

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書
【提出先】 関東財務局長 殿
【提出日】 平成25年3月11日提出
【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 白川 真
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】 長谷川 英男
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】 03-5555-3111
**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】** DCダイワ・ターゲットイヤー2040
**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】** 継続申込期間（平成25年3月12日から平成26年3月11日まで）
10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

申込手数料には、消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位

(7) 【申込期間】

平成25年3月12日から平成26年3月11日まで(継続申込期間)

(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

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

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

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受け付けを中止することができます。

当ファンドは、積立投資専用です。

イ．取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結するものとします。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

ロ．収益分配金は、自動的に再投資されます。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

取得申込金額に利息は付きません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分変更型（株式、債券、不動産投信）））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの特色 >

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

- 当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2040年に近づくにしながら株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

- ◆2040年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

〈2012年12月時点の基本配分比率〉

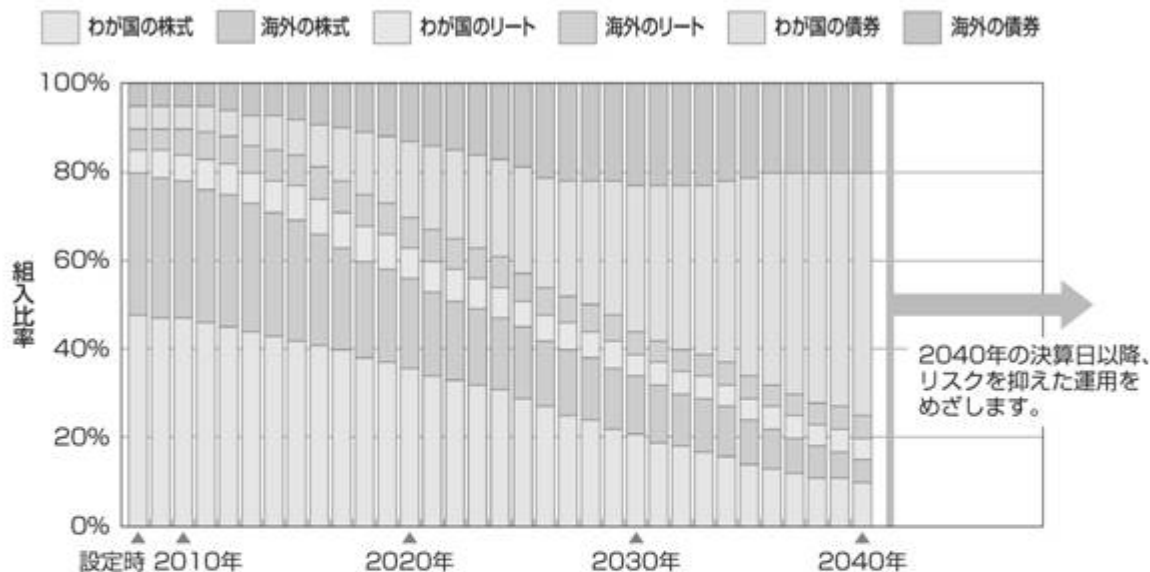
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	45%	30%	7%	6%	6%	6%

〈当初設定時の基本配分比率〉

	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	48%	32%	5%	5%	5%	5%

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

ファンドの基本配分比率のイメージ



(注1) 2012年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2011年以前は過去の基本配分比率を示しています。

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

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

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

- 東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
 - (a) 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
 - (b) ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。
 - (c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注)を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるTOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

3 海外の株式への投資にあたっては、投資成果を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います。

運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注)を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるMSCIコクサイ指数（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

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

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。

4

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

運用プロセス



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

東証REIT指数とは

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

[算出方法の概要]

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

5

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

運用プロセス



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

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

S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

【特徴】

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

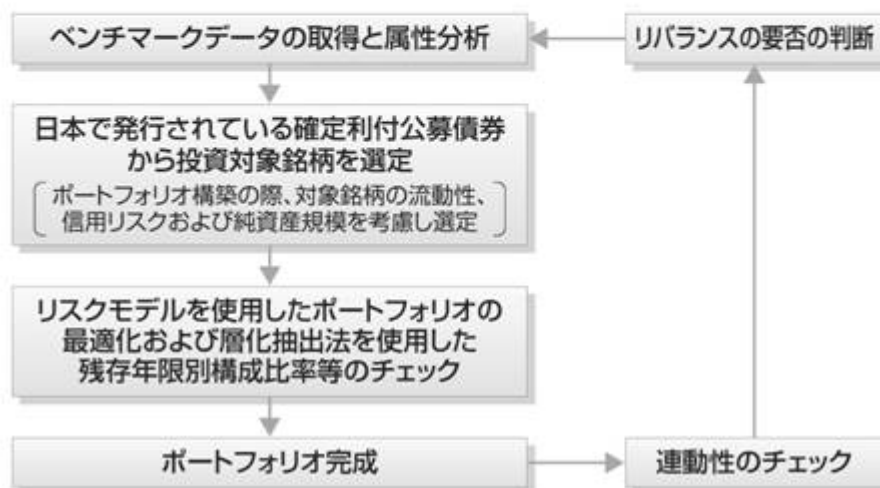
本商品は、スタンダード&プアーズおよびその関連会社（以下、S&P）によって支持、保証、販売または販売促進されるものではありません。S&Pは、明示的にも暗示的にも、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または本商品に関する投資について、またS&P先進国REIT指数（除く日本）が市場全般のパフォーマンスに追随する能力について、何ら表明、条件付けまたは保証するものではありません。S&Pの大和証券投資信託委託株式会社に対する唯一の関係は、S&PおよびS&P先進国REIT指数（除く日本）の登録商標についての利用許諾を与えることです。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）に関する決定、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

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

6

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

運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

NOMURA－BPI総合指数とは

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

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

7

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

運用プロセス



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

①為替レート変動への対応

為替レート変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、ファンドの通貨別構成比率をベンチマークの通貨別構成比率に近づけます。

②債券価格変動への対応

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

③債券価格変動要因の測定・管理

リスクモデルを使用し債券価格変動要因の測定・管理を行ない、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行なっています。

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

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

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

8

2040年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

NOMURA－BPI総合短期指数とは

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

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

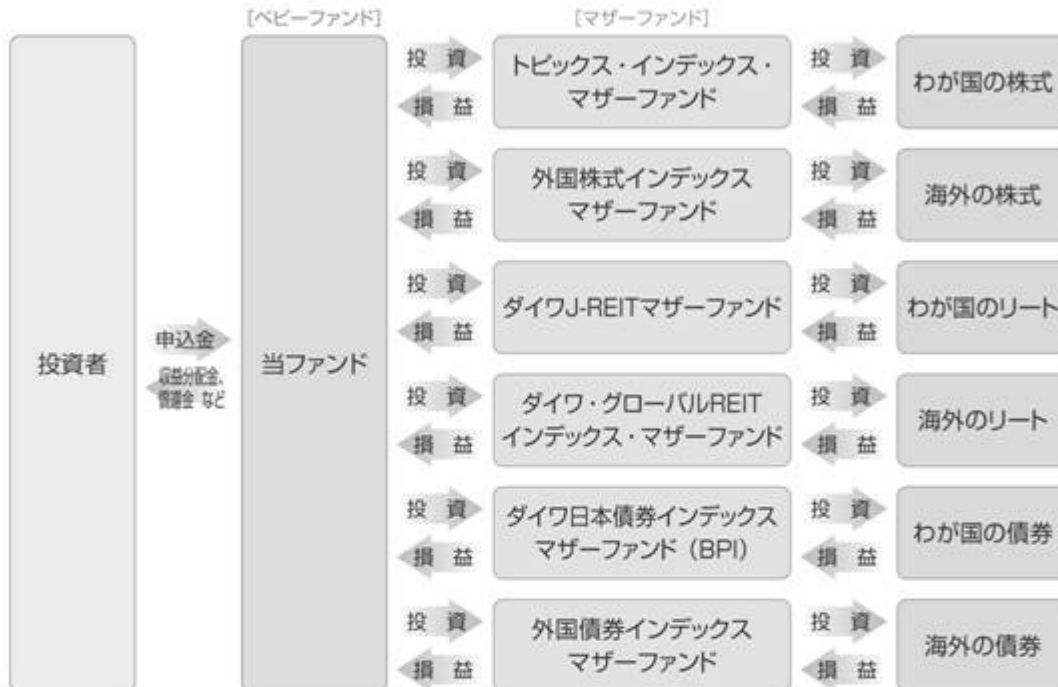
NOMURA－BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

ファンドの仕組み

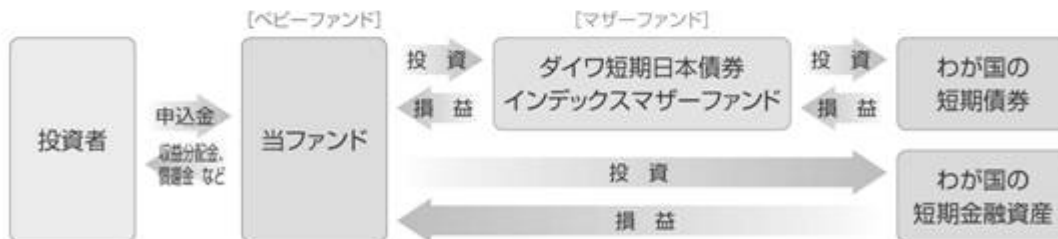
●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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

〈2040年の決算日前日まで〉



〈2040年の決算日から〉



・ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

9

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

10

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

〈分配方針〉

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成20年2月28日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
運用指図	2	損益 信託金（ 3）
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など
	損益 投資	

投資対象

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

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

< 委託会社の概況（平成24年12月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
3. ダイワJ - REITマザーファンドの受益証券

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

投資態度

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

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、2040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48%

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32%

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5%

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

.....信託財産の純資産総額の5%

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5%

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. 2040年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

(2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引

法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

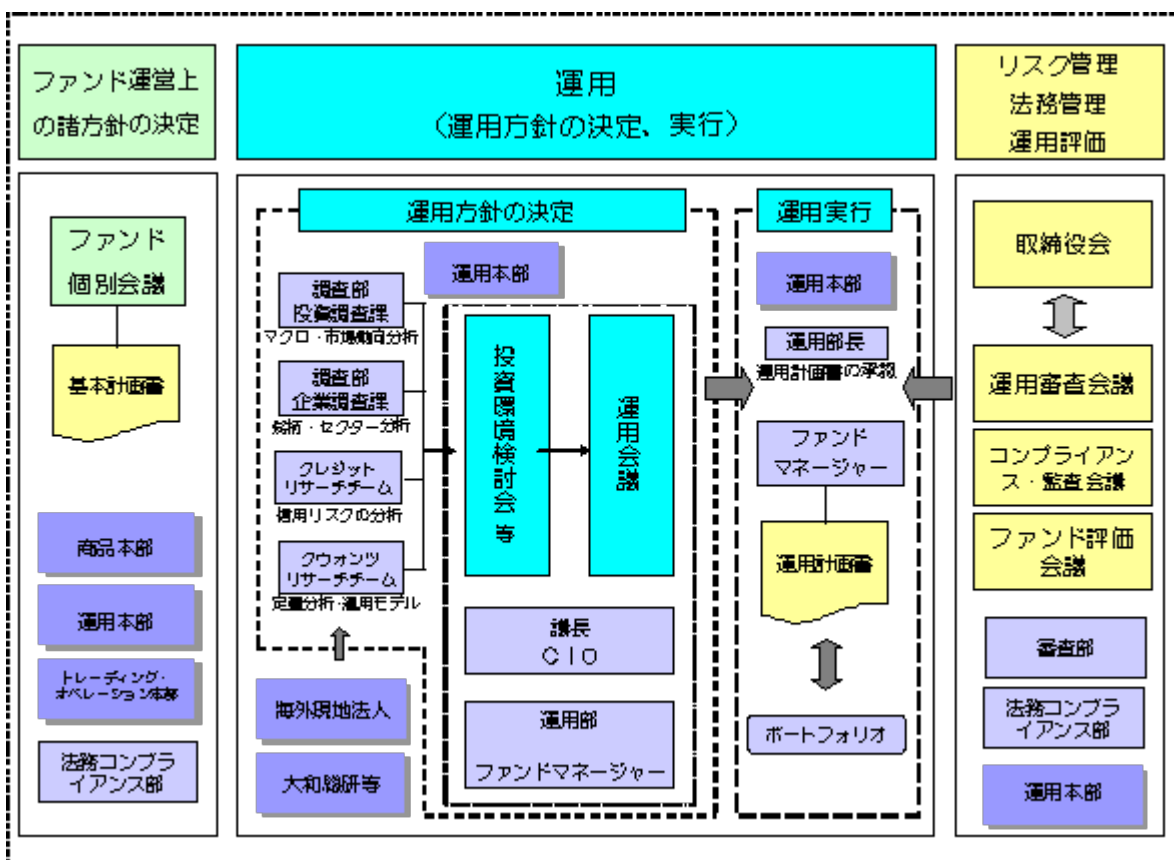
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成24年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> 各マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

(注) 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

2. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）MSCIコクサイ指数とは

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

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

3. ダイワJ - R E I Tマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

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

投資態度

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

(2) 投資対象

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

- 1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．約束手形
 - ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

- 1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2. 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 3. 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

(注) 東証REIT指数とは

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

[算出方法の概要]

指数：算出時の時価総額^(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。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

- イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。
- ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。
- ハ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行いません。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- イ．有価証券
- ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

- イ．為替手形

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

- 1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
- 3. 外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 4. 外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 6. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

- 1. 預金

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

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注) S & P 先進国 REIT 指数（除く日本）（円ベース）とは

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

[特徴]

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

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

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

5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

動する投資成果をめざします。

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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、

