0年国債	15,000,000	15,855,600
5 2	5年国債	20,000,000	20,132,000
5 2	2 0年国債	14,000,000	14,930,440
5 3	5年国債	22,000,000	22,231,880
5 3	2 0年国債	17,000,000	18,098,880
5 4	5年国債	25,000,000	25,331,500
5 4	2 0年国債	14,000,000	15,073,520
5 5	5年国債	36,000,000	36,712,080
5 5	2 0年国債	20,000,000	21,000,000
5 6	5年国債	28,000,000	28,615,720
5 6	2 0年国債	21,000,000	21,992,670
5 7	5年国債	6,000,000	6,127,380
5 7	2 0年国債	9,000,000	9,309,780
5 8	5年国債	88,000,000	90,084,720
5 8	2 0年国債	26,000,000	26,817,960
5 9	5年国債	30,000,000	30,563,400
5 9	2 0年国債	15,000,000	15,051,000
6 0	5年国債	55,000,000	55,934,450
6 0	2 0年国債	15,000,000	14,458,650
6 1	5年国債	3,000,000	3,053,730
6 1	2 0年国債	19,000,000	17,287,340
6 2	5年国債	2,000,000	2,041,700
6 2	2 0年国債	6,000,000	5,256,120
6 3	5年国債	20,000,000	20,367,800
6 3	2 0年国債	23,000,000	23,172,960
6 4	5年国債	45,000,000	46,304,100
6 4	2 0年国債	27,000,000	27,506,520
6 5	5年国債	2,000,000	2,051,140
6 5	2 0年国債	15,000,000	15,249,000
6 6	5年国債	12,000,000	12,183,720
6 6	2 0年国債	11,000,000	11,032,450
6 7	5年国債	15,000,000	15,341,850
6 7	2 0年国債	18,000,000	18,269,820
6 8	5年国債	27,000,000	27,419,040
6 8	2 0年国債	13,000,000	13,720,070
6 9	5年国債	55,000,000	55,415,800
6 9	2 0年国債	17,000,000	17,715,530
7 0	5年国債	114,000,000	114,327,180
7 0	2 0年国債	17,000,000	18,379,890
7 1	5年国債	32,000,000	32,762,560
7 1	2 0年国債	8,000,000	8,428,320

7 2	5年国債	31,000,000	32,016,180
7 2	20年国債	39,000,000	40,484,340
7 3	5年国債	24,000,000	24,583,680
7 3	20年国債	8,000,000	8,183,360
7 4	5年国債	25,000,000	25,276,750
7 4	20年国債	22,000,000	22,791,120
7 5	5年国債	34,000,000	34,513,060
7 5	20年国債	4,000,000	4,140,360
7 6	5年国債	53,000,000	54,041,980
7 6	20年国債	23,000,000	23,143,520
7 7	5年国債	45,000,000	45,472,950
7 7	20年国債	9,000,000	9,185,670
7 8	20年国債	5,000,000	5,025,200
7 9	20年国債	17,000,000	17,333,030
8 0	20年国債	16,000,000	16,536,640
8 1	20年国債	11,000,000	11,189,420
8 2	20年国債	42,000,000	43,314,180
8 3	20年国債	20,000,000	20,593,000
8 4	20年国債	18,000,000	18,266,220
8 5	20年国債	26,000,000	26,726,960
8 6	20年国債	32,000,000	33,815,360
8 7	20年国債	3,000,000	3,124,950
8 8	20年国債	15,000,000	15,829,050
8 9	20年国債	25,000,000	26,001,500
9 0	20年国債	27,000,000	28,055,970
9 1	20年国債	21,000,000	22,129,170
9 2	20年国債	44,000,000	44,968,440
9 3	20年国債	18,000,000	18,120,960
9 4	20年国債	30,000,000	30,667,200
9 5	20年国債	21,000,000	22,103,760
9 6	20年国債	29,000,000	29,611,030
9 7	20年国債	20,000,000	20,728,800
9 8	20年国債	33,000,000	33,679,140
9 9	20年国債	53,000,000	54,101,340
1 0 0	20年国債	13,000,000	13,482,820
1 0 1	20年国債	24,000,000	25,672,320
1 0 2	20年国債	15,000,000	16,043,700
1 0 3	20年国債	24,000,000	25,275,360
1 0 4	20年国債	20,000,000	20,394,800
1 0 5	20年国債	45,000,000	45,929,250
1 0 6	20年国債	15,000,000	15,556,650
2 1 9	利付国債	20,000,000	20,339,400
2 2 0	利付国債	10,000,000	10,157,400
2 2 1	利付国債	42,000,000	42,910,980
2 2 2	利付国債	12,000,000	12,242,520
2 2 3	利付国債	5,000,000	5,108,750
2 2 4	利付国債	5,000,000	5,117,400
2 2 5	利付国債	19,000,000	19,541,120
2 2 6	利付国債	35,000,000	35,927,850
2 2 7	利付国債	9,000,000	9,220,140
2 2 8	利付国債	16,000,000	16,355,840
2 2 9	10年国債	5,000,000	5,100,150
2 3 1	10年国債	26,000,000	26,484,900
2 3 3	10年国債	33,000,000	33,696,630
2 3 4	10年国債	26,000,000	26,589,160
2 3 6	10年国債	10,000,000	10,268,700
2 3 7	10年国債	45,000,000	46,255,950

238	10年国債	9,000,000	9,222,660
239	10年国債	9,000,000	9,230,130
240	10年国債	37,000,000	37,819,920
241	10年国債	18,000,000	18,410,220
242	10年国債	17,000,000	17,325,550
243	10年国債	17,000,000	17,266,560
244	10年国債	6,000,000	6,069,840
245	10年国債	11,000,000	11,083,160
246	10年国債	15,000,000	15,055,200
247	10年国債	26,000,000	26,074,620
248	10年国債	20,000,000	19,979,400
249	10年国債	33,000,000	32,823,450
250	10年国債	44,000,000	43,503,240
251	10年国債	13,000,000	13,087,490
252	10年国債	55,000,000	55,620,950
253	10年国債	56,000,000	58,151,520
254	10年国債	31,000,000	31,914,810
255	10年国債	4,000,000	4,138,240
256	10年国債	34,000,000	35,028,840
257	10年国債	15,000,000	15,374,550
258	10年国債	98,000,000	100,461,760
260	10年国債	34,000,000	35,411,000
261	10年国債	20,000,000	21,045,800
262	10年国債	45,000,000	47,576,700
263	10年国債	16,000,000	16,665,760
264	10年国債	6,000,000	6,215,100
265	10年国債	48,000,000	49,735,200
266	10年国債	39,000,000	40,176,240
267	2年国債	44,000,000	44,102,520
267	10年国債	31,000,000	31,758,570
268	2年国債	40,000,000	40,148,800
268	10年国債	13,000,000	13,476,320
269	2年国債	67,000,000	67,460,960
269	10年国債	41,000,000	41,993,020
270	2年国債	37,000,000	37,265,660
270	10年国債	60,000,000	61,489,800
271	2年国債	15,000,000	15,087,900
271	10年国債	57,000,000	58,047,660
272	2年国債	42,000,000	42,186,900
272	10年国債	107,000,000	110,468,940
273	2年国債	50,000,000	50,318,000
273	10年国債	49,000,000	50,916,390
274	2年国債	50,000,000	50,145,000
274	10年国債	11,000,000	11,464,090
275	10年国債	17,000,000	17,616,760
276	10年国債	29,000,000	30,414,620
277	10年国債	30,000,000	31,576,500
278	10年国債	61,000,000	65,060,770
279	10年国債	71,000,000	76,826,970
280	10年国債	95,000,000	101,985,350
281	10年国債	57,000,000	61,723,020
282	10年国債	93,000,000	98,028,510
283	10年国債	69,000,000	73,333,890
284	10年国債	147,000,000	154,554,330
285	10年国債	143,000,000	150,158,580
286	10年国債	118,000,000	124,604,460
287	10年国債	56,000,000	59,662,960

	288	10年国債	126,000,000	131,764,500	
	289	10年国債	145,000,000	148,830,900	
	290	10年国債	52,000,000	52,842,400	
	291	10年国債	32,000,000	32,239,040	
	292	10年国債	63,000,000	65,673,090	
	293	10年国債	49,000,000	51,460,290	
	294	10年国債	44,000,000	45,815,000	
	295	10年国債	69,000,000	70,612,530	
	296	10年国債	127,000,000	129,644,140	
国債証券 合計			6,374,000,000	6,603,984,240	
地方債証券	12	共同発行地方	50,000,000	50,930,150	
	14	共同発行地方	16,400,000	16,785,400	
	18	共同発行地方	100,000,000	102,790,200	
	27	共同発行地方	20,000,000	20,145,480	
	76	川崎市公債	25,000,000	24,872,800	
	112	神奈川県公債	35,000,000	35,651,525	
	576	東京都公債	70,000,000	71,203,090	
	583	東京都公債	7,400,000	7,561,941	
	604	東京都公債	10,000,000	10,261,670	
	12-こ	名古屋市債	100,000,000	101,859,300	
	12-ゆ	名古屋市債	20,000,000	20,399,360	
	14-1	横浜市公債	5,000,000	5,093,990	
	14-5	横浜市公債	20,000,000	19,906,220	
	17-9	千葉県5年	100,500,000	101,411,032	
	16	川崎市5年	60,000,000	61,535,400	
	18	川崎市5年	60,000,000	60,241,260	
	19	神奈川県5年	40,000,000	40,203,440	
	20	東京都5年	30,000,000	30,143,760	
地方債証券 合計			769,300,000	780,996,018	
特殊債券	5	政保中部空港	21,000,000	20,973,288	
	6	政保政策投資BK	25,000,000	24,968,175	
	14	政保国民生活	19,000,000	19,555,047	
	39	政保関西空港	3,000,000	2,954,244	
	190	政保首都高速	3,000,000	3,074,583	
	193	しんきん中金	100,000,000	100,060,400	
	309	政保道路債	20,000,000	20,442,960	
	312	政保道路債	30,000,000	30,533,340	
	317	政保道路債	100,000,000	98,466,500	
	319	政保道路債	40,000,000	40,076,240	
	323	政保道路債	85,000,000	87,565,555	
	328	政保道路債	41,000,000	42,227,171	
	333	政保道路債	11,000,000	11,378,906	
	334	政保道路債	2,000,000	2,057,072	
	793	政保公営企業	100,000,000	102,214,800	
	803	政保公営企業	15,000,000	15,240,000	
	809	政保公営企業	15,000,000	15,310,245	
	828	政保公営企業	15,000,000	14,768,490	
	829	政保公営企業	10,000,000	10,111,010	
	831	政保公営企業	4,000,000	4,137,368	
	842	政保公営企業	5,000,000	5,229,640	
	い686	利付農林債	30,000,000	30,407,700	
	い688	利付商工債	100,000,000	100,451,000	
	2	成田国際空港	100,000,000	102,284,200	
	1	公営企業	100,000,000	101,619,400	
	4	国際協力銀行	100,000,000	101,791,600	
	13	首都高速道路	100,000,000	101,201,100	