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

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、

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、

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

(注) NOMURA - B P I 総合指数とは
NOMURA - B P I は、野村証券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。
NOMURA - B P I に関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なっ

た受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。

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

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

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

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

金利先渡取引

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

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

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

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

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

(注) NOMURA - B P I 総合短期指数とは

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

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

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

7. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

(2) 投資対象

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

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

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

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

3 【投資リスク】

〈基準価額の主な変動要因〉

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

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク



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

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

ロ．リーートの価格や配当は、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

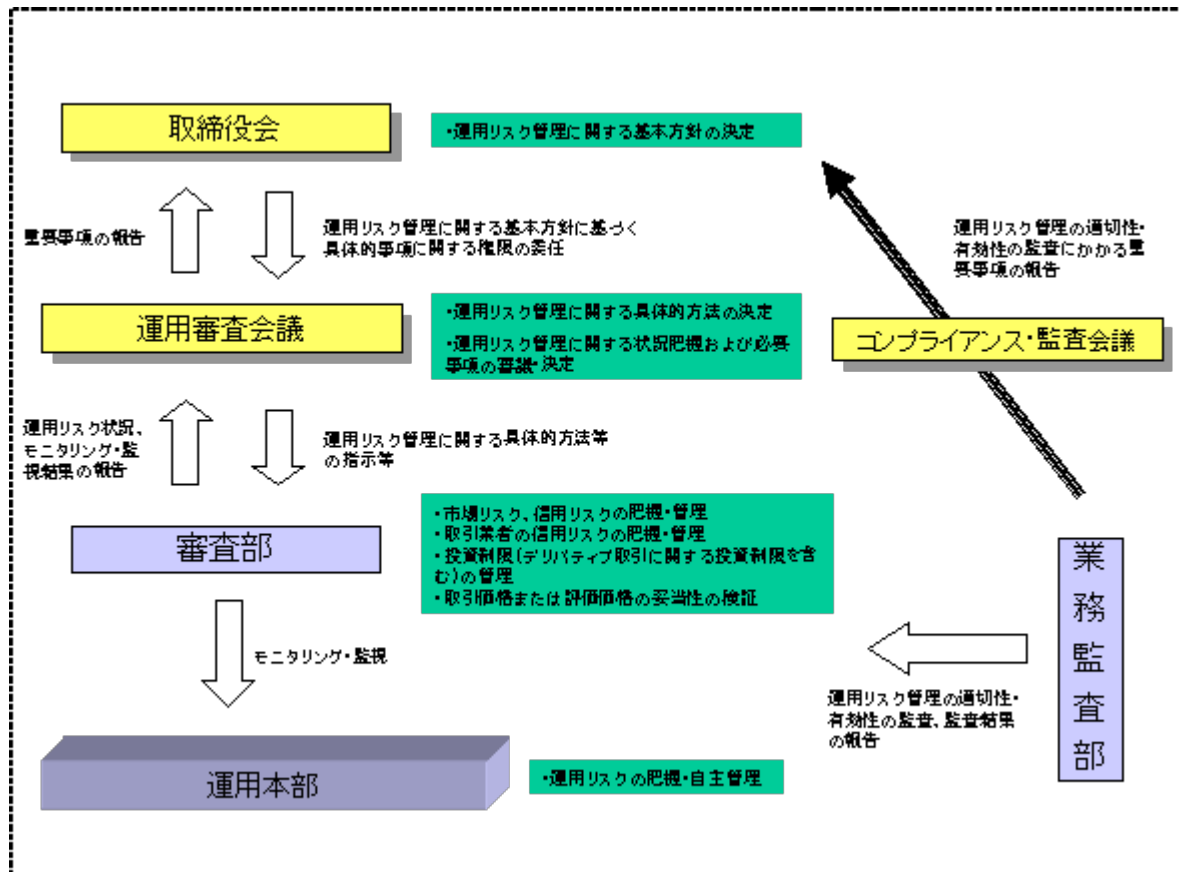
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付けの申込みの受付けを中止することがあります。

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

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

	信託報酬率
第1計算期間から第33計算期間まで	年率0.6825%（税抜0.65%）
第34計算期間以降	年率0.2625%（税抜0.25%）

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

< 第1計算期間から第33計算期間まで >

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

< 第34計算期間以降 >

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（有価証券等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

（ ）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示

することができません。

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

期間ごとの税率は、上記イ．の表と同じです。

ハ．損益通算について

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

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

< 注1 > 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

（ ）上記は、平成25年1月1日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成24年12月28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	3,508,039	99.88
内 日本	3,508,039	99.88
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,229	0.12
純資産総額	3,512,268	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（平成24年12月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	3,323,105	0.4590 1,525,305	0.4836 1,607,053	45.76
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	977,752	1.0360 1,012,951	1.0681 1,044,336	29.73
3	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	182,280	1.2809 233,482	1.3339 243,143	6.92
4	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	170,645	1.1776 200,951	1.2321 210,251	5.99
5	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	100,995	1.9859 200,565	2.0612 208,170	5.93
6	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）	日本	親投資信託 受益証券	170,188	1.1479 195,358	1.1463 195,086	5.55

(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	99.88%
合計	99.88%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年12月18日)	681,848	681,848	0.6054	0.6054
第2計算期間末 (平成21年12月18日)	1,176,672	1,176,672	0.6991	0.6991
第3計算期間末 (平成22年12月20日)	952,605	952,605	0.7319	0.7319
第4計算期間末 (平成23年12月19日)	1,354,908	1,354,908	0.6293	0.6293
平成23年12月末日	1,462,446	-	0.6416	-
平成24年1月末日	1,506,919	-	0.6611	-
2月末日	1,743,924	-	0.7270	-
3月末日	3,513,988	-	0.7470	-
4月末日	3,319,372	-	0.7222	-
5月末日	3,258,468	-	0.6570	-
6月末日	3,400,920	-	0.6858	-
7月末日	3,448,924	-	0.6808	-
8月末日	3,606,476	-	0.6856	-
9月末日	2,205,280	-	0.6998	-
10月末日	2,390,306	-	0.7084	-
11月末日	2,643,853	-	0.7378	-
第5計算期間末 (平成24年12月18日)	3,373,491	3,373,491	0.7645	0.7645
12月末日	3,512,268	-	0.7960	-

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	39.5

第2計算期間	15.5
第3計算期間	4.7
第4計算期間	14.0
第5計算期間	21.5

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	126,328	0
第2計算期間	556,781	0
第3計算期間	701,153	1,082,781
第4計算期間	974,376	122,837
第5計算期間	4,521,213	2,261,666

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年12月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	95,158,546,930	98.12
内 日本	95,158,546,930	98.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,826,443,834	1.88
純資産総額	96,984,990,764	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	1,869,455,000	1.93
内 日本	1,869,455,000	1.93

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

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

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

(2) 投資資産（平成24年12月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,031,300	3,255.00 3,356,881,500	4,005.00 4,130,356,500	4.26

2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,993,500	388.00 2,325,478,000	461.00 2,763,003,500	2.85
3	本田技研	日本	株式	輸送用機器	677,200	2,674.00 1,810,832,800	3,145.00 2,129,794,000	2.20
4	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	598,400	2,603.00 1,557,635,200	3,115.00 1,864,016,000	1.92
5	キヤノン	日本	株式	電気機器	498,400	2,861.00 1,425,922,400	3,340.00 1,664,656,000	1.72
6	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	10,190,000	135.00 1,375,650,000	157.00 1,599,830,000	1.65
7	ファナック	日本	株式	電気機器	83,500	13,990.00 1,168,165,000	15,920.00 1,329,320,000	1.37
8	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	333,300	3,600.00 1,199,880,000	3,630.00 1,209,879,000	1.25
9	武田薬品	日本	株式	医薬品	313,400	3,735.00 1,170,549,000	3,855.00 1,208,157,000	1.25
10	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	362,200	3,235.00 1,171,717,000	3,140.00 1,137,308,000	1.17
11	三菱地所	日本	株式	不動産業	553,000	1,504.00 831,712,000	2,049.00 1,133,097,000	1.17
12	三菱商事	日本	株式	卸売業	617,500	1,549.57 956,864,907	1,647.00 1,017,022,500	1.05
13	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	399,100	2,260.00 901,966,000	2,440.00 973,804,000	1.00
14	日立	日本	株式	電気機器	1,881,000	479.66 902,254,760	504.00 948,024,000	0.98
15	三井物産	日本	株式	卸売業	682,100	1,185.00 808,288,500	1,283.00 875,134,300	0.90
16	小松製作所	日本	株式	機械	391,600	1,670.00 653,972,000	2,184.00 855,254,400	0.88
17	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	147,800	5,024.09 742,561,957	5,580.00 824,724,000	0.85
18	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	1,014,400	727.00 737,468,800	811.00 822,678,400	0.85
19	野村ホールディングス	日本	株式	証券・商品先物 取引業	1,620,700	305.00 494,313,500	503.00 815,212,100	0.84
20	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	6,502	128,300.00 834,206,600	124,000.00 806,248,000	0.83
21	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	329,900	2,330.00 768,667,000	2,437.00 803,966,300	0.83
22	信越化学	日本	株式	化学	150,500	4,630.00 696,815,000	5,230.00 787,115,000	0.81
23	三井不動産	日本	株式	不動産業	374,000	1,610.49 602,325,530	2,090.00 781,660,000	0.81
24	新日鐵住金	日本	株式	鉄鋼	3,550,000	175.05 621,429,594	210.00 745,500,000	0.77
25	東京海上HD	日本	株式	保険業	306,000	2,110.03 645,672,204	2,383.00 729,198,000	0.75

26	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	186,500	3,955.00 737,607,500	3,875.00 722,687,500	0.75
27	KDDI	日本	株式	情報・通信業	112,100	5,770.00 646,817,000	6,090.00 682,689,000	0.70
28	デンソー	日本	株式	輸送用機器	197,600	2,780.00 549,328,000	2,973.00 587,464,800	0.61
29	三菱電機	日本	株式	電気機器	802,000	663.00 531,726,000	731.00 586,262,000	0.60
30	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	261,800	1,910.00 500,038,000	2,224.00 582,243,200	0.60

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.12%
合計	98.12%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.59%
建設業	2.64%
食料品	3.72%
繊維製品	0.83%
パルプ・紙	0.29%
化学	5.62%
医薬品	4.69%
石油・石炭製品	0.75%
ゴム製品	0.81%
ガラス・土石製品	1.00%
鉄鋼	1.68%
非鉄金属	1.09%
金属製品	0.69%
機械	5.12%
電気機器	11.91%
輸送用機器	11.02%
精密機器	1.37%
その他製品	1.36%
電気・ガス業	2.41%
陸運業	3.96%
海運業	0.31%
空運業	0.55%
倉庫・運輸関連業	0.24%
情報・通信業	5.85%
卸売業	5.06%
小売業	4.03%
銀行業	10.18%
証券、商品先物取引業	1.53%

保険業	2.44%
その他金融業	0.99%
不動産業	3.29%
サービス業	1.99%
合計	98.12%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2013年3月	買建	217	1,773,627,9251	869,455,000	1.93%

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

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

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成24年12月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	52,950,004,098	96.61
内 香港	784,346,831	1.43
内 シンガポール	462,959,395	0.84
内 イスラエル	142,468,540	0.26
内 ノルウェー	236,363,604	0.43
内 スウェーデン	816,329,367	1.49
内 デンマーク	297,725,277	0.54
内 イギリス	5,703,177,810	10.41
内 アイルランド	69,601,991	0.13
内 オランダ	633,429,640	1.16
内 ベルギー	297,700,740	0.54
内 フランス	2,395,936,092	4.37
内 ドイツ	2,262,728,020	4.13
内 スイス	2,237,820,201	4.08
内 ポルトガル	49,760,068	0.09
内 スペイン	786,645,576	1.44
内 イタリア	590,399,358	1.08
内 フィンランド	206,803,375	0.38
内 オーストリア	77,445,998	0.14

	内 ギリシャ	13,278,370	0.02
	内 カナダ	2,923,789,850	5.33
	内 アメリカ	29,825,503,821	54.42
	内 オーストラリア	2,113,234,291	3.86
	内 ニュージーランド	22,555,883	0.04
投資証券		1,160,661,748	2.12
	内 香港	26,238,330	0.05
	内 シンガポール	11,910,151	0.02
	内 イギリス	75,628,190	0.14
	内 オランダ	8,098,196	0.01
	内 フランス	83,527,635	0.15
	内 アメリカ	788,783,410	1.44
	内 オーストラリア	166,475,836	0.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		695,989,097	1.27
純資産総額		54,806,654,943	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）	671,761,233	1.23
内 アメリカ	671,761,233	1.23

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

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

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

(2) 投資資産（平成24年12月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	24,700	51,026.78 1,260,361,683	44,593.89 1,101,469,202	2.01
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	121,555	7,629.42 927,395,315	7,520.33 914,134,783	1.67
3	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	278,400	1,829.43 509,314,815	1,791.34 498,709,112	0.91
4	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	86,500	5,788.90 500,739,850	5,679.76 491,299,673	0.90
5	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	51,718	9,159.29 473,700,584	9,395.66 485,924,827	0.89
6	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	28,700	16,582.66 475,922,554	16,684.83 478,854,673	0.87