	1 7 国民生活債券	100,000,000	99,846,500	
特殊債券 合計		1,294,000,000	1,308,946,534	
社債券	4 みずほコーポレート	100,000,000	100,581,400	
	7 日産フィナンシャル	100,000,000	99,617,300	
	1 2 三菱UFJフィナンシヤ	100,000,000	100,398,900	
	1 6 ソニー	100,000,000	100,270,600	
	2 1 東京瓦斯	100,000,000	101,449,700	
	2 8 トヨタファイナンス	100,000,000	100,545,200	
	4 1 三菱電機	100,000,000	100,761,600	
	2 6 1 北海道電力	3,000,000	3,322,155	
	3 9 0 東北電力	130,000,000	134,896,320	
	4 8 2 東京電力	100,000,000	101,435,400	
	5 1 3 東京電力	57,000,000	59,096,460	
	5 1 6 東京電力	17,000,000	17,174,913	
	8 ゴールドマン サックス	100,000,000	91,267,600	
	1 0 GEキャピタル	100,000,000	93,858,300	
社債券 合計		1,207,000,000	1,204,675,848	
合計		9,644,300,000	9,898,602,640	

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20年12月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	95,401,949
コール・ローン	1,091,751,774
国債証券	76,127,725,124
派生商品評価勘定	30,544,877
未収入金	70,969,214
未収利息	1,037,862,030
前払費用	126,764,371
流動資産合計	78,581,019,339
資産合計	78,581,019,339
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,413,252
未払金	89,480,313
未払解約金	26,455,000
流動負債合計	135,348,565
負債合計	135,348,565
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	43,717,934,613
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	34,727,736,161
元本等合計	78,445,670,774
純資産合計	78,445,670,774
負債純資産合計	78,581,019,339

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20年2月28日 至 平成20年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年12月18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	31,541,502,428円
同期中における追加設定元本額	16,450,230,472円
同期中における一部解約元本額	4,273,798,287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	3,623,418,640円
ダイワ国内重視バランスファンド 3 0 V A（一般投資家私募）	101,845,110円
ダイワ国内重視バランスファンド 5 0 V A（一般投資家私募）	777,433,802円
ダイワ国際分散バランスファンド 3 0 V A（一般投資家私募）	235,307,879円
ダイワ国際分散バランスファンド 5 0 V A（一般投資家私募）	2,266,152,949円
DCダイワ外国債券インデックス	17,504,967,567円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	319,846,032円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	834,964円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,048,395円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／安定コース）	35,289,554円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／6分散コース）	33,227,824円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース）	5,893,021円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	805,054円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	170,644円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	23,158円

ダイワ世界バランスファンド40VA	3,697,667,277円
ダイワ世界バランスファンド60VA	354,710,738円
ダイワ・バランスファンド35VA	8,371,686,590円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	1,884,366,887円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	1,490,785,857円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	2,968,909,098円
ダイワライフスタイル25	15,319,715円
ダイワライフスタイル50	21,845,535円
ダイワライフスタイル75	6,378,323円
計	43,717,934,613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	43,717,934,613口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年12月18日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	76,127,725,124	1,399,926,316
合計	76,127,725,124	1,399,926,316

（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20年12月2日から平成20年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成20年2月28日 至 平成20年12月18日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資するため、および外貨建資産の売買代金、利金、償還金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

II 取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成20年12月18日 現在			
	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	1,063,119,657	—	1,074,251,282	11,131,625
アメリカ・ドル	329,803,532	—	313,013,852	△16,789,680
イギリス・ポンド	84,044,229	—	82,946,862	△1,097,367
カナダ・ドル	55,970,810	—	54,666,880	△1,303,930
スイス・フラン	7,956,639	—	8,416,944	460,305
スウェーデン・ クローナ	11,254,705	—	11,400,913	146,208
デンマーク・ クローネ	8,623,361	—	9,076,268	452,907
ポーランド・ ズロチ	14,466,560	—	14,365,951	△100,609
ユーロ	550,999,821	—	580,363,612	29,363,791
合計	1,063,119,657	—	1,074,251,282	11,131,625

(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。

- ① 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。
- ② 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成20年12月18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)	1.7944円 (17,944円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,435,346.010	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,476,687.500	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	2,120,652.800	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,251,362.990	
		8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,126,837.500	
		9.125% U.S. TREASURY BOND 20180515	608,000.000	940,971.200	
		9% U.S. TREASURY BOND 20181115	405,000.000	627,369.300	
		8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,392,720.480	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,347,782.920	
		8.5% U.S. TREASURY BOND 20200215	743,000.000	1,134,694.740	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20200515	602,000.000	939,679.860	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,167,883.400	
		7.875% U.S. TREASURY BOND 20210215	795,000.000	1,186,903.200	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	732,000.000	1,116,980.760	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815	677,000.000	1,036,019.870	
		8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,614,062.750	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	1,124,160.000	
		7.625% U.S. TREASURY BOND 20221115	348,000.000	526,510.080	
		7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,342,925.000	
		6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,290,750.000	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,281,665.210	
		7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	687,000.000	1,126,680.000	
		6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,254,601.540	
		6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,205,276.400	
		6.75% U.S. TREASURY BOND 20260815	1,135,000.000	1,729,808.100	
		6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	939,777.300	
		6.625% U.S. TREASURY BOND 20270215	688,000.000	1,041,349.920	
		6.375% U.S. TREASURY BOND 20270815	765,000.000	1,130,761.800	
		6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	2,308,000.000	3,340,091.440	
		5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	1,109,614.920	
		5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,248,412.340	

5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	1,983,572.240	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	977,925.000	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	2,035,222.710	
5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,055,000.000	1,457,218.750	
4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	3,024,862.940	
4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	1,835,000.000	2,569,000.000	
5% U.S. TREASURY BOND 20370515	1,890,000.000	2,754,675.000	
4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	1,827,000.000	2,455,031.250	
4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	1,603,000.000	2,200,614.430	
6.5% U.S. TREASURY NOTE 20100215	2,141,000.000	2,289,178.610	
5.75% U.S. TREASURY NOTE 20100815	2,267,000.000	2,467,833.530	
5% U.S. TREASURY NOTE 20110215	2,359,000.000	2,582,350.120	
5% U.S. TREASURY NOTE 20110815	2,202,000.000	2,463,817.800	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120215	1,872,000.000	2,101,600.800	
4.375% U.S. TREASURY NOTE 20120815	1,316,000.000	1,488,303.880	
4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,732,000.000	1,946,335.000	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20130215	1,539,000.000	1,731,128.760	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20130515	1,766,000.000	1,963,279.860	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20130815	2,631,000.000	3,010,416.510	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20131115	3,059,000.000	3,513,536.810	
4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,868,000.000	3,273,994.080	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000	3,236,135.960	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	3,010,369.720	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,207,097.140	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20091215	1,435,000.000	1,479,384.550	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20100115	1,015,000.000	1,051,387.750	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20100215	1,022,000.000	1,059,599.380	
4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	4,196,000.000	4,811,595.160	
4% U.S. TREASURY NOTE 20100315	1,004,000.000	1,050,505.280	
4% U.S. TREASURY NOTE 20100415	1,237,000.000	1,297,588.260	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20100515	1,405,000.000	1,474,800.400	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	4,282,740.000	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20100615	1,737,000.000	1,817,457.840	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20100715	866,000.000	914,504.660	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20100815	1,062,000.000	1,126,049.220	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,613,638.900	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20100915	1,279,000.000	1,356,929.470	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20101015	1,252,000.000	1,338,951.400	

4.5% U.S. TREASURY NOTE 20101115	1,534,000.000	1,652,041.300	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,197,877.520	
4.375% U.S. TREASURY NOTE 20101215	1,267,000.000	1,362,607.820	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20110115	1,088,000.000	1,171,384.320	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,189,191.400	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20110228	1,067,000.000	1,155,518.320	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20110331	1,116,000.000	1,217,745.720	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110430	1,087,000.000	1,194,167.330	
5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,390,429.200	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110531	1,286,000.000	1,417,403.480	
5.125% U.S. TREASURY NOTE 20110630	1,392,000.000	1,545,217.440	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110731	1,891,000.000	2,094,566.150	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,424,707.040	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20110831	1,160,000.000	1,279,712.000	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20110930	1,261,000.000	1,388,272.730	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111031	1,150,000.000	1,273,705.500	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,784,208.320	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20111130	1,176,000.000	1,297,363.200	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111231	1,041,000.000	1,154,854.170	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120131	1,240,000.000	1,383,753.200	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20100215	1,437,000.000	1,508,275.200	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,432,445.440	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120229	1,375,000.000	1,533,331.250	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120331	1,923,000.000	2,143,529.640	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120430	1,650,000.000	1,843,875.000	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20100515	1,110,000.000	1,173,214.500	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,121,169.450	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120531	1,162,000.000	1,310,062.040	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120630	1,301,000.000	1,478,456.400	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120731	1,100,000.000	1,244,287.000	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,883,817.090	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20120831	1,187,000.000	1,327,208.440	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20120930	1,056,000.000	1,188,823.680	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20121031	1,079,000.000	1,204,433.750	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,970,242.740	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20091130	1,650,000.000	1,692,339.000	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,000,000.000	1,100,230.000	