7	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	200,100	2,333.33 466,899,533	2,334.19 467,072,780	0.85
8	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	492,800	881.20 434,259,460	909.67 448,285,573	0.82
9	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	152,895	2,937.65 449,153,434	2,914.28 445,579,269	0.81
10	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	72,700	5,993.06 435,696,015	6,068.39 441,172,113	0.80
11	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	195,763	2,151.51 421,186,639	2,176.62 426,101,896	0.78
12	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	生活必需品	72,237	6,017.31 434,672,422	5,884.84 425,103,375	0.78
13	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,900	59,903.83 413,336,470	61,150.58 421,939,059	0.77
14	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	132,572	2,870.99 380,613,257	2,959.30 392,320,903	0.72
15	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	100,920	3,568.82 360,166,081	3,777.48 381,223,827	0.70
16	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	62,400	5,470.98 341,389,464	5,475.73 341,685,552	0.62
17	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	19,100	17,290.78 330,253,898	17,622.93 336,597,963	0.61
18	COCA-COLA CO	アメリカ	株式	生活必需品	106,200	3,287.44 349,126,404	3,153.24 334,874,470	0.61
19	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	44,400	7,820.77 347,242,250	7,252.80 322,024,613	0.59
20	BP PLC	イギリス	株式	エネルギー	516,200	601.33 310,407,165	597.70 308,534,640	0.56
21	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	イギリス	株式	エネルギー	100,300	2,912.48 292,121,744	2,994.09 300,308,150	0.55
22	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	103,283	2,756.70 284,720,990	2,880.51 297,508,396	0.54
23	BHP BILLITON LTD	オーストラリア	株式	素材	87,600	3,072.05 269,112,281	3,321.70 290,981,095	0.53
24	WAL-MART STORES INC	アメリカ	株式	生活必需品	49,200	6,132.46 301,717,101	5,903.89 290,471,398	0.53
25	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	1,328,037	223.65 297,016,219	217.65 289,048,847	0.53
26	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	80,621	3,870.99 312,083,230	3,567.09 287,582,847	0.52
27	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	75,500	3,810.38 287,684,128	3,764.49 284,219,629	0.52
28	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	281,601	851.08 239,665,373	993.07 279,650,237	0.51
29	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	31,825	7,968.90 253,610,360	8,276.32 263,394,091	0.48
30	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	77,123	3,048.48 235,108,062	3,398.26 262,084,392	0.48

(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	96.61%
投資証券	2.12%
合計	98.73%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	11.01%
素材	7.01%
資本財・サービス	9.99%
一般消費財・サービス	10.08%
生活必需品	10.91%
ヘルスケア	10.79%
金融	17.94%
情報技術	11.65%
電気通信サービス	3.75%
公益事業	3.48%
その他	0.00%
合計	96.61%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 2013年3月	買建	22	671,108,853	671,761,233	1.23%

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

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

(参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

(1) 投資状況（平成24年12月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	61,327,844,400	98.83
内 日本	61,327,844,400	98.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	723,373,332	1.17
純資産総額	62,051,217,732	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年12月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	8,642 7,121,893,276	824,102.43	893,000.00 7,717,306,000	12.44
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	8,376 6,654,431,126	794,464.07	850,000.00 7,119,600,000	11.47
3	日本リテールファンド	日本	投資証券	29,313 4,075,086,431	139,019.76	158,600.00 4,649,041,800	7.49
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	29,654 2,672,044,768	90,107.39	99,200.00 2,941,676,800	4.74
5	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	11,631 2,680,332,066	230,447.25	249,200.00 2,898,445,200	4.67
6	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	15,508 2,521,735,654	162,608.69	177,100.00 2,746,466,800	4.43
7	森トラスト総合リート	日本	投資証券	3,412 2,389,198,859	700,234.13	727,000.00 2,480,524,000	4.00
8	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	3,207 2,165,473,233	675,233.31	755,000.00 2,421,285,000	3.90
9	野村不動産オフィスF	日本	投資証券	4,302 2,026,566,548	471,075.44	497,000.00 2,138,094,000	3.45
10	オリックス不動産投資	日本	投資証券	4,010 1,497,969,104	373,558.38	425,500.00 1,706,255,000	2.75
11	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	2,745 1,487,561,945	541,916.91	600,000.00 1,647,000,000	2.65
12	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	2,087 1,494,989,112	716,334.02	752,000.00 1,569,424,000	2.53
13	A P I 投資法人	日本	投資証券	2,894 1,394,234,805	481,767.38	542,000.00 1,568,548,000	2.53
14	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	2,263 1,307,241,525	577,658.65	676,000.00 1,529,788,000	2.47
15	森ヒルズリート	日本	投資証券	3,264 1,190,700,996	364,798.09	463,000.00 1,511,232,000	2.44
16	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	2,660 1,134,033,754	426,328.47	485,000.00 1,290,100,000	2.08
17	産業ファンド	日本	投資証券	1,983 1,212,224,417	611,308.32	646,000.00 1,281,018,000	2.06
18	ケネディクス不動産投資法人	日本	投資証券	4,040 1,089,577,989	269,697.52	301,000.00 1,216,040,000	1.96
19	福岡リート投資法人	日本	投資証券	1,735 984,024,459	567,161.07	658,000.00 1,141,630,000	1.84

20	東急リアル・エステート	日本	投資証券	406,389.09 2,388 970,457,158	470,500.00 1,123,554,000	1.81
21	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	45,104.99 18,762 846,259,844	56,600.00 1,061,929,200	1.71
22	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	252,744.72 3,499 884,353,782	298,500.00 1,044,451,500	1.68
23	野村不レジデンシャル	日本	投資証券	448,920.78 2,128 955,303,437	478,000.00 1,017,184,000	1.64
24	大和ハウスリート	日本	投資証券	567,325.63 1,655 938,923,932	549,000.00 908,595,000	1.46
25	プレミア投資法人	日本	投資証券	285,280.05 2,773 791,081,594	318,500.00 883,200,500	1.42
26	トップリート投資法人	日本	投資証券	374,965.95 2,185 819,300,605	371,500.00 811,727,500	1.31
27	積水ハウス・S I 投資法人	日本	投資証券	360,188.66 1,932 695,884,498	396,000.00 765,072,000	1.23
28	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	22,008.87 29,765 655,094,133	23,880.00 710,788,200	1.15
29	グローバル・ワン不動産投資法人	日本	投資証券	486,079.08 1,366 663,984,035	514,000.00 702,124,000	1.13
30	平和不動産リート	日本	投資証券	51,503.15 11,087 571,015,489	57,400.00 636,393,800	1.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.83%
合計	98.83%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年12月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	624,279,225	98.51

内 香港	13,107,102	2.07
内 シンガポール	25,517,042	4.03
内 イスラエル	147,227	0.02
内 イギリス	38,654,330	6.10
内 オランダ	7,873,169	1.24
内 ベルギー	3,632,258	0.57
内 フランス	34,296,571	5.41
内 ドイツ	1,038,303	0.16
内 イタリア	692,734	0.11
内 カナダ	19,733,365	3.11
内 アメリカ	403,711,179	63.70
内 オーストラリア	73,723,182	11.63
内 ニュージーランド	2,152,763	0.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,465,263	1.49
純資産総額	633,744,488	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年12月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面 金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	3,147 41	13,095.22 210,673	13,673.57 43,030,754	6.79
2	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	投資証券	21,600 20	937.51 250,259	951.88 20,560,608	3.24
3	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	950 19	20,728.09 691,692	21,554.00 20,476,309	3.23
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	1,500 18	12,232.02 348,034	12,499.55 18,749,332	2.96
5	HCP INC	アメリカ	投資証券	4,600 17	3,893.50 910,112	3,908.22 17,977,818	2.84
6	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	3,079 16	5,504.75 949,145	5,573.15 17,159,743	2.71
7	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	3,100 14	4,826.83 963,189	4,885.70 15,145,699	2.39
8	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	4,746 13	2,945.45 979,113	3,141.12 14,907,767	2.35
9	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	1,600 14	8,847.61 156,176	9,148.90 14,638,254	2.31
10	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	2,700 13	5,109.08 794,532	5,258.00 14,196,609	2.24
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	1,200 13	1,557.65 869,250	11,755.83 14,106,999	2.23

12	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	1,764 11,582,825	6,566.22 6,886.57	12,147,915	1.92
13	LINK REIT	香港	投資証券	24,000 11,286,168	470.25 437.30	10,495,332	1.66
14	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	7,600 9,666,138	1,271.86 1,348.05	10,245,185	1.62
15	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	8,150 9,108,075	1,117.55 1,151.73	9,386,661	1.48
16	WESTFIELD RETAIL TRUST	オーストラリア	投資証券	29,400 7,867,558	267.60 272.09	7,999,564	1.26
17	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	4,677 7,738,301	1,654.54 1,705.62	7,977,213	1.26
18	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	1,300 7,240,599	5,569.69 5,860.60	7,618,780	1.20
19	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	9,300 7,045,620	757.59 797.35	7,415,418	1.17
20	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	23,300 7,176,726	308.01 316.99	7,385,960	1.17
21	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	4,200 6,909,084	1,645.02 1,682.24	7,065,447	1.11
22	MACERICH CO	アメリカ	投資証券	1,400 6,787,872	4,848.48 5,038.09	7,053,326	1.11
23	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	700 6,211,509	8,873.58 9,091.76	6,364,236	1.00
24	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	900 5,795,838	6,439.82 6,618.17	5,956,358	0.94
25	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	14,840 6,156,760	414.87 391.52	5,810,276	0.92
26	GPT GROUP	オーストラリア	投資証券	16,900 5,311,670	314.30 329.56	5,569,665	0.88
27	UDR INC	アメリカ	投資証券	2,600 5,181,986	1,993.07 2,057.14	5,348,566	0.84
28	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	900 5,147,527	5,719.47 5,896.96	5,307,267	0.84
29	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	7,600 4,962,447	652.95 693.41	5,269,949	0.83
30	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	400 4,866,489	12,166.22 12,795.65	5,118,263	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	98.51%
合計	98.51%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

(1) 投資状況 (平成24年12月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	9,327,560,720	70.17
内 日本	9,327,560,720	70.17
地方債証券	1,255,356,810	9.44
内 日本	1,255,356,810	9.44
特殊債券	1,185,779,936	8.92
内 日本	1,185,779,936	8.92
社債券	1,434,770,247	10.79
内 日本	1,434,770,247	10.79
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	88,678,262	0.67
純資産総額	13,292,145,975	100.00

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

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

(2) 投資資産 (平成24年12月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単 価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	106 5年国債	日本	国債証券	197,000,000	100.13 197,275,290	100.11 228,520	0.200000 2017/09/20	1.48
2	105 5年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.18 180,324,080	100.17 316,800	0.200000 2017/06/20	1.36
3	322 2年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.00 180,015,680	100.00 16,200	0.100000 2014/11/15	1.35
4	325 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.86 171,468,780	100.22 382,500	0.800000 2022/09/20	1.28
5	288 10年国債	日本	国債証券	148,000,000	107.30 158,805,488	107.16 598,280	1.700000 2017/09/20	1.19
6	310 10年国債	日本	国債証券	134,000,000	104.14 139,548,948	103.47 659,180	1.000000 2020/09/20	1.04

7	9 2 5 年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.57 130,742,660	100.55 717,600	0.300000 2015/09/20	0.98
8	3 0 9 1 0 年国債	日本	国債証券	125,000,000	105.00 131,261,250	104.38 480,000	1.100000 2020/06/20	0.98
9	2 9 9 1 0 年国債	日本	国債証券	122,000,000	106.30 129,692,120	105.98 304,140	1.300000 2019/03/20	0.97
10	8 9 5 年国債	日本	国債証券	125,000,000	100.77 125,966,250	100.74 931,250	0.400000 2015/06/20	0.95
11	2 8 7 1 0 年国債	日本	国債証券	116,000,000	107.87 125,130,870	107.71 943,600	1.900000 2017/06/20	0.94
12	8 7 5 年国債	日本	国債証券	123,000,000	100.82 124,015,920	100.78 969,240	0.500000 2014/12/20	0.93
13	8 6 5 年国債	日本	国債証券	119,000,000	100.90 120,075,720	100.85 019,830	0.600000 2014/09/20	0.90
14	9 5 5 年国債	日本	国債証券	117,000,000	101.60 118,872,270	101.57 845,090	0.600000 2016/03/20	0.89
15	3 2 4 1 0 年国債	日本	国債証券	113,000,000	101.12 114,265,600	100.44 498,330	0.800000 2022/06/20	0.85
16	1 0 1 5 年国債	日本	国債証券	110,000,000	101.04 111,149,500	101.02 123,100	0.400000 2016/12/20	0.84
17	3 7 8 東北電力	日本	社債券	100,000,000	110.78 110,784,700	110.24 244,600	3.850000 2016/04/25	0.83
18	2 7 2 1 0 年国債	日本	国債証券	105,000,000	103.62 108,803,100	103.51 691,800	1.400000 2015/09/20	0.82
19	2 0 - 6 北海道公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.93 107,939,400	107.74 740,500	1.720000 2018/08/29	0.81
20	3 1 9 1 0 年国債	日本	国債証券	104,000,000	104.16 108,334,700	103.49 638,960	1.100000 2021/12/20	0.81
21	2 政保地方公営機	日本	特殊債券	100,000,000	107.76 107,764,100	107.53 536,900	1.600000 2018/11/16	0.81
22	2 1 - 2 埼玉県公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.80 107,802,800	107.44 444,900	1.570000 2019/05/27	0.81
23	2 1 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.74 107,746,700	107.24 242,300	1.570000 2019/11/25	0.81
24	2 9 3 大阪府公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.04 107,048,200	106.93 936,100	2.100000 2016/08/30	0.80
25	2 6 公営企業	日本	特殊債券	100,000,000	106.75 106,755,200	106.63 637,400	1.780000 2017/03/24	0.80
26	6 5 3 東京都公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.65 106,652,200	106.55 557,600	1.540000 2017/12/20	0.80
27	7 6 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	106.78 106,787,600	106.38 380,300	1.400000 2019/07/25	0.80
28	2 7 国際協力銀行	日本	特殊債券	100,000,000	106.46 106,465,800	106.35 355,400	1.770000 2017/03/17	0.80
29	1 8 - 2 北九州市債	日本	地方債証券	100,000,000	106.39 106,395,200	106.27 275,200	1.790000 2016/12/20	0.80
30	5 6 政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	106.24 106,241,800	106.09 096,000	1.400000 2018/04/20	0.80