	3.25% U.S. TREASURY NOTE 20091231	2,000,000.000	2,058,740.000	
	3.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	1,263,000.000	1,405,087.500	
	2.125% U.S. TREASURY NOTE 20100131	2,192,000.000	2,233,428.800	
	2.875% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,319,000.000	1,429,980.660	
	3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	4,263,670.180	
	2% U.S. TREASURY NOTE 20100228	2,300,000.000	2,341,676.000	
	2.75% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,500,000.000	1,615,770.000	
	1.75% U.S. TREASURY NOTE 20100331	2,660,000.000	2,705,299.800	
	2.5% U.S. TREASURY NOTE 20130331	1,890,000.000	2,017,707.300	
	2.125% U.S. TREASURY NOTE 20100430	3,241,000.000	3,318,070.980	
	3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130430	1,432,000.000	1,562,326.320	
	3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,385,500.000	
	2.625% U.S. TREASURY NOTE 20100531	3,276,000.000	3,374,771.400	
	3.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	1,462,000.000	1,615,159.120	
	2.875% U.S. TREASURY NOTE 20100630	3,278,000.000	3,395,024.600	
	3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	2,310,000.000	2,536,472.400	
	2.75% U.S. TREASURY NOTE 20100731	3,358,000.000	3,480,499.840	
	3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,408,000.000	2,644,080.320	
	4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,674,714.760	
	2.375% U.S. TREASURY NOTE 20100831	3,511,000.000	3,618,506.820	
	3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,500,000.000	2,712,500.000	
	2% U.S. TREASURY NOTE 20100930	3,716,000.000	3,814,102.400	
	3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	2,621,000.000	2,846,012.850	
	1.5% U.S. TREASURY NOTE 20101031	2,793,000.000	2,836,514.940	
	2.75% U.S. TREASURY NOTE 20131031	2,170,000.000	2,320,359.300	
	1.75% U.S. TREASURY NOTE 20111115	2,083,000.000	2,132,471.250	
	3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	2,411,000.000	2,744,393.080	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 226,289,000.000 (19,788,973,050)	アメリカ・ドル 265,840,279.900 (23,247,732,478)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	9% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110712	440,000.000	514,448.000	
	8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	868,000.000	1,214,679.200	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130927	592,000.000	728,100.800	
	6.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20101125	479,000.000	523,738.600	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	782,000.000	1,006,199.400	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1,911,000.000	2,752,986.600	

	6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	1,086,000.000	1,371,292.200	
	5.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20091207	1,137,000.000	1,192,826.700	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,653,000.000	1,707,053.100	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120307	1,690,000.000	1,814,215.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	1,285,000.000	1,421,981.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	1,851,135.600	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,432,714.100	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,287,067.100	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	1,587,000.000	1,858,377.000	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20100607	1,858,000.000	1,949,042.000	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	1,778,000.000	1,962,200.800	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	2,272,000.000	2,546,684.800	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	2,679,000.000	2,800,358.700	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	1,598,000.000	1,693,081.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	1,257,000.000	1,362,839.400	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,317,000.000	1,346,105.700	
	5.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120607	1,204,000.000	1,305,738.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	2,425,000.000	2,766,925.000	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	2,010,132.300	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,380,000.000	1,513,308.000	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130307	2,025,000.000	2,164,522.500	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	524,000.000	564,295.600	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	956,000.000	1,041,753.200	
	3.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20111207	366,000.000	372,734.400	
イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 42,978,000.000 (5,837,701,740)	イギリス・ポンド 48,076,535.800 (6,530,235,857)	
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	1,036,000.000	1,161,760.040	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	372,000.000	424,373.880	
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	570,000.000	648,899.400	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20100815	890,000.000	925,297.400	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	1,273,000.000	1,390,459.710	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	234,000.000	251,299.620	

オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 4,375,000.000 (269,937,500)	オーストラリア・ドル 4,802,090.050 (296,288,956)	
カナダ・ドル	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	カナダ・ドル 424,000.000	カナダ・ドル 640,362.960	
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	372,000.000	618,952.200	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	588,000.000	926,588.040	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,672,085.100	
	5.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100601	812,000.000	862,465.800	
	6% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110601	907,000.000	1,007,214.430	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	1,069,000.000	1,195,045.790	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	853,000.000	974,416.020	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	1,838,663.750	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	759,000.000	870,261.810	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,607,000.000	1,815,701.090	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100901	700,000.000	732,613.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,240,000.000	1,561,879.200	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	983,000.000	1,079,638.730	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	735,000.000	778,173.900	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	940,000.000	1,030,794.600	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	631,000.000	673,794.420	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20091201	369,000.000	380,224.980	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100601	280,000.000	290,348.800	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	1,471,000.000	1,637,914.370	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	1,367,000.000	1,459,709.940	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20101201	868,000.000	892,356.080	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	432,000.000	458,568.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	384,000.000	400,665.600	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 20,456,000.000 (1,500,243,040)	カナダ・ドル 23,798,438.610 (1,745,377,488)	
シンガポール ・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	4.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20100701	404,000.000	427,440.080	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20130701	206,000.000	214,726.160	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20120701	347,000.000	373,954.960	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20110701	456,000.000	486,054.960	

	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	591,379.880	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20100401	302,000.000	309,139.280	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	486,000.000	541,831.680	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	483,000.000	571,215.120	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	406,000.000	455,182.840	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20110201	150,000.000	156,909.000	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	320,000.000	367,868.800	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20120401	223,000.000	233,195.560	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	134,000.000	148,305.840	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20121001	104,000.000	108,569.760	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20130401	338,000.000	343,272.800	
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 4,877,000.000 (296,862,990)	シンガポール・ドル 5,329,046.720 (324,379,074)	
スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
	2.75% SWISS GOVERNMENT BOND 20120610	1,240,000.000	1,310,196.400	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20130211	974,000.000	1,081,256.880	
	3.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20100807	347,000.000	362,351.280	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	702,000.000	826,640.100	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	672,000.000	809,820.480	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20110610	1,462,000.000	1,571,021.340	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	350,000.000	365,298.500	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	150,000.000	176,095.500	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	765,000.000	825,947.550	
スイス・フラン 小計		スイス・フラン 6,662,000.000 (543,286,100)	スイス・フラン 7,328,628.030 (597,649,616)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	5,970,000.000	7,351,995.300	
	5.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20110315	4,765,000.000	5,134,764.000	
	5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	5,435,000.000	6,140,082.550	
	4% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20091201	4,975,000.000	5,100,320.250	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	3,635,000.000	4,126,233.900	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,550,000.000	6,876,172.500	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,250,000.000	4,416,472.500	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	4,575,000.000	5,022,480.750	

	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	4,360,000.000	5,036,977.200	
スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 43,515,000.000 (498,681,900)	スウェーデン・クローナ 49,205,498.950 (563,895,017)	
デンマーク・ クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	2,323,000.000	3,121,693.860	
	6% DANISH GOVERNMENT BOND 20111115	6,171,000.000	6,690,783.330	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	7,835,000.000	8,445,268.150	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20101115	4,740,000.000	4,842,715.800	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	5,529,000.000	5,739,433.740	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	5,381,000.000	5,595,917.140	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	3,857,000.000	4,380,742.030	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 35,836,000.000 (606,703,480)	デンマーク・クローネ 38,816,554.050 (657,164,260)	
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% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20110516	3,847,000.000	4,124,599.520	
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	4,914,000.000	5,565,596.400	
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	4,004,000.000	4,319,114.800	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	2,321,000.000	2,410,915.540	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 15,086,000.000 (200,945,520)	ノルウェー・クローネ 16,420,226.260 (218,717,414)	
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	2,334,958.720	
	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	2,385,000.000	2,460,246.750	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20101124	2,411,000.000	2,427,201.920	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20100324	2,594,000.000	2,593,818.420	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,335,414.960	
	4.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20110524	2,185,000.000	2,120,345.850	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,855,000.000	2,771,833.850	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20120425	2,697,000.000	2,631,651.690	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20130425	1,624,000.000	1,606,883.040	
	0% POLAND GOVERNMENT BOND 20100725	1,267,000.000	1,161,332.200	
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 22,710,000.000 (697,197,000)	ポーランド・ズロチ 22,443,687.400 (689,021,204)	
マレーシア・ リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	

	3.869% MALAYSIAN GOVERNMENT 20100413	1,755,000.000	1,774,041.750	
	3.756% MALAYSIAN GOVERNMENT 20110428	1,822,000.000	1,852,245.200	
	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	1,600,000.000	1,712,688.000	
	3.702% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130225	2,262,000.000	2,322,485.880	
	3.833% MALAYSIAN GOVERNMENT 20110928	1,569,000.000	1,601,337.090	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	2,108,000.000	2,263,127.720	
	3.718% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120615	1,356,000.000	1,385,791.320	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,046,373.650	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	1,532,000.000	1,490,896.440	
マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 15,019,000.000 (376,976,900)	マレーシア・リンギット 15,448,987.050 (387,769,575)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6% HELLENIC REPUBLIC 20100519	692,000.000	713,064.480	
	6.5% HELLENIC REPUBLIC 20140111	250,000.000	265,280.000	
	4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	1,388,763.870	
	5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,385,000.000	1,642,443.800	
	5% IRISH TREASURY 20130418	607,000.000	638,715.750	
	4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	998,000.000	1,064,157.420	
	5.35% HELLENIC REPUBLIC 20110518	913,000.000	932,419.510	
	4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20100131	2,613,000.000	2,655,722.550	
	5.25% HELLENIC REPUBLIC 20120518	781,000.000	792,363.550	
	8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	474,743.820	
	4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	684,668.050	
	5.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20110223	352,000.000	376,432.320	
	5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20120615	380,000.000	397,742.200	
	5.85% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20100520	486,000.000	506,339.100	
	8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20121224	791,000.000	924,204.400	
	5.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20130704	725,000.000	790,924.250	
	4.6% HELLENIC REPUBLIC 20130520	552,000.000	542,130.240	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20110730	1,145,000.000	1,216,470.900	
	6.5% HELLENIC REPUBLIC 20191022	823,000.000	915,612.190	
	5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20110928	842,000.000	886,356.560	
	4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	570,839.940	
	5.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20130923	322,000.000	346,397.940	
	4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	797,208.000	
	5.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20100115	608,000.000	629,061.120	
	4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	350,000.000	367,601.500	
	5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120730	953,000.000	1,011,218.770	

5.9% HELLENIC REPUBLIC 20221022	583,000.000	609,054.270	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20120928	910,000.000	961,688.000	
4% IRISH TREASURY 20111111	735,000.000	744,981.300	
2.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20100915	394,000.000	397,648.440	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,088,000.000	1,325,510.400	
5.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20110615	580,000.000	608,431.600	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	917,033.400	
3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	402,425.020	
4.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20140616	604,000.000	623,098.480	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,939,847.580	
5.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20100928	1,498,000.000	1,575,716.240	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20120915	559,000.000	582,863.710	
5.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20111031	1,411,000.000	1,501,275.780	
3.85% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20210415	654,000.000	646,962.960	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130928	1,243,000.000	1,286,753.600	
4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	580,602.000	
3.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20110415	492,000.000	493,554.720	
3.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20151015	305,000.000	297,899.600	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	872,000.000	904,979.040	
5.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20110104	513,000.000	540,378.810	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,869,383.880	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	424,000.000	420,510.480	
4.5% HELLENIC REPUBLIC 20370920	972,000.000	796,806.720	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121226	840,000.000	1,018,584.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20100328	702,000.000	707,180.760	
5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20120715	866,000.000	917,847.420	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130730	1,030,000.000	1,066,595.900	
4.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20161015	625,000.000	639,937.500	
4.5% HELLENIC REPUBLIC 20140520	639,000.000	620,481.780	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	1,828,897.500	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	578,000.000	733,013.820	
4.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20171016	563,000.000	581,753.530	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,111,142.900	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	1,240,000.000	1,298,453.600	