(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	70.17%
地方債証券	9.44%
特殊債券	8.92%
社債券	10.79%
合計	99.33%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成24年12月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	126,004,257,016	97.90
内 ユーロ	52,099,972,326	40.48
内 シンガポール	497,629,259	0.39
内 マレーシア	678,675,794	0.53
内 ノルウェー	327,346,369	0.25
内 スウェーデン	773,364,029	0.60
内 デンマーク	1,018,958,866	0.79
内 イギリス	9,882,727,882	7.68
内 スイス	534,690,970	0.42
内 ポーランド	971,104,993	0.75
内 カナダ	3,499,516,301	2.72
内 アメリカ	51,806,190,182	40.25
内 メキシコ	1,175,947,750	0.91
内 南アフリカ	818,556,303	0.64
内 オーストラリア	1,919,575,992	1.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,707,116,770	2.10
純資産総額	128,711,373,786	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）	517,357,020	0.40
内 日本	517,357,020	0.40

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

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

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

(2) 投資資産（平成24年12月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単 価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,630,000	117.84 574,420,280	116.97 194,131	3.625000 2020/02/15	0.44
2	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,262,000	101.92 552,578,929	101.14 388,002	1.750000 2022/05/15	0.43
3	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,843,000	105.14 531,909,564	104.98 120,580	2.500000 2015/03/31	0.41
4	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,259,000	117.10 533,189,219	116.35 810,709	3.500000 2020/05/15	0.41
5	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,585,000	120.11 493,955,499	120.60 986,843	4.250000 2023/10/25	0.39
6	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,712,000	114.26 486,527,389	114.95 495,210	3.500000 2020/04/25	0.38
7	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,814,000	109.83 480,523,780	109.86 641,828	3.250000 2016/04/25	0.37
8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,841,000	106.73 470,271,488	107.44 412,674	2.500000 2020/10/25	0.37
9	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,963,000	103.43 470,220,483	103.93 502,255	3.750000 2016/08/01	0.37
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,430,000	118.73 467,169,469	119.34 565,293	4.250000 2019/04/25	0.36
11	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,929,000	110.68 472,359,899	109.96 257,400	2.625000 2020/08/15	0.36
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,752,000	107.95 464,646,862	107.93 547,822	3.000000 2015/10/25	0.36
13	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,184,000	99.98 448,758,907	100.00 844,184	0.250000 2014/09/30	0.35
14	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,191,000	100.40 451,261,497	99.64 818,807	1.625000 2022/08/15	0.35
15	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,635,000	111.67 448,149,876	111.27 536,657	3.250000 2017/03/31	0.35
16	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,156,000	99.98 446,352,946	100.00 406,480	0.250000 2014/10/31	0.35
17	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,921,000	104.67 445,961,451	104.50 245,669	2.375000 2015/02/28	0.35

18	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,184,000	123.09 445,905,478	121.32 482,573	3.875000 2040/08/15	0.34
19	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,930,000	103.00 439,657,437	102.87 409,959	2.250000 2014/05/31	0.34
20	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,417,000	114.42 437,603,494	113.67 735,619	3.125000 2021/05/15	0.34
21	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,738,000	101.29 434,319,437	101.31 403,076	3.400000 2014/04/30	0.34
22	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,622,000	104.71 435,048,734	104.52 259,298	3.000000 2014/07/12	0.34
23	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	2,873,000	108.31 434,150,432	107.96 747,900	5.000000 2014/09/07	0.34
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,230,000	116.05 429,980,634	116.54 796,199	3.750000 2021/04/25	0.34
25	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,509,000	110.65 431,989,095	109.90 4061,176	2.625000 2020/11/15	0.33
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,288,000	113.39 427,675,929	113.75 4049,500	3.750000 2017/04/25	0.33
27	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,598,000	103.21 425,975,407	103.51 242,173	4.250000 2019/09/01	0.33
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,507,000	143.96 414,011,624	146.95 610,205	5.750000 2032/10/25	0.33
29	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,658,000	104.02 419,530,418	103.88 961,475	1.875000 2015/06/30	0.33
30	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,521,000	103.31 417,270,476	103.68 773,361	4.250000 2019/02/01	0.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.90%
合計	97.90%

(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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2013 年1月	買建	145,000	12,050,602	12,616,450	0.01%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2013年1月	買建	843,000	12,146,285	12,956,910	0.01%

ユーロ買/円売 2013年1月	買建	1,282,000	137,500,910	147,045,400	0.11%
メキシコ・ペソ買/円売 2013年1月	買建	2,414,000	15,381,933	16,077,240	0.01%
ポーランド・ズロチ買/円 売 2013年1月	買建	437,000	11,427,768	12,292,810	0.01%
南アフリカ・ランド買/円 売 2013年1月	買建	1,022,000	9,578,354	10,414,180	0.01%
米ドル買/円売 2013年1月	買建	1,837,000	151,648,392	159,010,720	0.12%
シンガポール・ドル買/円 売 2013年1月	買建	90,000	6,087,716	6,368,400	0.00%
豪ドル買/円売 2013年1月	買建	284,000	24,384,296	25,477,640	0.02%
英ポンド買/円売 2013年1 月	買建	674,000	89,300,316	94,023,000	0.07%
スウェーデン・クローネ 買/円売 2013年1月	買建	747,000	9,267,730	9,950,040	0.01%
ノルウェー・クローネ買/ 円売 2013年1月	買建	270,000	3,927,420	4,195,800	0.00%
スイス・フラン買/円売 2013年1月	買建	73,000	6,512,979	6,928,430	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

[次へ](#)

（参考情報）

2012年12月28日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	7,960円
純資産総額	3百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	7.9%
3か月間	13.7%
6か月間	16.1%
1年間	24.1%
3年間	10.1%
5年間	-
設定来	-20.4%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

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

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
国内株式・先物	1,301	45.8%	日本円	58.4%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.9%
外国株式・先物	1,177	29.1%	米ドル	23.1%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.3%
国内リート	36	6.8%	ユーロ	7.0%	修正デュレーション	本田技研	日本	1.0%
外国リート	243	6.5%	英ポンド	4.0%	残存年数	TOPIX先物 2503月	日本	0.9%
外国債券	657	5.8%	豪ドル	2.1%	債券格付別構成	三井住友フィナンシャルG	日本	0.9%
国内債券	277	5.5%	カナダ・ドル	2.0%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.9%
			スイス・フラン	1.2%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.8%
			香港ドル	0.6%	A	日本リテールファンド	日本	0.5%
			シンガポール・ドル	0.5%	BBB	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.5%
コール・ローン、その他		1.7%	その他	1.1%	BB以下・無格付	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.3%
合計	3,691	-	合計	100.0%	合計	合計		9.0%

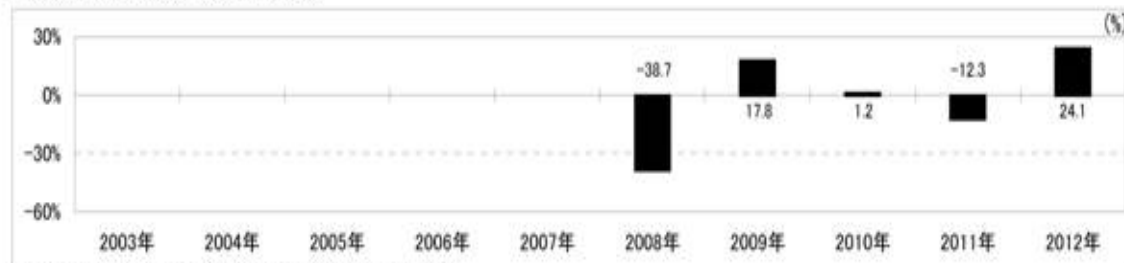
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.6%保有しております。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2008年は設定日(2月28日)から年末、2012年は12月28日までの騰落率を表しています。

第2 【管理及び運営】

1 【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受け付けを中止することができます。

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

2 【換金（解約）手続等】

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

< 一部解約 >

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・ お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

- ・ 委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受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。

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

知り得る直近の日の最終相場で評価します。

- ・ 公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
 2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
 3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・ お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

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

- ・ 委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年12月19日から翌年12月18日までとします。ただし、第1計算期間は、平成20年2月28日から平成20年12月18日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、あるいは、第34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。)を行ないません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないません。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発送します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

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

運用報告書

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

公告

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

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

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

償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（平成23年12月20日から平成24年12月18日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 平成23年12月19日現在	第5期 平成24年12月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,535	14,919
親投資信託受益証券	1,352,707	3,368,612
流動資産合計	1,359,242	3,383,531
資産合計	1,359,242	3,383,531
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	289	729
未払委託者報酬	3,863	9,129
その他未払費用	182	182
流動負債合計	4,334	10,040
負債合計	4,334	10,040
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,153,020	1 4,412,567
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 798,112	2 1,039,076
（分配準備積立金）	-	125,828
元本等合計	1,354,908	3,373,491
純資産合計	1,354,908	3,373,491
負債純資産合計	1,359,242	3,383,531

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日		自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日	
営業収益				
有価証券売買等損益		180,416		319,905
営業収益合計		180,416		319,905
営業費用				
受託者報酬		483		1,307
委託者報酬		7,213		16,535
その他費用		364		365
営業費用合計		8,060		18,207
営業利益又は営業損失（ ）		188,476		301,698
経常利益又は経常損失（ ）		188,476		301,698
当期純利益又は当期純損失（ ）		188,476		301,698
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		942		20,680
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		348,876		798,112
剰余金増加額又は欠損金減少額		32,733		704,861
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		32,733		704,861
剰余金減少額又は欠損金増加額		292,551		1,226,843
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		292,551		1,226,843
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		798,112		1,039,076

(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5期 自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 平成23年12月18日が休日のため、前計算期間末日を平成23年12月19日としております。このため、当計算期間は365日となっております。

(追加情報)

第5期 自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
第5期計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第4期 平成23年12月19日現在	第5期 平成24年12月18日現在
1. 1 期首元本額	1,301,481円	2,153,020円
期中追加設定元本額	974,376円	4,521,213円
期中一部解約元本額	122,837円	2,261,666円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,153,020口	4,412,567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798,112円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,039,076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4期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月19日	第5期 自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
----	---------------------------------------	---------------------------------------

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(125,828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)より分配可能額は125,828円(1万口当たり285.16円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第5期 自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第5期 平成24年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 平成23年12月19日現在	第5期 平成24年12月18日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	179,261	288,253
合計	179,261	288,253

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第4期 平成23年12月19日現在	第5期 平成24年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第5期 自 平成23年12月20日 至 平成24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4期 平成23年12月19日現在	第5期 平成24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)	0.6293円 (6,293円)	0.7645円 (7,645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	3,323,105	1,525,305	
	外国株式インデックスマザーファンド	977,752	1,012,951	
	外国債券インデックスマザーファンド	100,995	200,565	
	ダイワJ-REITマザーファンド	182,280	233,482	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	170,645	200,951	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	170,188	195,358	
親投資信託受益証券 合計			3,368,612	
合計			3,368,612	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成23年12月19日現在		平成24年12月18日現在	
	金額（円）		金額（円）	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		1,419,458,317		1,334,166,652
株式	3	79,045,150,660		91,258,540,710
派生商品評価勘定		-		39,999,965
未収入金		-		3,015,491
未収配当金		11,031,700		10,518,638
前払金		48,035,000		-
流動資産合計		80,523,675,677		92,646,241,456
資産合計		80,523,675,677		92,646,241,456
負債の部				
流動負債				
派生商品評価勘定		59,772,024		-
前受金		-		25,730,000
未払金		314,125		-
未払解約金		18,257,000		108,997,000
流動負債合計		78,343,149		134,727,000
負債合計		78,343,149		134,727,000
純資産の部				
元本等				
元本	1	204,724,819,772		201,568,942,984
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	124,279,487,244		109,057,428,528
元本等合計		80,445,332,528		92,511,514,456
純資産合計		80,445,332,528		92,511,514,456
負債純資産合計		80,523,675,677		92,646,241,456

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23年12月20日 至 平成24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）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 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。

(追加情報)

自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
1. 1 期首	平成22年12月21日	平成23年12月20日
期首元本額	200,751,042,931円	204,724,819,772円
期中追加設定元本額	19,578,777,632円	17,296,801,557円
期中一部解約元本額	15,605,000,791円	20,452,678,345円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
適格機関投資家専用投信1号	2,077,517,619円	1,998,530,202円
トピックス・インデックスファンド	10,487,562,820円	9,782,893,736円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	34,573,693,019円	27,491,495,477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	874,459,631円	803,040,978円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	420,852,938円	410,275,341円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	6,729,476,076円	6,684,255,711円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	394,142,678円	405,076,477円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	8,791,510,227円	8,847,959,697円
DCダイワ日本株式インデックス	60,468,426,315円	63,668,373,750円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,411,426,571円	2,769,238,424円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,001,108,441円	1,990,370,525円
ダイワ・ライフ・バランス70	766,514,528円	1,461,664,009円
年金ダイワ日本株式インデックス	1,753,058,736円	2,259,459,772円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	19,141,760円	22,049,573円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	18,988,128円	31,319,190円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,562,824円	3,323,105円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	479,797,970円	494,018,413円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	3,619,442,756円	3,578,278,361円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	2,126,251,104円	1,997,617,946円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	119,251,952円	115,543,742円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	813,328,821円	796,922,624円

ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)	383,210,607円	369,541,369円
ダイワ世界バランスファンド40VA	4,221,969,163円	3,936,183,109円
ダイワ世界バランスファンド60VA	618,316,360円	582,261,871円
ダイワ・バランスファンド35VA	33,146,326,670円	32,198,179,949円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	2,581,360,950円	2,365,876,405円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	5,432,629,290円	5,152,596,941円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	3,021,942,080円	2,842,626,590円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	576,398,066円	542,310,526円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	703,050,666円	614,885,899円
ダイワライフスタイル25	208,989,454円	230,063,000円
ダイワライフスタイル50	594,279,914円	654,994,154円
ダイワライフスタイル75	462,369,640円	495,626,689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)	14,826,461,998円	15,972,089,429円
計	204,724,819,772円	201,568,942,984円
2. 期末日における受益権の総数	204,724,819,772口	201,568,942,984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124,279,487,244円でありませ	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は109,057,428,528円でありませ
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 443,700,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 618,000,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成23年12月20日 至平成24年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	4,261,033,491	5,830,993,362
合計	4,261,033,491	5,830,993,362

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成23年9月21日から平成23年12月19日まで、及び平成24年9月20日から平成24年12月18日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	平成23年12月19日 現在				平成24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）	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	1,461,930,000	-	1,402,380,000	59,550,000	1,130,987,000	-	1,171,170,000	40,183,000
合計	1,461,930,000	-	1,402,380,000	59,550,000	1,130,987,000	-	1,171,170,000	40,183,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成23年12月19日現在	平成24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)	0.3929円 (3,929円)	0.4590円 (4,590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	43,000	186	7,998,000	
日本水産	109,500	167	18,286,500	
マルハニチロホールディングス	188,000	147	27,636,000	
サカタのタネ	14,100	1,069	15,072,900	
ホクト	9,200	1,697	15,612,400	
ショーボンドHD	8,200	2,951	24,198,200	
ミライト・ホールディングス	25,700	756	19,429,200	
日鉄鉱業	25,000	352	8,800,000	
三井松島	66,000	137	9,042,000	
国際石油開発帝石	1,103	454,500	501,313,500	
日本海洋掘削	2,800	2,386	6,680,800	
関東天然瓦斯	12,000	445	5,340,000	
石油資源開発	13,100	2,999	39,286,900	
間組	35,700	268	9,567,600	
東急建設	41,200	187	7,704,400	
コムシスホールディングス	45,000	1,086	48,870,000	
ミサワホーム	11,100	1,157	12,842,700	
高松コンストラクションGP	7,500	1,340	10,050,000	
東建コーポレーション	3,560	4,525	16,109,000	
大成建設	468,000	257	120,276,000	
大林組	275,000	446	122,650,000	
清水建設	281,000	294	82,614,000	
長谷工コーポレーション	588,500	62	36,487,000	
鹿島建設	410,000	270	110,700,000	
不動テトラ	71,800	161	11,559,800	
鉄建建設	68,000	128	8,704,000	
安藤建設	47,000	138	6,486,000	
太平工業	21,000	343	7,203,000	
西松建設	120,000	168	20,160,000	
前田建設	59,000	412	24,308,000	
奥村組	83,000	320	26,560,000	
東鉄工業	13,000	1,159	15,067,000	
戸田建設	106,000	227	24,062,000	
熊谷組	79,000	95	7,505,000	
北野建設	31,000	207	6,417,000	
三井ホーム	16,000	446	7,136,000	
矢作建設	14,100	418	5,893,800	
大東建託	34,100	8,040	274,164,000	
NIPPO	22,000	1,105	24,310,000	
東亜道路	21,000	264	5,544,000	
前田道路	27,000	1,288	34,776,000	
日本道路	30,000	362	10,860,000	

東亜建設	89,000	137	12,193,000
東洋建設	31,400	292	9,168,800
五洋建設	112,500	225	25,312,500
福田組	17,000	384	6,528,000
住友林業	64,000	772	49,408,000
日本基礎技術	15,800	322	5,087,600
日成ビルド工業	32,000	186	5,952,000
エス・パイ・エル	58,000	140	8,120,000
巴コーポレーション	18,800	280	5,264,000
パナホーム	35,000	554	19,390,000
大和ハウス	227,000	1,376	312,352,000
ライト工業	22,500	471	10,597,500
積水ハウス	270,000	869	234,630,000
ユアテック	16,000	300	4,800,000
中電工	14,600	778	11,358,800
関電工	43,000	387	16,641,000
きんでん	60,000	568	34,080,000
東京エネシス	12,000	441	5,292,000
トーエネック	16,000	469	7,504,000
住友電設	7,500	917	6,877,500
日本電設工業	17,000	770	13,090,000
協和エクシオ	32,500	879	28,567,500
新日本空調	9,900	488	4,831,200
日本工営	33,000	282	9,306,000
N D S	20,000	254	5,080,000
九電工	18,000	409	7,362,000
三機工業	24,000	401	9,624,000
日揮	91,000	2,649	241,059,000
中外炉工業	33,000	219	7,227,000
太平電業	13,000	544	7,072,000
高砂熱学	27,000	651	17,577,000
N E C ネットズエスアイ	8,200	1,533	12,570,600
朝日工業社	13,000	291	3,783,000
大気社	13,500	1,680	22,680,000
ダイダン	14,000	533	7,462,000
日比谷総合設	11,900	974	11,590,600
東芝プラントシステム	15,000	1,200	18,000,000
日本製粉	57,000	347	19,779,000
日清製粉G本社	81,500	1,056	86,064,000
昭和産業	44,000	275	12,100,000
鳥越製粉	8,300	637	5,287,100
協同飼料	60,000	96	5,760,000
中部飼料	9,900	522	5,167,800
日本配合飼料	44,000	101	4,444,000
日本甜菜糖	57,000	159	9,063,000
三井製糖	37,000	256	9,472,000
日本M & Aセンター	4,600	3,015	13,869,000
アコーディア・ゴルフ	387	75,400	29,179,800
パソナグループ	93	48,300	4,491,900
G C A サヴィアングループ	49	100,000	4,900,000
エス・エム・エス	27	175,300	4,733,100
テンプホールディングス	12,400	1,123	13,925,200
クックパッド	1,900	2,413	4,584,700
森永製菓	87,000	182	15,834,000
中村屋	25,000	402	10,050,000

江崎グリコ	31,000	888	27,528,000
名糖産業	5,500	994	5,467,000
不二家	58,000	196	11,368,000
山崎製パン	65,000	971	63,115,000
モロゾフ	24,000	286	6,864,000
亀田製菓	5,100	1,953	9,960,300
カルビー	8,100	5,980	48,438,000
森永乳業	76,000	269	20,444,000
ヤクルト	52,800	3,755	198,264,000
明治ホールディングス	26,800	3,645	97,686,000
雪印メグミルク	18,000	1,369	24,642,000
プリマハム	63,000	144	9,072,000
日本ハム	69,000	1,177	81,213,000
伊藤ハム	52,000	371	19,292,000
丸大食品	45,000	282	12,690,000
米久	9,700	698	6,770,600
S Foods	8,000	778	6,224,000
スタジオアリス	4,900	1,268	6,213,200
シミックホールディングス	3,800	1,206	4,582,800
システナ	97	75,000	7,275,000
NECフィールドディング	7,700	1,006	7,746,200
新日鉄住金SOL	5,800	1,555	9,019,000
総合警備保障	30,600	1,039	31,793,400
日本駐車場開発	1,134	4,320	4,898,880
カカクコム	11,900	2,877	34,236,300
ツクイ	4,200	1,690	7,098,000
エムスリー	205	141,000	28,905,000
ディー・エヌ・エー	41,800	2,901	121,261,800
博報堂DYHLDGS	11,370	5,410	61,511,700
ぐるなび	7,100	919	6,524,900
PGMホールディングス	153	72,600	11,107,800
サッポロホールディングス	155,000	273	42,315,000
アサヒグループホールディング	180,600	1,861	336,096,600
麒麟HD	386,000	1,015	391,790,000
宝ホールディングス	74,000	629	46,546,000
オエノンホールディングス	35,000	205	7,175,000
養命酒	10,000	715	7,150,000
三国コカ・コ・ラ	11,100	792	8,791,200
コカ・コーラウエスト	30,100	1,309	39,400,900
コカコーラセントラルジャパン	10,900	1,043	11,368,700
ダイトードリンク	4,300	3,395	14,598,500
伊藤園	24,400	1,579	38,527,600
キーコーヒー	9,100	1,562	14,214,200
日清オイリオグループ	37,000	310	11,470,000
不二製油	20,800	1,221	25,396,800
J-オイルミルズ	37,000	231	8,547,000
ローソン	29,500	5,560	164,020,000
サンエー	3,000	3,130	9,390,000
カワチ薬品	6,000	1,649	9,894,000
エービーシー・マート	9,400	3,635	34,169,000
アスクル	5,800	1,137	6,594,600
ゲオホールディングス	138	88,400	12,199,200
ポイント	7,140	3,065	21,884,100
伊藤忠食品	2,600	2,899	7,537,400
くらコーポレーション	5,300	1,164	6,169,200

キャンドウ	68	104,100	7,078,800
エレマテック	5,400	1,083	5,848,200
パル	2,500	3,870	9,675,000
エディオン	35,300	335	11,825,500
あらた	20,000	335	6,700,000
サーラコーポレーション	9,700	486	4,714,200
あみやき亭	19	201,300	3,824,700
ひらまつ	54	98,100	5,297,400
双日	522,300	116	60,586,800
アルフレッサホールディングス	20,600	3,415	70,349,000
大黒天物産	1,500	2,575	3,862,500
ハニーズ	7,490	1,125	8,426,250
キッコーマン	75,000	1,195	89,625,000
味の素	238,000	1,161	276,318,000
キュービー	45,700	1,196	54,657,200
ハウス食品	30,900	1,280	39,552,000
カゴメ	32,500	1,621	52,682,500
焼津水産化工	8,500	739	6,281,500
アリアケジャパン	8,600	1,576	13,553,600
ニチレイ	104,000	443	46,072,000
横浜冷凍	20,900	590	12,331,000
東洋水産	41,000	2,331	95,571,000
日清食品HD	34,800	3,255	113,274,000
永谷園	9,000	838	7,542,000
フジッコ	10,000	1,023	10,230,000
ロックフィールド	5,200	1,429	7,430,800
日本たばこ産業	401,700	2,343	941,183,100
わらべや日洋	5,900	1,570	9,263,000
片倉工業	12,000	689	8,268,000
グンゼ	67,000	212	14,204,000
ヒューリック	95,200	491	46,743,200
アルペン	5,900	1,522	8,979,800
アルコニックス	3,000	1,333	3,999,000
ビックカメラ	298	40,900	12,188,200
DCMホールディングス	41,900	539	22,584,100
MonotaRO	5,600	2,822	15,803,200
あいホールディングス	13,400	597	7,999,800
J. フロントリテイリング	191,000	434	82,894,000
ドトール・日レスHD	13,800	1,060	14,628,000
マツモトキヨシHLDGS	13,900	1,997	27,758,300
スタートトゥデイ	16,300	821	13,382,300
ココカラファイン	8,500	2,697	22,924,500
三越伊勢丹HD	159,800	768	122,726,400
東洋紡	365,000	115	41,975,000
ユニチカ	241,000	43	10,363,000
富士紡ホールディングス	41,000	307	12,587,000
日清紡ホールディングス	57,000	656	37,392,000
倉敷紡績	89,000	136	12,104,000
ダイワボウHD	79,000	164	12,956,000
シキボウ	67,000	104	6,968,000
日東紡績	69,000	313	21,597,000
トヨタ紡織	29,000	859	24,911,000
ウエルシアHD	2,900	2,799	8,117,100
クリエイトSDH	3,800	2,362	8,975,600
バイタルKSKHD	15,900	842	13,387,800

UKCホールディングス	5,200	1,707	8,876,400
TOKAIホールディングス	33,800	274	9,261,200
日本毛織	28,000	554	15,512,000
ダイドーリミテッド	11,700	525	6,142,500
野村不動産HLDS	38,500	1,541	59,328,500
帝国繊維	11,000	640	7,040,000
ブックオフコーポレーション	6,000	669	4,014,000
日本コークス工業	80,500	104	8,372,000
あさひ	5,100	1,203	6,135,300
コスモス薬品	3,600	8,510	30,636,000
シップヘルスケアHD	11,500	2,455	28,232,500
セブン&アイ・HLDS	333,700	2,389	797,209,300
ツルハホールディングス	6,600	6,410	42,306,000
サンマルクホールディングス	2,600	3,020	7,852,000
トリドール	7,600	936	7,113,600
クスリのアオキ	1,300	4,880	6,344,000
帝人	326,000	197	64,222,000
東レ	654,000	491	321,114,000
クラレ	142,800	1,032	147,369,600
旭化成	526,000	483	254,058,000
サカイオーベックス	34,000	115	3,910,000
稲葉製作所	4,800	1,056	5,068,800
宮地エンジニアリングG	34,000	164	5,576,000
トーカロ	5,500	1,437	7,903,500
SUMCO	53,300	724	38,589,200
住江織物	33,000	167	5,511,000
日本バイリン	13,000	342	4,446,000
芦森工業	37,000	121	4,477,000
アツギ	66,000	100	6,600,000
ダイニック	25,000	161	4,025,000
セーレン	24,200	506	12,245,200
小松精練	16,000	383	6,128,000
ワコールホールディングス	51,000	892	45,492,000
ホギメディカル	5,400	4,120	22,248,000
TSIホールディングス	43,400	471	20,441,400
ITホールディングス	26,500	981	25,996,500
グリー	41,500	1,391	57,726,500
コーエーテクモHD	16,900	731	12,353,900
三菱総合研究所	4,200	1,824	7,660,800
ネクソン	65,300	899	58,704,700
特種東海製紙	52,000	206	10,712,000
ドワンゴ	46	179,900	8,275,400
マクロミル	9,300	947	8,807,100
ティーガイア	10,600	802	8,501,200
GMOペイメントゲートウェイ	3,400	1,372	4,664,800
ザップラス	63	81,600	5,140,800
インターネットイニシアティブ	9,700	1,820	17,654,000
SRAホールディングス	5,800	905	5,249,000
朝日ネット	10,000	415	4,150,000
王子ホールディングス	371,000	260	96,460,000
三菱製紙	148,000	82	12,136,000
北越紀州製紙	54,000	459	24,786,000
中越パルプ	41,000	144	5,904,000
大王製紙	37,000	566	20,942,000
日本製紙G本社	41,800	1,136	47,484,800