4.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20180615	440,000.000	457,441.600	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	942,285.530	
3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,165,030.150	
4.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20231025	661,000.000	717,297.370	
3.1% HELLENIC REPUBLIC 20100420	672,000.000	667,369.920	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	852,000.000	856,907.520	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	756,000.000	805,737.240	
3.7% HELLENIC REPUBLIC 20150720	789,000.000	732,878.430	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,064,719.150	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20100730	1,690,000.000	1,707,187.300	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130328	1,341,000.000	1,372,218.480	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	649,000.000	677,452.160	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	933,000.000	937,525.050	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,734,548.900	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	590,000.000	597,911.900	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	888,000.000	862,905.120	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	1,963,454.300	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20110328	459,000.000	465,090.930	
3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	831,000.000	824,767.500	
3.6% HELLENIC REPUBLIC 20160720	533,000.000	483,159.170	
6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	3,447,666.140	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	630,000.000	643,904.100	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	1,023,132.320	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20131020	1,191,000.000	1,216,380.210	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20121031	993,000.000	1,016,812.140	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	664,000.000	661,662.720	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	582,000.000	654,459.000	
3.9% HELLENIC REPUBLIC 20110820	755,000.000	743,010.600	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	844,000.000	800,863.160	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20110430	1,310,000.000	1,346,745.500	
4.3% HELLENIC REPUBLIC 20170720	875,000.000	823,611.250	
4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	929,207.070	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,524,218.630	
4.6% HELLENIC REPUBLIC 20400920	811,000.000	661,167.750	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	713,000.000	909,659.660	

4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	333,000.000	340,199.460	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	708,000.000	766,969.320	
4.7% HELLENIC REPUBLIC 20240320	1,016,000.000	904,209.520	
5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20101101	1,859,000.000	1,941,446.650	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	509,000.000	529,008.790	
4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140131	454,000.000	469,672.080	
4.1% HELLENIC REPUBLIC 20120820	610,000.000	592,956.600	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	587,000.000	607,674.140	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,302,000.000	1,619,336.460	
3.8% HELLENIC REPUBLIC 20110320	464,000.000	458,455.200	
4.6% HELLENIC REPUBLIC 20180720	760,000.000	724,941.200	
4% HELLENIC REPUBLIC 20130820	765,000.000	728,754.300	
6.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110425	1,673,000.000	1,827,166.950	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110801	1,816,000.000	1,899,917.360	
6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130131	1,255,000.000	1,389,197.150	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,694,000.000	2,063,224.240	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120201	3,012,000.000	3,125,974.080	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	734,000.000	924,920.740	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,868,000.000	3,356,076.240	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20100425	1,324,000.000	1,381,832.320	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20101025	1,337,000.000	1,414,358.820	
5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	2,020,210.400	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20111025	1,324,000.000	1,414,972.040	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	1,892,000.000	2,115,710.080	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130201	2,997,000.000	3,096,020.880	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120425	1,980,000.000	2,124,738.000	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,009,000.000	2,163,170.660	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	1,637,000.000	2,088,173.570	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121025	1,748,000.000	1,869,835.600	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	1,908,000.000	1,912,579.200	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130425	1,700,000.000	1,778,574.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20131025	2,028,000.000	2,123,478.240	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,750,596.840	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	2,246,828.850	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140425	1,509,000.000	1,579,470.300	

4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130801	2,519,000.000	2,567,112.900	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,866,348.820	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	1,936,156.690	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	1,794,000.000	1,914,431.220	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,253,255.030	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,787,000.000	1,903,387.310	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	1,585,000.000	1,621,455.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	1,847,000.000	1,831,983.890	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	1,611,000.000	1,605,699.810	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	1,752,000.000	1,769,152.080	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	2,332,000.000	2,338,879.400	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20100115	1,419,000.000	1,426,449.750	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,599,000.000	1,667,053.440	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	2,204,000.000	2,268,797.600	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,271,000.000	1,347,692.140	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	1,990,572.480	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,372,670.790	
2.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20100615	1,551,000.000	1,552,876.710	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	472,000.000	502,807.440	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20100112	1,666,000.000	1,682,560.040	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	2,143,525.080	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20100712	1,456,000.000	1,464,357.440	
6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	345,404.130	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	1,864,000.000	1,597,578.480	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110112	1,455,000.000	1,474,831.650	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	2,252,000.000	2,073,371.360	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110712	1,390,000.000	1,427,780.200	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110315	1,337,000.000	1,348,578.420	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	2,225,000.000	2,179,943.750	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120112	1,466,000.000	1,517,573.880	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120712	1,089,000.000	1,154,971.620	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110915	1,569,000.000	1,585,960.890	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130112	1,789,000.000	1,851,668.670	

4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	2,264,496.000	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20100912	2,209,000.000	2,265,263.230	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20100301	1,616,000.000	1,641,532.800	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130712	861,000.000	917,395.500	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	1,194,000.000	1,205,032.560	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20100801	2,049,000.000	2,098,667.760	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,968,000.000	2,011,807.680	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20121015	1,506,000.000	1,522,520.820	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	1,185,000.000	1,185,379.200	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110201	1,954,000.000	1,975,396.300	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	540,000.000	538,482.600	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	1,865,000.000	1,896,220.100	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100409	1,927,000.000	1,959,450.680	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130415	1,694,000.000	1,715,615.440	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20101008	1,611,000.000	1,625,869.530	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1,524,000.000	1,557,268.920	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110408	1,727,000.000	1,788,153.070	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	867,000.000	867,684.930	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20111014	2,029,000.000	2,110,504.930	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120413	1,815,000.000	1,910,795.700	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20121012	2,441,000.000	2,604,278.490	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130412	1,914,000.000	1,992,014.640	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131011	2,046,000.000	2,186,335.140	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20091211	1,238,000.000	1,262,462.880	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100312	1,420,000.000	1,438,019.800	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100611	1,814,000.000	1,885,653.000	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100910	2,350,000.000	2,429,430.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	741,000.000	967,434.780	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,450,831.910	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,630,000.000	2,025,356.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	962,000.000	1,090,956.100	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	985,180.000	
5.375% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100104	1,731,000.000	1,790,200.200	

6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,274,000.000	1,701,872.900	
5.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100704	1,741,000.000	1,824,689.870	
5.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110104	2,052,000.000	2,187,924.480	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	740,000.000	891,714.800	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,567,000.000	1,936,232.210	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110704	2,633,000.000	2,826,393.850	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120104	3,326,000.000	3,594,973.620	
5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20110715	1,032,000.000	1,096,603.200	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120704	2,935,000.000	3,188,290.500	
4.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130104	2,774,000.000	2,984,574.340	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130704	1,909,000.000	2,012,086.000	
5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20120715	1,033,000.000	1,106,983.460	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	2,481,214.140	
4.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130715	941,000.000	987,683.010	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140104	2,190,000.000	2,370,171.300	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	2,946,640.840	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	857,000.000	880,987.430	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,212,073.910	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,559,000.000	2,734,828.890	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,061,220.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20100715	1,017,000.000	1,066,232.970	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,616,072.600	
3% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20100115	1,007,000.000	1,015,932.090	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	2,810,815.560	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,308,889.500	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	838,000.000	834,958.060	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,463,755.100	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	838,000.000	871,008.820	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,298,929.750	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	1,948,186.940	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	739,000.000	764,421.600	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	1,851,000.000	2,049,871.440	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	683,000.000	683,300.520	

	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	428,000.000	520,045.680	
	4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	974,000.000	1,038,537.240	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	1,148,000.000	1,225,765.520	
	4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20110115	1,172,000.000	1,210,383.000	
	4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	732,000.000	753,484.200	
	ユーロ 小計	ユーロ 306,673,000.000 (38,668,398,570)	ユーロ 324,129,543.860 (40,869,494,185)	
国債証券 合計		69,285,907,790 [69,285,907,790]	76,127,725,124 [76,127,725,124]	
合計		69,285,907,790 [69,285,907,790]	76,127,725,124 [76,127,725,124]	

[次へ](#)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 133銘柄	100%	30.5%
イギリス・ポンド	国債証券 30銘柄	100%	8.6%
オーストラリア・ドル	国債証券 6銘柄	100%	0.4%
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	100%	2.3%
シンガポール・ドル	国債証券 15銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券 9銘柄	100%	0.8%
スウェーデン・クローナ	国債証券 9銘柄	100%	0.7%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券 4銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 10銘柄	100%	0.9%
マレーシア・リンギット	国債証券 9銘柄	100%	0.5%
ユーロ	国債証券 234銘柄	100%	53.7%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成21年1月30日

I 資産総額	2,964,486円
II 負債総額	2,580円
III 純資産総額（I－II）	2,961,906円
IV 発行済数量	4,762,463口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.6219円

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド
純資産額計算書

平成21年1月30日

I 資産総額	70,346,636,126円
II 負債総額	118,626,568円
III 純資産総額（I－II）	70,228,009,558円
IV 発行済数量	171,516,711,009口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.4095円

（参考）外国株式インデックスマザーファンド
純資産額計算書

平成21年1月30日

I 資産総額	29,714,339,474円
II 負債総額	323,090,371円
III 純資産総額（I－II）	29,391,249,103円
IV 発行済数量	47,964,562,068口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.6128円

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド
純資産額計算書

平成21年1月30日

I 資産総額	20,087,826,008円
II 負債総額	81,055,489円
III 純資産総額（I－II）	20,006,770,519円
IV 発行済数量	23,494,011,214口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.8516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21年1月30日

I 資産総額	258,876,221円
II 負債総額	3,126,754円

Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	255,749,467円
Ⅳ 発行済数量	466,579,482口
Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.5481円

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰⅠ）
純資産額計算書

平成21年1月30日

Ⅰ 資産総額	10,133,252,249円
Ⅱ 負債総額	281,210,000円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,852,042,249円
Ⅳ 発行済数量	9,295,858,386口
Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0598円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド
純資産額計算書

平成21年1月30日

Ⅰ 資産総額	76,580,290,523円
Ⅱ 負債総額	475,857,690円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	76,104,432,833円
Ⅳ 発行済数量	45,284,260,193口
Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6806円

第5 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	8,866,423	5,677,066

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

第三部 【特別情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成21年1月末日現在、資本金の額は151億7,427万2,500円です。なお、発行可能株式総数は799万9,980株であり、260万8,525株を発行済みです。

b. 委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

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

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

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

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者である運用本部長（C I O）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

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

けて、必要事項を審議・決定します。

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成21年1月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（公募）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	13	42,958
追加型株式投資信託	256	4,325,892
株式投資信託 合計	269	4,368,850
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	3,009,344
公社債投資信託 合計	17	3,009,344
総合計	286	7,378,194