レンゴー	66,000	400	26,400,000
トーモク	36,000	233	8,388,000
ザ・パック	5,900	1,464	8,637,600
昭和電工	533,000	123	65,559,000
住友化学	587,000	264	154,968,000
住友精化	19,000	291	5,529,000
日産化学	61,500	963	59,224,500
クレハ	60,000	291	17,460,000
テイカ	20,000	239	4,780,000
石原産業	168,000	63	10,584,000
日本曹達	56,000	368	20,608,000
東ソー	235,000	189	44,415,000
トクヤマ	131,000	171	22,401,000
セントラル硝子	79,000	280	22,120,000
東亜合成	101,000	341	34,441,000
ダイソー	38,000	228	8,664,000
電気化学	175,000	277	48,475,000
イビデン	49,700	1,218	60,534,600
信越化学	152,100	4,930	749,853,000
日本カ-バイド	37,000	233	8,621,000
堺化学	33,000	243	8,019,000
エア・ウォーター	69,000	1,064	73,416,000
大陽日酸	111,000	481	53,391,000
日本化学工業	51,000	110	5,610,000
日本パ-カラijing	21,000	1,185	24,885,000
高压ガス	16,000	423	6,768,000
四国化成	15,000	485	7,275,000
ステラケミファ	4,300	1,501	6,454,300
日本触媒	62,000	834	51,708,000
大日精化	33,000	340	11,220,000
カネカ	104,000	412	42,848,000
協和発酵キリン	102,000	852	86,904,000
三菱瓦斯化学	134,000	495	66,330,000
三井化学	368,000	206	75,808,000
J S R	82,100	1,566	128,568,600
東京応化工業	16,300	1,633	26,617,900
三菱ケミカルH L D G S	532,500	391	208,207,500
日本合成化学	20,000	639	12,780,000
ダイセル	102,000	515	52,530,000
住友ベ-クライト	68,000	335	22,780,000
積水化学	175,000	709	124,075,000
日本ゼオン	74,000	676	50,024,000
アイカ工業	23,800	1,392	33,129,600
宇部興産	408,000	176	71,808,000
積水樹脂	14,000	844	11,816,000
タキロン	24,000	290	6,960,000
旭有機材	34,000	198	6,732,000
日立化成	36,800	1,170	43,056,000
大倉工業	25,000	264	6,600,000
積水化成品	24,000	208	4,992,000
群栄化学	28,000	195	5,460,000
日本カ-リット	11,500	418	4,807,000
日本化薬	60,000	909	54,540,000
イーピーエス	52	226,900	11,798,800
パナソニック インフォシス	2,200	1,922	4,228,400

フェイス	459	8,570	3,933,630
アミューズ	3,400	1,677	5,701,800
野村総合研究所	44,700	1,676	74,917,200
ケネディクス	862	17,410	15,007,420
電通	77,100	2,136	164,685,600
インテージ	3,200	1,811	5,795,200
シンプレクスホールディング	198	23,370	4,627,260
イオンファンタジー	3,600	1,111	3,999,600
日本精化	8,900	562	5,001,800
A D E K A	36,800	721	26,532,800
日油	68,000	373	25,364,000
ミヨシ油脂	57,000	104	5,928,000
花 王	224,600	2,275	510,965,000
第一工業製薬	23,000	206	4,738,000
三洋化成	27,000	454	12,258,000
武田薬品	317,400	3,845	1,220,403,000
アステラス製薬	188,200	4,045	761,269,000
大日本住友製薬	61,300	1,019	62,464,700
塩野義製薬	124,200	1,443	179,220,600
田辺三菱製薬	69,700	1,119	77,994,300
あすか製薬	13,000	456	5,928,000
日本新薬	18,000	953	17,154,000
中外製薬	98,600	1,651	162,788,600
科研製薬	33,000	1,288	42,504,000
エーザイ	104,400	3,510	366,444,000
ロート製薬	36,000	1,013	36,468,000
小野薬品	41,200	4,470	184,164,000
久光製薬	26,400	4,295	113,388,000
持田製薬	32,000	1,066	34,112,000
参天製薬	30,400	3,410	103,664,000
扶桑薬品	35,000	299	10,465,000
日本ケミファ	16,000	500	8,000,000
ツムラ	23,400	2,617	61,237,800
日医工	12,800	1,655	21,184,000
テ ル モ	62,000	3,510	217,620,000
みらかホールディングス	22,100	3,460	76,466,000
キッセイ薬品工業	16,000	1,571	25,136,000
生化学工業	17,600	893	15,716,800
栄研化学	7,400	1,106	8,184,400
日水製薬	5,900	847	4,997,300
鳥居薬品	6,300	1,884	11,869,200
東和薬品	4,500	4,570	20,565,000
沢井製薬	5,700	8,730	49,761,000
ゼリア新薬工業	13,000	1,387	18,031,000
第一三共	267,000	1,300	347,100,000
キョーリン製薬HD	22,400	1,650	36,960,000
大幸薬品	5,500	792	4,356,000
ダイト	3,100	1,410	4,371,000
大塚ホールディングス	167,100	2,428	405,718,800
大正製薬HD	20,300	6,020	122,206,000
大日本塗料	72,000	96	6,912,000
日本ペイント	74,000	671	49,654,000
関西ペイント	95,000	864	82,080,000
中国塗料	27,000	494	13,338,000
藤倉化成	13,300	334	4,442,200

太陽ホールディングス	7,000	2,428	16,996,000
D I C	312,000	149	46,488,000
サカタインクス	21,000	428	8,988,000
東洋インキS Cホールディン	75,000	349	26,175,000
アルプス技研	6,600	667	4,402,200
サニックス	16,500	251	4,141,500
オリエンタルランド	24,900	10,330	257,217,000
ダスキン	23,700	1,528	36,213,600
パーク24	41,700	1,337	55,752,900
明光ネットワークジャパン	10,100	926	9,352,600
ファルコS Dホールディングス	6,200	991	6,144,200
フジ・メディア・HD	776	120,800	93,740,800
ラウンドワン	29,000	491	14,239,000
リゾートトラスト	14,500	1,627	23,591,500
オービック	2,640	16,950	44,748,000
ヤフー	5,855	27,620	161,715,100
ビー・エム・エル	5,800	2,132	12,365,600
トレンドマイクロ	31,900	2,355	75,124,500
もしもしホットライン	14,400	1,064	15,321,600
東急コミュニティー	2,700	3,000	8,100,000
リソー教育	1,068	6,570	7,016,760
日本オラクル	15,500	3,475	53,862,500
アルファシステムズ	4,000	1,098	4,392,000
フューチャーアーキテクト	141	34,000	4,794,000
シーエーシー	6,000	685	4,110,000
ユー・エス・エス	9,440	8,850	83,544,000
オービックビジネスC	2,500	4,520	11,300,000
伊藤忠テクノソリューションズ	9,500	3,650	34,675,000
アイティフォー	13,700	316	4,329,200
大塚商会	6,800	6,570	44,676,000
総合メディカル	2,200	2,892	6,362,400
サイボウズ	175	24,570	4,299,750
セントラルスポーツ	4,200	1,270	5,334,000
電通国際情報S	6,700	789	5,286,300
ウェザーニューズ	2,700	2,656	7,171,200
WOWOW	32	184,200	5,894,400
富士フイルムHLDGS	181,300	1,670	302,771,000
コニカミノルタHLDGS	215,000	617	132,655,000
資生堂	149,500	1,167	174,466,500
ライオン	97,000	431	41,807,000
高砂香料	29,000	424	12,296,000
マンダム	9,100	2,285	20,793,500
ミルボン	4,800	2,752	13,209,600
ファンケル	22,400	878	19,667,200
コーセー	14,700	1,795	26,386,500
ドクターシーラボ	58	260,300	15,097,400
ポーラ・オルビスHD	9,800	2,462	24,127,600
ノエビアホールディングス	5,500	1,263	6,946,500
エステー	7,100	899	6,382,900
コニシ	7,400	1,461	10,811,400
長谷川香料	10,800	1,097	11,847,600
小林製薬	12,500	4,120	51,500,000
荒川化学工業	9,500	655	6,222,500
日本高純度化学	32	196,700	6,294,400
アース製薬	6,500	2,977	19,350,500

イハラケミカル	17,000	399	6,783,000
大成ラミック	2,500	2,346	5,865,000
クミアイ化学	21,000	389	8,169,000
日本農薬	22,000	431	9,482,000
昭和シエル石油	78,200	500	39,100,000
コスモ石油	234,000	174	40,716,000
ニチレキ	14,000	445	6,230,000
東燃ゼネラル石油	125,000	771	96,375,000
ユシロ化学	6,600	844	5,570,400
AOCホールディングス	21,500	326	7,009,000
出光興産	10,100	7,130	72,013,000
JXホールディングス	941,700	467	439,773,900
横浜ゴム	97,000	589	57,133,000
東洋ゴム	74,000	251	18,574,000
ブリヂストン	265,800	2,080	552,864,000
住友ゴム	65,200	1,016	66,243,200
オカモト	32,000	303	9,696,000
アキレス	76,000	110	8,360,000
ニッタ	8,600	1,323	11,377,800
東海ゴム工業	15,900	797	12,672,300
三ツ星ベルト	24,000	493	11,832,000
バンドー化学	32,000	282	9,024,000
鬼怒川ゴム	18,000	537	9,666,000
旭硝子	419,000	625	261,875,000
日本板硝子	396,000	95	37,620,000
日本山村硝子	38,000	178	6,764,000
日本電気硝子	151,000	472	71,272,000
住友大阪セメント	155,000	290	44,950,000
太平洋セメント	477,000	207	98,739,000
日本ヒューム	10,000	424	4,240,000
日本コンクリート	17,000	283	4,811,000
東海カーボン	77,000	312	24,024,000
日本カーボン	48,000	158	7,584,000
東洋炭素	4,500	1,613	7,258,500
ノリタケ	47,000	203	9,541,000
TOTO	133,000	610	81,130,000
日本碍子	111,000	904	100,344,000
日本特殊陶業	73,000	1,077	78,621,000
MARUWA	2,100	2,801	5,882,100
品川リフラクトリーズ	26,000	181	4,706,000
黒崎播磨	22,000	205	4,510,000
フジインコーポレーテッド	8,400	1,635	13,734,000
ニチアス	40,000	433	17,320,000
新日鐵住金	3,587,000	195	699,465,000
神戸製鋼所	1,185,000	91	107,835,000
合同製鐵	53,000	148	7,844,000
JFEホールディングス	217,200	1,447	314,288,400
日新製鋼HD	35,900	668	23,981,200
東京製鐵	47,500	337	16,007,500
共英製鋼	8,600	1,445	12,427,000
大和工業	17,800	2,351	41,847,800
東京鐵鋼	19,000	283	5,377,000
大阪製鐵	5,100	1,412	7,201,200
淀川製鋼所	63,000	275	17,325,000
東洋鋼鈹	23,000	262	6,026,000

住友鋼管	7,500	633	4,747,500
丸一鋼管	28,000	1,877	52,556,000
大同特殊鋼	133,000	406	53,998,000
日本冶金工	76,500	86	6,579,000
山陽特殊製鋼	44,000	284	12,496,000
愛知製鋼	47,000	371	17,437,000
日立金属	60,000	701	42,060,000
大平洋金属	57,000	352	20,064,000
日本電工	35,000	228	7,980,000
栗本鉄工所	41,000	310	12,710,000
日本製鋼所	133,000	505	67,165,000
三菱製鋼	57,000	162	9,234,000
日本軽金属HD	181,400	87	15,781,800
三井金属	225,000	205	46,125,000
東邦亜鉛	52,000	344	17,888,000
三菱マテリアル	501,000	260	130,260,000
住友鋳山	220,000	1,179	259,380,000
DOWAホールディングス	96,000	534	51,264,000
古河機金	172,000	78	13,416,000
大阪チタニウム	8,700	1,733	15,077,100
東邦チタニウム	15,100	776	11,717,600
住友軽金属	222,000	75	16,650,000
古河スカイ	35,000	227	7,945,000
古河電工	276,000	172	47,472,000
住友電工	299,900	935	280,406,500
フジクラ	140,000	245	34,300,000
昭和電線HLDGS	137,000	68	9,316,000
タツタ電線	17,000	818	13,906,000
日立電線	73,000	132	9,636,000
リョービ	50,000	213	10,650,000
アサヒHD	12,800	1,428	18,278,400
東洋製罐	60,500	1,054	63,767,000
ホッカカンホールディングス	25,000	235	5,875,000
コロナ	4,900	1,031	5,051,900
横河ブリッジHLDGS	19,000	744	14,136,000
駒井ハルテック	24,000	250	6,000,000
三和ホールディングス	85,000	365	31,025,000
文化シャツタ-	27,000	388	10,476,000
三協立山	12,100	1,601	19,372,100
LIXILグループ	117,700	1,813	213,390,100
ノーリツ	17,100	1,419	24,264,900
長府製作所	8,200	1,842	15,104,400
リンナイ	13,700	5,830	79,871,000
ユニプレス	14,400	1,960	28,224,000
ダイニチ工業	4,700	865	4,065,500
岡部	18,900	586	11,075,400
東プレ	16,900	776	13,114,400
高周波熱錬	12,900	520	6,708,000
東京製綱	66,000	117	7,722,000
パイオラックス	3,900	1,961	7,647,900
日本発条	61,600	672	41,395,200
三浦工業	13,300	2,210	29,393,000
タクマ	31,000	480	14,880,000
ツガミ	24,000	574	13,776,000
オークマ	58,000	543	31,494,000

東芝機械	46,000	408	18,768,000
アマダ	130,000	534	69,420,000
アイダエンジニア	22,400	672	15,052,800
牧野フライス	42,000	482	20,244,000
オーエスジー	35,900	1,133	40,674,700
旭ダイヤモンド	21,900	787	17,235,300
森精機製作所	46,400	665	30,856,000
ディスコ	9,400	4,310	40,514,000
日東工器	5,700	1,807	10,299,900
豊田自動織機	73,400	2,516	184,674,400
大阪機工	56,000	109	6,104,000
島精機製作所	11,800	1,369	16,154,200
日阪製作所	12,000	710	8,520,000
やまびこ	3,700	1,206	4,462,200
ナブテスコ	42,000	1,788	75,096,000
三井海洋開発	7,300	1,815	13,249,500
S M C	25,200	14,930	376,236,000
新川	12,000	403	4,836,000
ホソカワミクロン	18,000	513	9,234,000
ユニオンツール	5,500	1,324	7,282,000
オイレス工業	9,400	1,697	15,951,800
サト - ホールディングス	9,300	1,357	12,620,100
小松製作所	395,800	2,039	807,036,200
住友重機械	233,000	374	87,142,000
日立建機	43,800	1,607	70,386,600
日工	16,000	344	5,504,000
巴工業	3,800	1,544	5,867,200
井関農機	86,000	225	19,350,000
T O W A	9,000	536	4,824,000
丸山製作所	32,000	161	5,152,000
北川鉄工所	47,000	140	6,580,000
クボタ	451,000	940	423,940,000
東洋エンジニア	50,000	388	19,400,000
三菱化工機	38,000	146	5,548,000
月島機械	14,000	748	10,472,000
帝国電機製作所	3,800	1,263	4,799,400
新東工業	19,000	613	11,647,000
アイチ コーポレーション	16,600	374	6,208,400
小森コーポレーション	22,600	672	15,187,200
鶴見製作所	8,000	656	5,248,000
住友精密	16,000	409	6,544,000
酒井重工業	19,000	280	5,320,000
荏原製作所	161,000	348	56,028,000
西島製作所	10,800	629	6,793,200
千代田化工建	66,000	1,183	78,078,000
ダイキン工業	110,300	2,894	319,208,200
オルガノ	16,000	498	7,968,000
ト - ヨ - カネツ	51,000	179	9,129,000
栗田工業	46,100	1,845	85,054,500
椿本チエイン	45,000	467	21,015,000
大同工業	30,000	135	4,050,000
日機装	29,000	925	26,825,000
新興プランテック	19,200	665	12,768,000
アネスト岩田	18,000	341	6,138,000
ダイフク	38,500	542	20,867,000

加藤製作所	23,000	244	5,612,000
タダノ	40,000	646	25,840,000
フジテック	25,000	597	14,925,000
C K D	25,000	515	12,875,000
平和	18,300	1,279	23,405,700
理想科学工業	6,200	1,593	9,876,600
S A N K Y O	24,200	3,360	81,312,000
日本金銭機械	8,900	719	6,399,100
マースエンジニアリング	4,800	1,718	8,246,400
ダイコク電機	3,700	1,756	6,497,200
ア マ ノ	24,700	734	18,129,800
J U K I	61,000	113	6,893,000
サンデン	48,000	347	16,656,000
ブラザー工業	104,800	870	91,176,000
マックス	14,000	1,028	14,392,000
モリタホールディングス	16,000	751	12,016,000
グローリー	23,900	1,886	45,075,400
大和冷機工業	17,000	410	6,970,000
セガサミーホールディングス	87,300	1,475	128,767,500
日本ピストンリング	41,000	153	6,273,000
リ ケ ン	32,000	304	9,728,000
T P R	9,800	1,056	10,348,800
ホシザキ電機	18,000	2,356	42,408,000
大豊工業	6,900	915	6,313,500
日本精工	182,000	561	102,102,000
N T N	179,000	208	37,232,000
ジェイテクト	86,300	740	63,862,000
不 二 越	78,000	309	24,102,000
ミネベア	116,000	282	32,712,000
日本トムソン	29,000	355	10,295,000
T H K	54,400	1,467	79,804,800
ユーシン精機	4,900	1,581	7,746,900
イーグル工業	12,000	669	8,028,000
日本ピラ - 工業	10,000	540	5,400,000
キッツ	35,100	395	13,864,500
日 立	1,895,000	487	922,865,000
東 芝	1,603,000	303	485,709,000
三菱電機	811,000	719	583,109,000
富士電機	251,000	195	48,945,000
東洋電機製造	20,000	229	4,580,000
安川電機	91,000	723	65,793,000
シンフォニア テクノロジー	56,000	154	8,624,000
明 電 舎	87,000	277	24,099,000
オリジン電気	15,000	434	6,510,000
デンヨー	8,800	970	8,536,000
日立工機	23,500	656	15,416,000
三桜工業	11,700	534	6,247,800
マキタ	49,300	3,685	181,670,500
東芝テック	51,000	422	21,522,000
マブチモーター	11,800	3,550	41,890,000
日本電産	43,700	4,680	204,516,000
ダイヘン	49,000	258	12,642,000
J V C ケンウッド	51,500	317	16,325,500
日新電機	18,000	459	8,262,000
大崎電気	12,000	447	5,364,000

オムロン	90,200	1,896	171,019,200
日東工業	12,100	1,154	13,963,400
I D E C	11,900	761	9,055,900
ジーエス・ユアサ コーポ	159,000	329	52,311,000
メルコホールディングス	5,400	1,591	8,591,400
日本電気	1,057,000	162	171,234,000
富士通	783,000	332	259,956,000
沖電気	312,000	92	28,704,000
電気興業	24,000	364	8,736,000
サンケン電気	45,000	329	14,805,000
アイホン	5,300	1,421	7,531,300
ルネサスエレクトロニクス	22,300	299	6,667,700
セイコーエプソン	55,600	591	32,859,600
ワコム	155	234,300	36,316,500
アルバック	17,000	696	11,832,000
アクセル	4,300	1,995	8,578,500
ナナオ	7,300	1,318	9,621,400
日本信号	21,700	579	12,564,300
京三製作所	20,000	280	5,600,000
能美防災	12,000	578	6,936,000
日本無線	23,000	226	5,198,000
パナソニック	926,200	486	450,133,200
シャープ	419,000	327	137,013,000
アンリツ	44,000	1,077	47,388,000
富士通ゼネラル	20,000	761	15,220,000
日立国際電気	21,000	597	12,537,000
ソニー	506,500	918	464,967,000
T D K	45,600	3,120	142,272,000
帝国通信工業	37,000	142	5,254,000
ミツミ電機	32,900	458	15,068,200
タムラ製作所	36,000	189	6,804,000
アルプス電気	61,000	519	31,659,000
パイオニア	101,600	228	23,164,800
日本電波工業	8,200	937	7,683,400
ローランド ディー・ジー・	5,200	977	5,080,400
フオスタ - 電機	9,000	1,393	12,537,000
クラリオン	51,000	153	7,803,000
S M K	28,000	218	6,104,000
東光	48,000	207	9,936,000
ホシデン	23,500	512	12,032,000
ヒロセ電機	14,100	10,040	141,564,000
日本航空電子	20,000	619	12,380,000
T O A	10,000	587	5,870,000
ユニデン	28,000	190	5,320,000
アルパイン	17,100	764	13,064,400
アイコム	5,200	1,800	9,360,000
船井電機	8,400	1,117	9,382,800
横河電機	82,500	915	75,487,500
新電元工業	30,000	248	7,440,000
アズビル	22,100	1,734	38,321,400
日本光電工業	16,300	2,545	41,483,500
チノ	24,000	200	4,800,000
堀場製作所	16,200	2,352	38,102,400
アドバンテスト	56,300	1,160	65,308,000
小野測器	13,000	400	5,200,000

エスベック	10,500	633	6,646,500
キーエンス	19,800	22,980	455,004,000
日置電機	5,000	1,389	6,945,000
シスメックス	28,600	3,745	107,107,000
メガチップス	7,000	1,764	12,348,000
O B A R A G R O U P	6,800	935	6,358,000
日本電産コパル電子	11,400	425	4,845,000
デンソー	200,100	2,845	569,284,500
コーセル	12,100	1,060	12,826,000
日立メディコ	7,000	985	6,895,000
オプテックス	6,200	1,040	6,448,000
千代田インテグレ	5,200	843	4,383,600
スタンレー電気	62,300	1,175	73,202,500
岩崎電気	40,000	171	6,840,000
ウシオ電機	48,200	959	46,223,800
日本セラミック	5,600	1,177	6,591,200
日本デジタル研究所	8,500	912	7,752,000
図 研	7,500	558	4,185,000
カ シ オ	78,700	751	59,103,700
ファナック	84,400	15,130	1,276,972,000
日本シイエムケイ	20,100	317	6,371,700
エンプラス	3,800	3,720	14,136,000
ロ ー ム	42,400	2,592	109,900,800
浜松ホトニクス	31,600	2,923	92,366,800
三井ハイテック	12,600	589	7,421,400
新光電気工業	28,900	585	16,906,500
京 セ ラ	67,400	7,720	520,328,000
太陽誘電	40,500	717	29,038,500
村田製作所	84,800	4,560	386,688,000
ユーシン	13,600	444	6,038,400
双葉電子工業	15,200	898	13,649,600
日東電工	69,900	4,000	279,600,000
北陸電気工業	44,000	98	4,312,000
東海理化電機	19,200	1,069	20,524,800
ニチコン	26,500	671	17,781,500
日本ケミコン	54,000	160	8,640,000
K O A	11,300	679	7,672,700
三井造船	324,000	121	39,204,000
日立造船	332,000	113	37,516,000
佐世保重工業	61,000	85	5,185,000
三菱重工業	1,358,000	390	529,620,000
川崎重工業	631,000	211	133,141,000
I H I	556,000	195	108,420,000
日本車輛	32,000	334	10,688,000
近畿車輛	17,000	280	4,760,000
日産自動車	1,023,200	800	818,560,000
いすゞ自動車	472,000	498	235,056,000
トヨタ自動車	1,041,200	3,720	3,873,264,000
日野自動車	103,000	696	71,688,000
三菱自動車工業	1,872,000	88	164,736,000
エフテック	4,000	1,169	4,676,000
武蔵精密工業	9,000	1,715	15,435,000
日産車体	27,000	990	26,730,000
新明和工業	36,000	537	19,332,000
極東開発工業	16,000	798	12,768,000

日信工業	16,600	1,287	21,364,200
トピー工業	65,000	187	12,155,000
ティラド	32,000	207	6,624,000
曙ブレーキ	40,700	382	15,547,400
タチエス	11,100	1,458	16,183,800
N O K	39,500	1,278	50,481,000
フタバ産業	26,600	341	9,070,600
カヤバ工業	63,000	318	20,034,000
シロキ工業	25,000	197	4,925,000
大同メタル工業	13,000	672	8,736,000
プレス工業	37,000	353	13,061,000
カルソニックカンセイ	56,000	372	20,832,000
太平洋工業	19,000	485	9,215,000
ケーヒン	17,500	1,228	21,490,000
河西工業	13,000	397	5,161,000
アイシン精機	73,600	2,547	187,459,200
マ ッ ダ	1,291,000	145	187,195,000
ダイハツ	84,000	1,612	135,408,000
今仙電機製作所	6,900	991	6,837,900
本田技研	683,900	2,892	1,977,838,800
スズキ	169,600	2,042	346,323,200
富士重工業	257,000	987	253,659,000
ヤマハ発動機	123,700	932	115,288,400
ショーワ	20,100	847	17,024,700
小糸製作所	41,000	1,184	48,544,000
T B K	12,000	413	4,956,000
エクセディ	10,900	1,823	19,870,700
ミツバ	16,000	622	9,952,000
豊田合成	23,200	1,686	39,115,200
愛三工業	9,500	670	6,365,000
ヨ ロ ズ	6,500	1,199	7,793,500
エフ・シー・シー	13,400	1,723	23,088,200
シマノ	32,200	5,710	183,862,000
タカタ	14,900	1,704	25,389,600
テイ・エス テック	17,700	1,516	26,833,200
小 野 建	8,000	723	5,784,000
カッパ・クリエイトHD	6,350	1,808	11,480,800
伯東	6,800	775	5,270,000
ライトオン	7,200	668	4,809,600
ナガイレーベン	10,500	1,147	12,043,500
三菱食品	8,300	2,167	17,986,100
良品計画	8,600	4,845	41,667,000
三城ホールディングス	11,800	450	5,310,000
松田産業	6,900	1,037	7,155,300
メディパルHD	79,900	967	77,263,300
アズワン	5,500	1,761	9,685,500
シモジマ	6,900	931	6,423,900
ドウシシャ	4,200	2,287	9,605,400
コナカ	10,000	587	5,870,000
コーナン商事	11,600	1,015	11,774,000
黒田電気	11,100	1,058	11,743,800
ネットワンシステムズ	30,100	814	24,501,400
ワタミ	9,800	1,689	16,552,200
ドン・キホーテ	21,200	3,170	67,204,000
メガネトップ	13,900	1,045	14,525,500