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、第48期（平成18年4月1日から平成19年3月31日まで）については、改正前の「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、「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」（平成12年総理府令第129号）に基づいて作成しており、第49期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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

2. 当社は、証券取引法第193条の2の規定に基づき、第48期事業年度（平成18年4月1日から平成19年3月31日まで）の財務諸表について、並びに、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第50期事業年度に係る中間会計期間（平成20年4月1日から平成20年9月30日まで）の中間財務諸表について、あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1)【貸借対照表】

		第48期 (平成19年3月31日現在)		第49期 (平成20年3月31日現在)	
区分	注記 番号	金額（千円）	構成比 (%)	金額（千円）	構成比 (%)
(資産の部)					
流動資産					
現金		797		915	
預金		3,286,544		3,397,966	
有価証券		29,144,223		32,206,041	
支払委託金		2,039,370		—	
収益分配金		757,956		—	
償還金		1,281,413		—	
前払金		30		3,357	
前払費用		79,358		96,205	
未収入金		38,983		75,494	
未収委託者報酬		9,621,508		8,899,037	
未収収益		56,871		136,888	
貯蔵品		146,207		83,453	
繰延税金資産		731,054		779,955	
デリバティブ資産		—		1,172,830	
その他	※1	11,654		30,104	
流動資産計		45,156,603	76.3	46,882,252	79.0
固定資産					
有形固定資産	※2	1,824,086	3.1	1,618,595	2.7
建物		499,267		388,414	

器具備品		907,818			1,229,446		
土地		417,000			—		
建設仮勘定		—			735		
無形固定資産	※ 3		1,404,601	2.4		1,989,254	3.3
ソフトウェア		1,191,767			1,976,209		
電話加入権		11,850			11,850		
その他		200,983			1,194		
投資その他の資産			10,795,565	18.2		8,890,810	15.0
投資有価証券		9,007,705			7,690,544		
関係会社株式		737,012			737,012		
出資金		226,126			166,719		
従業員長期貸付金		189,497			176,298		
長期差入保証金		627,430			633,855		
長期前払費用		10,287			10,039		
投資不動産	※ 2	—			593,270		
その他		506			43		
貸倒引当金	※ 6	△3,000			△1,116,972		
固定資産計			14,024,253	23.7		12,498,661	21.0
資産合計			59,180,856	100.0		59,380,914	100.0
(負債の部)							
流動負債							
預り金			43,592			50,693	
未払金	※ 4		11,692,067			10,302,751	
未払収益分配金		777,951			27,011		
未払償還金		1,761,987			332,721		
未払手数料		5,424,512			4,943,985		
その他未払金		3,727,616			4,999,033		
未払費用			2,393,500			2,177,782	
未払法人税等	※ 5		1,512,583			1,402,832	
未払消費税等			538,138			425,013	
前受金			348			329	
前受収益			66,100			39,700	
賞与引当金			838,700			480,300	
その他			—			21,767	
流動負債計			17,085,031	28.9		14,901,170	25.1
固定負債							
退職給付引当金			858,904			988,898	
役員退職慰労引当金			78,307			46,260	
繰延税金負債			1,915,808			2,300,289	
固定負債計			2,853,020	4.8		3,335,448	5.6
負債合計			19,938,052	33.7		18,236,618	30.7
(純資産の部)							
株主資本							
資本金			15,174,272	25.7		15,174,272	25.6
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	19.4		11,495,727	19.4
利益剰余金							
利益準備金		374,297			374,297		
その他利益剰余金							
特別償却準備金		2,261			—		

別途積立金		2,800,000			2,800,000		
繰越利益剰余金		8,834,028			11,702,152		
利益剰余金合計			12,010,588	20.3		14,876,450	25.0
株主資本合計			38,680,588	65.4		41,546,450	70.0
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金			562,216	0.9		△402,154	△0.7
評価・換算差額等合計			562,216	0.9		△402,154	△0.7
純資産合計			39,242,804	66.3		41,144,295	69.3
負債・純資産合計			59,180,856	100.0		59,380,914	100.0

(2) 【損益計算書】

		第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)			第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)		
区分	注記 番号	金額（千円）		百分比 (%)	金額（千円）		百分比 (%)
営業収益							
委託者報酬			58,445,063			82,506,998	
その他営業収益			488,432			572,557	
営業収益計			58,933,495	100.0		83,079,556	100.0
営業費用							
支払手数料			33,691,905			48,784,763	
広告宣伝費			1,415,258			1,542,009	
公告費			10,794			9,189	
受益証券発行費			96,932			41,501	
調査費			2,094,056			4,197,737	
調査費		555,078			672,732		
委託調査費		1,538,978			3,525,004		
委託計算費			472,577			642,326	
営業雑経費			1,583,497			2,103,482	
通信費		226,689			283,069		
印刷費		644,336			918,929		
協会費		32,902			40,717		
諸会費		10,168			10,258		
その他営業雑経費		669,400			850,507		
営業費用計			39,365,023	66.8		57,321,011	69.0
一般管理費							
給料			4,174,588			4,208,378	
役員報酬	※ 1	181,200			185,100		
給料・手当		2,718,896			3,139,424		
賞与		435,791			403,553		
賞与引当金繰入		838,700			480,300		
福利厚生費			471,209			548,953	
交際費			58,204			85,291	
寄付金			1,176			1,796	
旅費交通費			170,180			231,428	
租税公課			306,177			427,247	
不動産賃借料			646,084			666,919	
退職給付費用			272,142			309,416	
役員退職慰労引当金繰入			32,640			33,405	
固定資産減価償却費			406,515			713,538	
諸経費			769,819			1,349,328	
一般管理費計			7,308,737	12.4		8,575,704	10.3
営業利益			12,259,734	20.8		17,182,840	20.7
営業外収益							
受取配当金			482,340			205,108	
有価証券利息			63,198			473,605	
受取利息			4,536			4,674	
時効成立分配金・償還金			351,463			117,919	
有価証券償還益			24,360			226,585	

デリバティブ評価益			—			1,150,268	
その他			29,318			27,266	
営業外収益計			955,218	1.6		2,205,428	2.6
営業外費用							
時効成立後支払分配金・償還金			49,097			58,372	
貯蔵品廃棄損			149,447			161,462	
為替差損			—			1,632,650	
その他			730			41,095	
営業外費用計			199,275	0.3		1,893,580	2.3
経常利益			13,015,678	22.1		17,494,688	21.0
特別利益							
投資有価証券売却益	※ 2		5,512,833			2,241,103	
固定資産売却益	※ 3		624			—	
ゴルフ会員権売却益			—			13,021	
ゴルフ会員権償還益			18,663			—	
その他	※ 4		4,119			—	
特別利益計			5,536,240	9.4		2,254,124	2.7
特別損失							
投資有価証券売却損			249,585			21,921	
固定資産除売却損	※ 5		143,860			44,642	
減損損失	※ 6		2,184,523			—	
貸倒引当金繰入額	※ 7		—			1,113,972	
その他	※ 8		47,357			3,737	
特別損失計			2,625,326	4.5		1,184,273	1.4
税引前当期純利益			15,926,592	27.0		18,564,539	22.3
法人税、住民税及び事業税		5,557,969			6,901,995		
法人税等調整額		1,708,825	7,266,795	12.3	997,192	7,899,187	9.5
当期純利益			8,659,797	14.7		10,665,351	12.8

(3) 【株主資本等変動計算書】

第48期（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金	利益剰余金					株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
				特別償却 準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
前期末残高	15, 174, 272	11, 495, 727	374, 297	15, 917	6, 500, 000	4, 124, 184	11, 014, 399	37,684, 399
事業年度中の変動額								
特別償却準備金の取崩し （主）	-	-	-	△6, 827	-	6, 827	-	-
特別償却準備金の取崩し	-	-	-	△6, 827	-	6, 827		
別途積立金 の取崩し（主）	-	-	-	-	△3, 700, 000	3, 700, 000	-	-
剰余金の配当（主）	-	-	-	-	-	△7, 499, 509	△7, 499, 509	△7,499, 509
役員賞与（主）	-	-	-	-	-	△164, 100	△164, 100	△164, 100
当期純利益	-	-	-	-	-	8, 659, 797	8, 659, 797	8,659, 797
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-
事業年度中の変動額合計	-	-	-	△13, 655	△3, 700, 000	4, 709, 844	996, 188	996, 188
事業年度末残高	15, 174, 272	11, 495, 727	374, 297	2, 261	2, 800, 000	8, 834, 028	12, 010, 588	38,680, 588

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
前期末残高	564,295	564,295	38,248,695
事業年度中の変動額			
特別償却準備金の取崩し（主）	-	-	-
特別償却準備金の取崩し	-	-	-
別途積立金の取崩し（主）	-	-	-
剰余金の配当（主）	-	-	△7,499,509
役員賞与（主）	-	-	△164,100
当期純利益	-	-	8,659,797
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）	△2,079	△2,079	△2,079
事業年度中の変動額合計	△2,079	△2,079	994,109
事業年度末残高	562,216	562,216	39,242,804

（主）平成18年6月の定時株主総会における利益処分項目であります。

第49期（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							株主資本合計
	資本金	資本剰余金 資本準備金	利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
				その他利益剰余金		繰越利益 剰余金		
				特別償却 準備金	別途積立金			
前事業年度末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	2,261	2,800,000	8,834,028	12,010,588	38,680,588
事業年度中の変動額								
特別償却準備金の取崩し	-	-	-	△2,261	-	2,261	-	-
剰余金の配当	-	-	-	-	-	△7,799,489	△7,799,489	△7,799,489
当期純利益	-	-	-	-	-	10,665,351	10,665,351	10,665,351
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-
事業年度中の変動額合計	-	-	-	△2,261	-	2,868,123	2,865,862	2,865,862
事業年度末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	-	2,800,000	11,702,152	14,876,450	41,546,490

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
前事業年度末残高	562,216	562,216	39,242,804
事業年度中の変動額			
特別償却準備金の取崩し	-	-	-
剰余金の配当	-	-	△7,799,489
当期純利益	-	-	10,665,351
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）	△964,370	△964,370	△964,370
事業年度中の変動額合計	△964,370	△964,370	1,901,491
事業年度末残高	△402,154	△402,154	41,144,295

重要な会計方針

期別	第48期 （自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）	第49期 （自 平成19年4月1日 至 平成20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 (2) その他有価証券 時価のあるものについては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）、時価のないものについては移動平均法による原価法で計上しております。 -----	(1) 子会社及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 同左 (3) デリバティブ取引 時価法により計上しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

- (1) 有形固定資産
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 | 7～50年 |
| 器具備品 | 5～10年 |

- (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 | 7～50年 |
| 器具備品 | 5～10年 |
- (会計方針の変更)
法人税法の改正（（所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日 法律第6号）及び（法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号））に伴い、当事業年度より、平成19年4月1日以降に取得したものについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。
当該変更に伴う損益に与える影響は、軽微であります。

- (追加情報)
当事業年度より、平成19年3月31日以前に取得したものについては、償却可能限度額まで償却が終了した翌年から5年間で均等償却する方法によっております。
当該変更に伴う損益に与える影響は、軽微であります。

- (2) 無形固定資産
定額法によっております。ただし、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

- (2) 無形固定資産
同左

- (3) 長期前払費用
定額法によっております。

- (3) 長期前払費用
同左

3. 引当金の計上基準

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

4. リース取引の処理方法 5. その他財務諸表作成のための重要な事項	(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期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会計期間末要支給額を計上しております。 (4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当期末要支給額を計上しております。 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。 (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。ただし、固定資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は投資その他の資産に計上し、5年間で均等償却を行なっております。 (2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。	(3) 退職給付引当金 同左 (4) 役員退職慰労引当金 同左 同左 (1) 消費税等の会計処理 同左 (2) 連結納税制度の適用 同左
---	--	---

会計方針の変更

期別	第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
----	---------------------------------------	---------------------------------------

1. 会計処理の変更	(1)貸借対照表の「純資産の部」の表示 当事業年度より「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」（企業会計基準第5号 平成17年12月9日）及び「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」（企業会計基準適用指針第8号 平成17年12月9日）を適用しております。 従来の資本の部の合計に相当する金額は、39,242,804千円であります。 なお、当事業年度における貸借対照表の純資産の部については、財務諸表等規則の改正に伴い、改正後の財務諸表等規則により作成しております。 (2)役員賞与の会計処理 当事業年度より「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第4号 平成17年11月29日）を適用しております。 この結果、従来の方法に比べて、営業利益、経常利益、税引前当期純利益がそれぞれ124,400千円減少しております。	----- -----
-------------------	--	---------------------------

注記事項

（貸借対照表関係）

第48期 (平成19年3月31日現在)	第49期 (平成20年3月31日現在)																				
※1 流動資産の「その他」の中には顧客分別金信託に伴う金銭の信託が10,000千円含まれております。 ※2 有形固定資産の減価償却累計額 <table data-bbox="239 1612 638 1702"> <tr> <td>建物</td><td>1,340,367千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>1,994,292千円</td></tr> </table> ※3 無形固定資産の減価償却累計額 <table data-bbox="159 1859 718 1937"> <tr> <td>ソフトウェア</td><td>469,143千円</td></tr> <tr> <td>その他（電話施設利用権）</td><td>5,638千円</td></tr> </table> ※4 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 3,664,317千円	建物	1,340,367千円	器具備品	1,994,292千円	ソフトウェア	469,143千円	その他（電話施設利用権）	5,638千円	※1 流動資産の「その他」の中には顧客分別金信託に伴う金銭の信託が1,000千円含まれております。 ※2 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額 <table data-bbox="877 1612 1356 1758"> <tr> <td>建物</td><td>735,161千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>1,604,537千円</td></tr> <tr> <td>投資建物</td><td>662,012千円</td></tr> <tr> <td>投資器具備品</td><td>26,457千円</td></tr> </table> ※3 無形固定資産の減価償却累計額 <table data-bbox="877 1859 1356 1937"> <tr> <td>ソフトウェア</td><td>888,263千円</td></tr> <tr> <td>その他（電話施設利用権）</td><td>5,927千円</td></tr> </table> ※4 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 4,620,908千円	建物	735,161千円	器具備品	1,604,537千円	投資建物	662,012千円	投資器具備品	26,457千円	ソフトウェア	888,263千円	その他（電話施設利用権）	5,927千円
建物	1,340,367千円																				
器具備品	1,994,292千円																				
ソフトウェア	469,143千円																				
その他（電話施設利用権）	5,638千円																				
建物	735,161千円																				
器具備品	1,604,537千円																				
投資建物	662,012千円																				
投資器具備品	26,457千円																				
ソフトウェア	888,263千円																				
その他（電話施設利用権）	5,927千円																				

※ 5 未払法人税等の内訳は次の諸税金の未納付額であります。 <table> <tr> <td>住民税</td><td>641,341千円</td></tr> <tr> <td>事業税</td><td>871,241千円</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>1,512,583千円</td></tr> </table> ----- -----	住民税	641,341千円	事業税	871,241千円	合計	1,512,583千円	※ 5 未払法人税等の内訳は次の諸税金の未納付額であります。 <table> <tr> <td>住民税</td><td>585,947千円</td></tr> <tr> <td>事業税</td><td>816,884千円</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>1,402,832千円</td></tr> </table> ※ 6 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。 7 債務保証 当社は、子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務145,120千円に対して保証を行っております。	住民税	585,947千円	事業税	816,884千円	合計	1,402,832千円
住民税	641,341千円												
事業税	871,241千円												
合計	1,512,583千円												
住民税	585,947千円												
事業税	816,884千円												
合計	1,402,832千円												

（損益計算書関係）

第48期 （自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）	第49期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）																								
※ 1 役員報酬の範囲額 <table> <tr> <td>取締役 月額</td><td>35,000千円</td></tr> <tr> <td>監査役 月額</td><td>6,000千円</td></tr> </table> ※ 2 関係会社との取引 投資有価証券売却益 4,851,726千円 ※ 3 固定資産売却益の内容は次のとおりであります。 <table> <tr> <td>車両</td><td>624千円</td></tr> </table> ※ 4 特別利益の「その他」の主な内訳 ゴルフ会員権貸倒引当金戻入 4,119千円 ※ 5 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。 <table> <tr> <td>固定資産売却損</td><td></td></tr> <tr> <td>建物</td><td>106,013千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>155千円</td></tr> <tr> <td>土地</td><td>19,875千円</td></tr> <tr> <td>固定資産除却損</td><td></td></tr> <tr> <td>建物</td><td>425千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>17,390千円</td></tr> </table>	取締役 月額	35,000千円	監査役 月額	6,000千円	車両	624千円	固定資産売却損		建物	106,013千円	器具備品	155千円	土地	19,875千円	固定資産除却損		建物	425千円	器具備品	17,390千円	※ 1 同左 ※ 2 関係会社との取引 投資有価証券売却益 2,067,950千円 ----- ----- ※ 5 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。 <table> <tr> <td>固定資産除却損</td><td></td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>44,642千円</td></tr> </table>	固定資産除却損		器具備品	44,642千円
取締役 月額	35,000千円																								
監査役 月額	6,000千円																								
車両	624千円																								
固定資産売却損																									
建物	106,013千円																								
器具備品	155千円																								
土地	19,875千円																								
固定資産除却損																									
建物	425千円																								
器具備品	17,390千円																								
固定資産除却損																									
器具備品	44,642千円																								

※ 6 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 福利厚生施設（大和投信浦安寮）

種類 建物及び土地

「浦安寮」についての位置付けを大和証券グループの補完的な寮としたことに伴い賃貸資産に区分され、資産区分は従来の「本社」のみのグルーピングから「本社」と「浦安寮」の2つのグルーピングへと変更しました。

「浦安寮」については、市場価格が大幅に下落しており、将来キャッシュフローが帳簿価格を大幅に下回るため、当該減少額を減損損失（2,184,523千円）として特別損失に計上しました。その内訳は、建物136,118千円及び土地2,048,404千円であります。

なお、当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、建物及び土地については不動産鑑定評価額により評価しております。

※ 7 貸倒引当金繰入額に関する注記

保有している外貨建資産担保債券の1銘柄について、清算事象が生じているため、当該銘柄の回収不能見込額を算定し、その見積金額を貸倒引当金として計上しております。

なお、貸倒引当金の計上基準については重要な会計方針に記載しております。

※ 8 特別損失の「その他」の主な内訳

貯蔵品評価損 47,333千円
ゴルフ会員権売却損 24千円

※ 8 特別損失の「その他」の主な内訳

会社清算損 3,069千円
保証金の返還に伴う損失 668千円

（株主資本等変動計算書関係）

第48期（自 平成18年4月1日 至 平成19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18年6月23日 定時株主総会	普通株式	7,499	2,875	平成18年 3月31日	平成18年 6月23日
----------------------	------	-------	-------	----------------	----------------

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

平成19年6月22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。

- ①剰余金の配当の総額 7,799百万円
- ②配当の原資 利益剰余金
- ③1株当たり配当額 2,990円
- ④基準日 平成19年3月31日
- ⑤効力発生日 平成19年6月25日

第49期（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	前事業年度末 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19年6月22日 定時株主総会	普通株式	7,799	2,990	平成19年 3月31日	平成19年 6月25日

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

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

- ①剰余金の配当の総額 8,555百万円
- ②配当の原資 利益剰余金
- ③1株当たり配当額 3,280円
- ④基準日 平成20年3月31日
- ⑤効力発生日 平成20年6月23日

（リース取引関係）

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
---------------------------------------	---------------------------------------

月価金分帳目書（リース取引）

（借主側）

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

①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

	器具備品	ソフトウェア	合計
取得価額相当額（千円）	7,852	—	7,852
減価償却累計額相当額（千円）	6,056	—	6,056
期末残高相当額（千円）	1,796	—	1,796

なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。

②未経過リース料期末残高相当額

1年以内1,796千円

1年超—千円

合計1,796千円

なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。

③支払リース料及び減価償却費相当額

支払リース料2,395千円

減価償却費相当額2,395千円

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。

（借主側）

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

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1,796千円

減価償却費相当額1,796千円

④減価償却費相当額の算定方法

同左

（有価証券関係）

1. その他有価証券で時価のあるもの

区分	第48期 (平成19年3月31日現在)			第49期 (平成20年3月31日現在)		
	取得原価 (千円)	貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)	取得原価 (千円)	貸借対照表 計上額 (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	55,101	218,472	163,370	55,101	73,804	18,702
②債券	150,000	156,075	6,075	50,000	50,105	105
③その他						
証券投資信託の受益証券	3,944,950	4,764,879	819,929	3,110,512	3,238,991	128,479
小計	4,150,051	5,139,426	989,374	3,215,614	3,362,900	147,286
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの						

①債券	—	—	—	13,669,870	11,886,801	△1,783,068
②その他						
証券投資信託の受益証券	1,407,010	1,372,161	△34,848	2,816,910	2,591,485	△225,424
小計	1,407,010	1,372,161	△34,848	16,486,780	14,478,287	△2,008,493
合計	5,557,062	6,511,588	954,525	19,702,395	17,841,188	△1,861,206

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
売却額（千円）	8,446,553	3,892,206
売却益の合計額（千円）	5,512,833	2,241,103
売却損の合計額（千円）	249,585	21,921

3. 時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

区分	第48期 (平成19年3月31日現在)	第49期 (平成20年3月31日現在)
	貸借対照表計上額 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)
子会社株式及び関連会社株式		
子会社株式	737,012	737,012
小計	737,012	737,012
その他有価証券		
非上場株式	2,496,117	1,314,612
外貨建資産担保債券	—	2,504,860
MMF・中期国債ファンド・FFF	29,144,223	18,235,925
小計	31,640,341	22,055,397
合計	32,377,353	22,792,409

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

第48期（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

	1年以内（千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超（千円）
①債券				
社債	—	150,000	—	—
②その他				
証券投資信託の 受益証券	—	1,022,721	1,916,922	505,933
合計	—	1,172,721	1,916,922	505,933

第49期（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

	1年以内（千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超（千円）
①債券				
社債	150,000	—	—	—
その他	13,569,000	—	—	—

②その他 証券投資信託の 受益証券	1,023,578	434,463	1,611,490	86,955
合計	14,742,578	434,463	1,611,490	86,955

5. デリバティブ取引関係

(1) 取引の状況に関する事項

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
-----	1. 取引の内容及び利用目的 当社が利用しているデリバティブ取引は為替予約取引であり、当社が保有する外貨建資産担保債券に係る為替変動リスクを軽減するために利用しております。 2. 取引に対する取組方針 為替予約取引については将来の為替変動リスクの軽減を目的としているため、対象資産である外貨建資産担保債券の保有残高の範囲内で行うこととしており、投機目的ではありません。 3. 取引に係るリスクの内容 為替予約取引に係るリスクとして、為替相場の変動による市場リスクを有しております。また、信用度の高い国内大手証券会社を取引先としており、取引先の契約不履行に係る信用リスクはほとんどないと判断しております。 4. 取引に係るリスク管理体制 為替予約取引開始にあたっては、事前に取り締役会等の会議体にて承認を得ることとしております。 なお、事後体制としまして、財務部長は毎月、為替予約取引の内容を含んだ財務報告を執行役員会議で行っております。また、財務部内にて取引の状況について適切に把握、管理しております。

(2) 取引の時価等に関する事項

区分	種類	第48期 (平成19年3月31日現在)			第49期 (平成20年3月31日現在)		
		契約額等 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)	契約額等 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	為替予約取引	—	—	—	16,334,748	1,150,268	1,150,268

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

(退職給付関係)

第48期 (平成19年3月31日現在)	第49期 (平成20年3月31日現在)												
1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。 2. 退職給付債務に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>858,904千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>858,904千円</td></tr> </table> 3. 退職給付費用に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付費用</td><td>272,142千円</td></tr> </table> なお、退職給付費用の中には勤務費用のほか、確定拠出年金への掛金支払額92,983千円が含まれております。	退職給付債務	858,904千円	退職給付引当金	858,904千円	退職給付費用	272,142千円	1. 採用している退職給付制度の概要 同左 2. 退職給付債務に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>988,898千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>988,898千円</td></tr> </table> 3. 退職給付費用に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付費用</td><td>309,416千円</td></tr> </table> なお、退職給付費用の中には勤務費用のほか、確定拠出年金への掛金支払額106,630千円が含まれております。	退職給付債務	988,898千円	退職給付引当金	988,898千円	退職給付費用	309,416千円
退職給付債務	858,904千円												
退職給付引当金	858,904千円												
退職給付費用	272,142千円												
退職給付債務	988,898千円												
退職給付引当金	988,898千円												
退職給付費用	309,416千円												

(税効果会計関係)

第48期 (平成19年3月31日現在)	第49期 (平成20年3月31日現在)																																																																																																		
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳 <table> <tr> <td>繰延税金資産</td><td>千円</td></tr> <tr> <td>減損損失否認</td><td>888,882</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>354,508</td></tr> <tr> <td>退職給与引当金繰入限度超過額</td><td>349,488</td></tr> <tr> <td>投資有価証券評価損否認</td><td>345,773</td></tr> <tr> <td>賞与引当金繰入限度超過額</td><td>341,267</td></tr> <tr> <td>株式譲渡損繰延</td><td>155,151</td></tr> <tr> <td>出資金評価損否認</td><td>120,830</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>38,093</td></tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td><td>31,863</td></tr> <tr> <td>前受収益</td><td>26,896</td></tr> <tr> <td>社会保険料否認</td><td>22,249</td></tr> <tr> <td>貯蔵品評価損否認</td><td>19,259</td></tr> <tr> <td>ソフトウェア開発費否認</td><td>11,524</td></tr> <tr> <td>一括償却資産</td><td>7,700</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>20,899</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>2,734,388</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>△1,542,565</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>1,191,823</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr> <td>株式譲渡益</td><td>△1,986,751</td></tr> <tr> <td>有価証券評価差額</td><td>△385,711</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>△4,113</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>△2,376,577</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債の純額</td><td>1,184,754</td></tr> </table>	繰延税金資産	千円	減損損失否認	888,882	未払事業税	354,508	退職給与引当金繰入限度超過額	349,488	投資有価証券評価損否認	345,773	賞与引当金繰入限度超過額	341,267	株式譲渡損繰延	155,151	出資金評価損否認	120,830	器具備品	38,093	役員退職慰労引当金	31,863	前受収益	26,896	社会保険料否認	22,249	貯蔵品評価損否認	19,259	ソフトウェア開発費否認	11,524	一括償却資産	7,700	その他	20,899	繰延税金資産小計	2,734,388	評価性引当額	△1,542,565	繰延税金資産合計	1,191,823	繰延税金負債		株式譲渡益	△1,986,751	有価証券評価差額	△385,711	その他	△4,113	繰延税金負債合計	△2,376,577	繰延税金負債の純額	1,184,754	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 <table> <tr> <td>繰延税金資産</td><td>千円</td></tr> <tr> <td>減損損失否認</td><td>887,301</td></tr> <tr> <td>貸倒引当金否認</td><td>454,496</td></tr> <tr> <td>退職給与引当金繰入限度超過額</td><td>402,382</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>332,390</td></tr> <tr> <td>株式譲渡損繰延</td><td>287,965</td></tr> <tr> <td>有価証券評価差額</td><td>275,900</td></tr> <tr> <td>投資有価証券評価損否認</td><td>214,784</td></tr> <tr> <td>賞与引当金繰入限度超過額</td><td>168,660</td></tr> <tr> <td>出資金評価損否認</td><td>118,268</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>38,093</td></tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td><td>18,823</td></tr> <tr> <td>社会保険料否認</td><td>18,208</td></tr> <tr> <td>前受収益</td><td>16,153</td></tr> <tr> <td>一括償却資産</td><td>10,048</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>23,392</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>3,266,871</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>△1,947,529</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>1,319,341</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr> <td>株式譲渡益</td><td>△2,837,113</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>△2,562</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>△2,839,675</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債の純額</td><td>1,520,333</td></tr> </table>	繰延税金資産	千円	減損損失否認	887,301	貸倒引当金否認	454,496	退職給与引当金繰入限度超過額	402,382	未払事業税	332,390	株式譲渡損繰延	287,965	有価証券評価差額	275,900	投資有価証券評価損否認	214,784	賞与引当金繰入限度超過額	168,660	出資金評価損否認	118,268	器具備品	38,093	役員退職慰労引当金	18,823	社会保険料否認	18,208	前受収益	16,153	一括償却資産	10,048	その他	23,392	繰延税金資産小計	3,266,871	評価性引当額	△1,947,529	繰延税金資産合計	1,319,341	繰延税金負債		株式譲渡益	△2,837,113	その他	△2,562	繰延税金負債合計	△2,839,675	繰延税金負債の純額	1,520,333
繰延税金資産	千円																																																																																																		
減損損失否認	888,882																																																																																																		
未払事業税	354,508																																																																																																		
退職給与引当金繰入限度超過額	349,488																																																																																																		
投資有価証券評価損否認	345,773																																																																																																		
賞与引当金繰入限度超過額	341,267																																																																																																		
株式譲渡損繰延	155,151																																																																																																		
出資金評価損否認	120,830																																																																																																		
器具備品	38,093																																																																																																		
役員退職慰労引当金	31,863																																																																																																		
前受収益	26,896																																																																																																		
社会保険料否認	22,249																																																																																																		
貯蔵品評価損否認	19,259																																																																																																		
ソフトウェア開発費否認	11,524																																																																																																		
一括償却資産	7,700																																																																																																		
その他	20,899																																																																																																		
繰延税金資産小計	2,734,388																																																																																																		
評価性引当額	△1,542,565																																																																																																		
繰延税金資産合計	1,191,823																																																																																																		
繰延税金負債																																																																																																			
株式譲渡益	△1,986,751																																																																																																		
有価証券評価差額	△385,711																																																																																																		
その他	△4,113																																																																																																		
繰延税金負債合計	△2,376,577																																																																																																		
繰延税金負債の純額	1,184,754																																																																																																		
繰延税金資産	千円																																																																																																		
減損損失否認	887,301																																																																																																		
貸倒引当金否認	454,496																																																																																																		
退職給与引当金繰入限度超過額	402,382																																																																																																		
未払事業税	332,390																																																																																																		
株式譲渡損繰延	287,965																																																																																																		
有価証券評価差額	275,900																																																																																																		
投資有価証券評価損否認	214,784																																																																																																		
賞与引当金繰入限度超過額	168,660																																																																																																		
出資金評価損否認	118,268																																																																																																		
器具備品	38,093																																																																																																		
役員退職慰労引当金	18,823																																																																																																		
社会保険料否認	18,208																																																																																																		
前受収益	16,153																																																																																																		
一括償却資産	10,048																																																																																																		
その他	23,392																																																																																																		
繰延税金資産小計	3,266,871																																																																																																		
評価性引当額	△1,947,529																																																																																																		
繰延税金資産合計	1,319,341																																																																																																		
繰延税金負債																																																																																																			
株式譲渡益	△2,837,113																																																																																																		
その他	△2,562																																																																																																		
繰延税金負債合計	△2,839,675																																																																																																		
繰延税金負債の純額	1,520,333																																																																																																		

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳				2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳			
法定実効税率 (調整)		40.69%		法定実効税率 (調整)		40.69%	
交際費等永久に損金に算入されない項目		0.15		交際費等永久に損金に算入されない項目		0.20	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目		△0.34		受取配当金等永久に益金に算入されない項目		△0.52	
住民税均等割		0.03		住民税均等割		0.02	
評価性引当額		5.03		評価性引当額		2.45	
その他		0.05		その他		△0.29	
税効果会計適用後の法人税等の負担率		45.62		税効果会計適用後の法人税等の負担率		42.55	

(関連当事者との取引)

第48期（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

1. 親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	178,324	持ち株会社	100.0	役員2人	経営管理	有価証券の売却 売却代金 売却益	5,590,761 4,851,726	— —	— —

2. 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	証券業	—	なし	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	23,821,581	未払手数料	4,396,864
親会社の子会社	大和証券エスエムビーシー(株)	東京都千代田区	255,700	証券業	—	なし	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	1,072,285	未払手数料	102,859

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
- (2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

第49期（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

1. 親会社及び法人主要株主等

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 兄弟会社等

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
1株当たり純資産額 15,044.05円 1株当たり当期純利益 3,319.80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いません。	1株当たり純資産額 15,773.01円 1株当たり当期純利益 4,088.65円 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。

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
---------------------------------------	---------------------------------------

当期純利益（千円）	8,659,797	10,665,351
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）

第48期 （自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）	第49期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）
該当事項はありません。	同左

[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20年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,584,194
有価証券		26,251,951
未収委託者報酬		8,211,233
貯蔵品		68,984
繰延税金資産		356,572
デリバティブ資産		31,948
その他		199,363
流動資産計		38,704,248
固定資産		
有形固定資産	※ 1	1,464,369
無形固定資産		1,868,989
投資その他の資産		
投資有価証券		9,021,178
その他	※ 1	1,552,276
貸倒引当金	※ 2	△1,267,185
投資その他の資産合計		9,306,270
固定資産計		12,639,629
資産合計		51,343,877

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成20年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		7,027,746
未払法人税等		1,091,821
賞与引当金		194,000
その他	※ 4	2,190,491
流動負債計		10,504,059
固定負債		
繰延税金負債		2,122,867
退職給付引当金		1,045,050
役員退職慰労引当金		59,610
固定負債計		3,227,528
負債合計		13,731,588

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	
別途積立金	2,800,000
繰越利益剰余金	8,050,878
利益剰余金合計	11,225,175
株主資本合計	37,895,175
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△282,886
評価・換算差額等合計	△282,886
純資産合計	37,612,289
負債・純資産合計	51,343,877

（２）中間損益計算書

（単位：千円）

	当中間会計期間 （自 平成20年 4 月 1 日 至 平成20年 9 月30日）
営業収益	
委託者報酬	40,116,478
その他営業収益	248,863
営業収益計	40,365,342
営業費用	
支払手数料	23,959,701
その他営業費用	3,970,640
営業費用計	27,930,341
一般管理費	※ 1 4,077,894
営業利益	8,357,106
営業外収益	※ 2 1,182,712
営業外費用	※ 1 , ※ 3 1,289,770
経常利益	8,250,049
特別利益	1,293
特別損失	7,822
税引前中間純利益	8,243,519
法人税、住民税及び事業税	3,174,696
法人税等調整額	164,136
中間純利益	4,904,687

(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20年4月1日 至 平成20年9月30日)
株主資本	
資本金	
前期末残高	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	
前期末残高	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	
前期末残高	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	
前期末残高	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	
別途積立金	
前期末残高	2,800,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,800,000
繰越利益剰余金	
前期末残高	11,702,152
当中間期変動額	
剰余金の配当	△8,555,962
中間純利益	4,904,687
当中間期変動額合計	△3,651,274
当中間期末残高	8,050,878

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)
--	--

利益剰余金合計

前期末残高	14,876,450
当中間期変動額	
剰余金の配当	△8,555,962
中間純利益	4,904,687
当中間期変動額合計	△3,651,274
当中間期末残高	11,225,175
株主資本合計	
前期末残高	41,546,450
当中間期変動額	
剰余金の配当	△8,555,962
中間純利益	4,904,687
当中間期変動額合計	△3,651,274
当中間期末残高	37,895,175
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	△402,154
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）	119,268
当中間期変動額合計	119,268
当中間期末残高	△282,886
評価・換算差額等合計	
前期末残高	△402,154
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）	119,268
当中間期変動額合計	119,268
当中間期末残高	△282,886
純資産合計	
前期末残高	41,144,295
当中間期変動額	
剰余金の配当	△8,555,962
中間純利益	4,904,687
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	119,268
当中間期変動額合計	△3,532,006
当中間期末残高	37,612,289

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

	当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)
--	--

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 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っております。 (2) その他有価証券 時価のあるものについては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）、時価のないものについては移動平均法による原価法で計上しております。 (3) デリバティブ取引 時価法により計上しております。
2. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産及び投資不動産 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は次の通りであります。 建物 7～50年 器具備品 5～10年 (2) 無形固定資産 定額法によっております。ただし、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。 (3) 長期前払費用 定額法によっております。
3. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。 また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。
	当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)
4. 消費税等の会計処理	(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。 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。ただし固定資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は投資その他の資産に計上し、5年間で均等償却を行っております。
5. 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

会計方針の変更

当中間会計期間末 (平成20年9月30日現在)
(リース取引に関する会計基準等) 当中間会計期間から平成19年3月30日改正の「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準委員会 企業会計基準第13号)及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第16号)を適用しております。 当該変更に伴う損益に与える影響はありません。 (棚卸資産の評価に関する会計基準) 当中間会計期間から平成18年7月5日公表の「棚卸資産の評価に関する会計基準」(企業会計基準委員会 企業会計基準第9号)を適用しております。 当該変更に伴う損益に与える影響はありません。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間末 (平成20年9月30日現在)	
※1.	減価償却累計額
	有形固定資産 2,535,700千円
	投資不動産 695,574千円
※2.	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。
3	債務保証
	当社は、子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務795,850千円に対して保証を行っております。
※4.	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20年4月1日 至 平成20年9月30日)	
※ 1. 減価償却実施額	
有形固定資産	202,006千円
無形固定資産	291,294千円
投資不動産	7,104千円
※ 2. 営業外収益の主要項目	
有価証券利息	210,872千円
為替差益	896,638千円
※ 3. 営業外費用の主要項目	
貸倒引当金繰入額	150,213千円

デリバティブ損失

997,832千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日）

1. 発行済株式に関する事項

	前事業年度末 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)
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 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20年6月22日 定時株主総会	普通株式	8,555	3,280	平成20年 3月31日	平成20年 6月23日

(リース取引関係)

当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)		
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 (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いるもの) (借主側)		
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中間期末残高相当額		
	有形固定資産 (工具、器具 及び備品)	合計
	千円	千円
取得価額相当額	4,290	4,290
減価償却累計額 相当額	2,758	2,758
中間期末残高 相当額	1,532	1,532
(注) 取得価額相当額は、未経過リース料中間期末残高が有形固定資産の中間期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。		
②未経過リース料中間期末残高相当額		
1 年 内	1,273千円	
1 年 超	326千円	
合 計	1,600千円	
(注) 未経過リース料中間期末残高相当額は、未経過リース料中間期末残高が有形固定資産の中間期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。		
③支払リース料及び減価償却費相当額		
支払リース料	657千円	

減価償却費相当額

612千円

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。

(有価証券関係)

当中間会計期間末（平成20年9月30日現在）

1. 時価のある有価証券

	取得原価 (千円)	中間貸借対照表計上額 (千円)	差額 (千円)
(1) その他有価証券			
①株 式	55,101	84,233	29,131
②債 券	50,000	49,915	△85
③そ の 他 証券投資信託の受益証券	5,815,150	5,318,862	△496,288
計	5,920,252	5,453,010	△467,241

2. 時価評価されていない主な有価証券

	中間貸借対照表計上額 (千円)
(1) その他有価証券	
①非上場株式	1,312,394
②外貨建資産担保債券	2,589,363
③MMF	25,181,349
計	29,083,107
(2) 子会社株式及び関連会社株式	737,012
計	737,012

(デリバティブ取引関係)

(1) 取引の状況に関する事項

当中間会計期間
(自 平成20年4月1日
至 平成20年9月30日)

1. 取引の内容及び利用目的

当社が利用しているデリバティブ取引は為替予約取引であり、当社が保有する外貨建資産担保債券に係る為替変動リスクを軽減するために利用しております。

2. 取引に対する取組方針

為替予約取引については将来の為替変動リスクの軽減を目的としているため、対象資産である外貨建資産担保債券の保有残高の範囲内で行うこととしており、投機目的ではありません。

3. 取引に係るリスクの内容

為替予約取引に係るリスクとして、為替相場の変動による市場リスクを有しております。また、信用度の高い国内大手証券会社を取引先としており、取引先の契約不履行に係る信用リスクはほとんどないと判断しております。

4. 取引に係るリスク管理体制

為替予約取引開始にあたっては、事前に取り締役会等の会議体にて承認を得ることとしております。

なお、事後体制としまして、財務部長は毎月、為替予約取引の内容を含んだ財務報告を執行役員会議で行っております。また、財務部内にて取引の状況について適切に把握、管理しております。

(2) 取引の時価等に関する事項

区分	種類	当中間会計期間末 (平成20年9月30日現在)		
		契約額等 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	為替予約取引	1,469,068	31,948	31,948

(注) 時価の算定方法は、各通貨のキャッシュ・フローを計算し、現在価値に割り引き

邦貨換算した額となっております。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)	
1株当たり純資産額	14,418.99円
1株当たり中間純利益	1,880.25円
(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、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)	4,904,687
普通株式に係る中間純利益(千円)	4,904,687
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。

- ① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ③ 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- ④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成20年7月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

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

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

① 名称 住友信託銀行株式会社

② 資本金の額 287,537百万円（平成20年3月末日現在）

③ 事業の内容

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

(2) 販売会社

① 名称 大和証券株式会社

② 資本金の額 100,000百万円（平成20年3月末日現在）

③ 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20年3月末日現在）

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

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

第3 【参考情報】

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

（提出年月日）	（書類名）
平成20年4月24日	有価証券届出書の訂正届出書
平成20年11月20日	半期報告書（第1期中）、有価証券届出書の訂正届出書・同添付書類

独立監査人の監査報告書

平成21年2月6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 山元 太志 印
業務執行社員指定社員 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20年2月28日から平成20年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。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20年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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)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）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月20日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指 定 社
員 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19年4月1日から平成20年3月31日までの第49期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以 上

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

[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20年12月22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
業務執行社員
堀 内 巧 印

指 定 社
員 公認会計士
業務執行社員
小 澤 陽 一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の中間会計期間（平成20年4月1日から平成20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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間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、我が国におけ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。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する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20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20年4月1日から平成20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。

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19年6月22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

当監査法人は、証券取引法第193条の2の 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

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18年4月1日から平成19年3月31日までの第48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19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。

追記情報

会計方針の変更に記載されているとおり、会社は当事業年度より、貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準及び貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針を適用している。

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。