西松屋チェーン	17,600	687	12,091,200
ゼンショーホールディングス	30,800	980	30,184,000
ハピネット	5,700	673	3,836,100
幸楽苑	6,600	1,223	8,071,800
トーメンエレクトロニクス	5,000	1,047	5,235,000
サイゼリヤ	12,200	1,172	14,298,400
エクセル	6,300	710	4,473,000
マルカキカイ	4,000	950	3,800,000
ガリバーインターナショナル	2,850	3,085	8,792,250
ユナイテッドアローズ	9,700	2,032	19,710,400
ハイデイ日高	4,800	1,451	6,964,800
シークス	5,700	1,012	5,768,400
京都きもの友禅	6,500	984	6,396,000
コロワイド	28,500	730	20,805,000
壱番屋	3,500	2,607	9,124,500
マクニカ	4,800	1,653	7,934,400
スギホールディングス	12,700	2,895	36,766,500
島津製作所	97,000	536	51,992,000
J M S	20,000	301	6,020,000
スター精密	15,300	856	13,096,800
東京計器	40,000	146	5,840,000
東京精密	15,200	1,344	20,428,800
マニー	2,700	3,210	8,667,000
ニコン	150,900	2,440	368,196,000
トプコン	18,700	607	11,350,900
オリンパス	96,300	1,485	143,005,500
理研計器	9,300	522	4,854,600
大日本スクリーン	84,000	502	42,168,000
キャノン電子	7,700	1,864	14,352,800
タムロン	6,500	2,402	15,613,000
HOYA	196,200	1,600	313,920,000
キャノン	503,200	3,245	1,632,884,000
リコー	244,000	890	217,160,000
日本電産コパル	8,000	690	5,520,000
シチズンホールディングス	100,200	435	43,587,000
リズム時計	44,000	158	6,952,000
パラマウントベッドHD	7,300	2,606	19,023,800
永大産業	14,000	358	5,012,000
ダンロップスポーツ	5,000	1,052	5,260,000
バンダイナムコHLDGS	84,100	1,095	92,089,500
共立印刷	14,100	223	3,144,300
フランスベッドHLDGS	56,000	170	9,520,000
パイロットコーポレーション	78	163,400	12,745,200
エイベックス・グループHD	15,500	1,777	27,543,500
トッパン・フォームズ	15,200	767	11,658,400
フジシールインターナショナル	10,100	1,724	17,412,400
タカラトミー	27,700	455	12,603,500
アーク	33,400	169	5,644,600
プロネクサス	12,700	460	5,842,000
ウッドワン	19,000	250	4,750,000
大建工業	38,000	227	8,626,000
きもと	9,200	687	6,320,400
凸版印刷	230,000	514	118,220,000
大日本印刷	246,000	625	153,750,000
共同印刷	36,000	211	7,596,000

日本写真印刷	13,900	916	12,732,400
藤森工業	7,000	2,326	16,282,000
宝印刷	7,600	570	4,332,000
前澤化成工業	7,900	877	6,928,300
アシックス	75,500	1,184	89,392,000
ツ ツ ミ	4,600	2,200	10,120,000
ジェイ エス ピー	6,200	1,130	7,006,000
ニ チ ハ	10,700	1,014	10,849,800
ローランド	9,900	642	6,355,800
エフピコ	4,100	5,820	23,862,000
小松ウオール工業	4,600	1,163	5,349,800
ヤマハ	61,200	807	49,388,400
河合楽器	39,000	152	5,928,000
クリナップ	11,200	584	6,540,800
ピジョン	6,500	3,920	25,480,000
天馬	7,800	837	6,528,600
キングジム	7,500	647	4,852,500
リンテック	16,800	1,532	25,737,600
信越ポリマー	19,400	306	5,936,400
東 リ	30,000	177	5,310,000
イトーキ	18,700	422	7,891,400
任 天 堂	46,400	8,950	415,280,000
三菱鉛筆	7,300	1,440	10,512,000
松 風	5,700	818	4,662,600
タカラスタンダ - ド	39,000	625	24,375,000
コ ク ヨ	43,200	626	27,043,200
ナカバヤシ	30,000	175	5,250,000
ニ フ コ	18,700	1,796	33,585,200
グローブライド	69,000	96	6,624,000
岡村製作所	31,000	627	19,437,000
日本バルカー	38,000	209	7,942,000
伊 藤 忠	637,700	855	545,233,500
丸 紅	658,000	578	380,324,000
スクロール	15,100	259	3,910,900
高 島	19,000	258	4,902,000
F & A アクアホールディングス	7,700	872	6,714,400
三陽商会	51,000	241	12,291,000
長瀬産業	46,000	933	42,918,000
蝶 理	6,400	887	5,676,800
豊田通商	89,200	1,977	176,348,400
オンワ - ドホールディングス	55,000	638	35,090,000
三共生興	17,700	285	5,044,500
兼 松	188,000	104	19,552,000
美 津 濃	41,000	389	15,949,000
ファミリーマート	24,200	3,430	83,006,000
ルック	15,000	363	5,445,000
三井物産	690,300	1,193	823,527,900
日本紙パルプ	40,000	277	11,080,000
東京エレクトロン	68,300	3,825	261,247,500
日立ハイテクノロジーズ	24,600	1,780	43,788,000
カメイ	11,000	721	7,931,000
東都水産	32,000	127	4,064,000
スターゼン	30,000	240	7,200,000
セイコーHD	54,000	198	10,692,000
山 善	32,300	584	18,863,200

住友商事	472,100	1,050	495,705,000
日本ユニシス	23,800	551	13,113,800
内田洋行	23,000	227	5,221,000
三菱商事	622,400	1,592	990,860,800
第一実業	22,000	392	8,624,000
キャノンマーケティングJPN	26,600	1,219	32,425,400
西華産業	31,000	237	7,347,000
菱洋エレクトロ	10,100	774	7,817,400
ユアサ商事	92,000	147	13,524,000
神鋼商事	30,000	156	4,680,000
阪和興業	81,000	285	23,085,000
カナデン	10,000	529	5,290,000
菱電商事	13,000	484	6,292,000
ニプロ	43,600	597	26,029,200
岩谷産業	90,000	305	27,450,000
すてきナイスグループ	41,000	204	8,364,000
昭光通商	47,000	132	6,204,000
兼松エレクトロニクス	6,700	954	6,391,800
三愛石油	21,000	357	7,497,000
稲畑産業	22,100	556	12,287,600
ゴ-ルドウイン	21,000	523	10,983,000
ユニ・チャ-ム	46,500	4,400	204,600,000
デサント	23,000	541	12,443,000
ヤマトインタ-ナショナル	11,100	370	4,107,000
東邦ホールディングス	25,900	1,504	38,953,600
サンゲツ	14,200	2,069	29,379,800
ミツウロコグループ	14,800	476	7,044,800
シナネン	19,000	350	6,650,000
伊藤忠エネクス	20,400	436	8,894,400
サンリオ	20,300	2,711	55,033,300
リョ-サン	13,800	1,409	19,444,200
新光商事	11,000	701	7,711,000
トーホ-	23,000	316	7,268,000
三信電気	12,100	572	6,921,200
東陽テクニカ	12,800	949	12,147,200
モスフード サービス	10,500	1,580	16,590,000
加賀電子	10,400	740	7,696,000
三益半導体	8,500	718	6,103,000
木曽路	10,300	1,688	17,386,400
千趣会	15,500	535	8,292,500
ケーヨー	16,300	458	7,465,400
アデランス	11,000	1,126	12,386,000
上新電機	19,000	864	16,416,000
日本瓦斯	11,000	1,185	13,035,000
マルエツ	21,000	272	5,712,000
ロイヤルホールディングス	14,600	1,045	15,257,000
いなげや	9,200	986	9,071,200
島忠	17,800	1,780	31,684,000
チヨダ	9,700	2,134	20,699,800
ライフコーポレーション	5,800	1,254	7,273,200
カスミ	18,100	533	9,647,300
リンガーハット	8,900	1,061	9,442,900
MR MAX	12,400	323	4,005,200
AOKIホールディングス	7,500	1,925	14,437,500
オークワ	13,000	1,101	14,313,000

コメリ	12,000	2,190	26,280,000
青山商事	22,300	1,525	34,007,500
しまむら	9,200	8,540	78,568,000
C F S コーポレーション	11,500	364	4,186,000
高島屋	111,000	557	61,827,000
松屋	17,300	759	13,130,700
エイチ・ツー・オーリテイリング	52,000	740	38,480,000
ニッセンHD	17,500	322	5,635,000
パルコ	16,600	863	14,325,800
丸井グループ	107,200	614	65,820,800
クレディセゾン	70,300	1,897	133,359,100
原信ナルスHLDGS	5,600	1,506	8,433,600
ダイエー	54,100	174	9,413,400
イズミヤ	33,000	445	14,685,000
イオン	282,200	955	269,501,000
ユニー	77,600	615	47,724,000
イズミ	20,500	1,840	37,720,000
東武ストア	19,000	267	5,073,000
平和堂	16,600	1,200	19,920,000
フジ	9,200	1,789	16,458,800
ヤオコー	4,400	3,245	14,278,000
ゼビオ	10,700	1,702	18,211,400
ケーズホールディングス	20,100	2,146	43,134,600
Paltac	9,600	957	9,187,200
新生銀行	705,000	144	101,520,000
あおぞら銀行	296,000	252	74,592,000
三菱UFJフィナンシャルG	6,060,200	410	2,484,682,000
りそなホールディングス	824,200	361	297,536,200
三井住友トラストHD	1,673,000	284	475,132,000
三井住友フィナンシャルG	604,800	2,888	1,746,662,400
第四銀行	102,000	282	28,764,000
北越銀行	86,000	169	14,534,000
西日本シティ銀行	275,000	196	53,900,000
千葉銀行	307,000	493	151,351,000
横浜銀行	506,000	397	200,882,000
常陽銀行	299,000	404	120,796,000
群馬銀行	177,000	410	72,570,000
武蔵野銀行	12,500	2,713	33,912,500
千葉興業銀行	19,200	457	8,774,400
筑波銀行	37,300	293	10,928,900
東京都民銀行	16,400	748	12,267,200
七十七銀行	126,000	328	41,328,000
青森銀行	63,000	239	15,057,000
秋田銀行	58,000	230	13,340,000
山形銀行	51,000	383	19,533,000
岩手銀行	5,700	3,560	20,292,000
東邦銀行	69,000	273	18,837,000
東北銀行	54,000	133	7,182,000
みちのく銀行	49,000	169	8,281,000
ふくおかフィナンシャルG	324,000	326	105,624,000
静岡銀行	234,000	819	191,646,000
十六銀行	101,000	286	28,886,000
スルガ銀行	78,000	1,024	79,872,000
八十二銀行	143,000	413	59,059,000
山梨中央銀行	52,000	347	18,044,000

大垣共立銀行	103,000	289	29,767,000
福井銀行	70,000	161	11,270,000
北國銀行	93,000	297	27,621,000
清水銀行	3,200	2,402	7,686,400
滋賀銀行	73,000	538	39,274,000
南都銀行	78,000	382	29,796,000
百五銀行	71,000	379	26,909,000
京都銀行	142,000	709	100,678,000
三重銀行	35,000	180	6,300,000
ほくほくフィナンシャルG	549,000	120	65,880,000
広島銀行	231,000	353	81,543,000
山陰合同銀行	47,000	586	27,542,000
中国銀行	61,000	1,174	71,614,000
鳥取銀行	34,000	163	5,542,000
伊予銀行	82,000	658	53,956,000
百十四銀行	89,000	314	27,946,000
四国銀行	60,000	221	13,260,000
阿波銀行	67,000	488	32,696,000
鹿児島銀行	53,000	533	28,249,000
大分銀行	51,000	284	14,484,000
宮崎銀行	57,000	204	11,628,000
肥後銀行	63,000	465	29,295,000
佐賀銀行	54,000	190	10,260,000
十八銀行	55,000	216	11,880,000
沖縄銀行	6,100	3,325	20,282,500
琉球銀行	16,400	998	16,367,200
八千代銀行	4,600	1,666	7,663,600
セブン銀行	277,500	208	57,720,000
みずほフィナンシャルG	10,293,100	141	1,451,327,100
紀陽ホールディングス	311,000	115	35,765,000
山口フィナンシャルG	78,000	728	56,784,000
芙蓉総合リース	8,100	2,588	20,962,800
興銀リース	12,500	2,234	27,925,000
東京センチュリーリース	19,200	1,666	31,987,200
SBIホールディングス	101,800	680	69,224,000
日本証券金融	35,000	469	16,415,000
大阪証券金融	22,900	211	4,831,900
ポケットカード	12,200	376	4,587,200
長野銀行	38,000	149	5,662,000
名古屋銀行	76,000	299	22,724,000
北洋銀行	119,100	225	26,797,500
愛知銀行	3,100	4,555	14,120,500
第三銀行	55,000	156	8,580,000
中京銀行	39,000	181	7,059,000
東日本銀行	43,000	183	7,869,000
大光銀行	33,000	203	6,699,000
愛媛銀行	49,000	217	10,633,000
トマト銀行	38,000	155	5,890,000
みなと銀行	74,000	150	11,100,000
京葉銀行	65,000	370	24,050,000
関西アーバン銀行	114,000	108	12,312,000
栃木銀行	41,000	289	11,849,000
北日本銀行	3,000	2,373	7,119,000
東和銀行	83,000	89	7,387,000
福島銀行	130,000	64	8,320,000

リコーリース	6,600	1,966	12,975,600
イオン クレジットサービス	29,700	1,611	47,846,700
ア コ ム	16,450	2,256	37,111,200
ジャックス	47,000	377	17,719,000
オ リ コ	158,500	187	29,639,500
日立キャピタル	16,500	1,755	28,957,500
オリックス	41,700	9,190	383,223,000
三菱UFJリース	20,510	3,625	74,348,750
ジャフコ	11,900	2,438	29,012,200
トモニホールディングス	62,500	357	22,312,500
大和証券G本社	795,000	428	340,260,000
野村ホールディングス	1,637,300	401	656,557,300
岡三証券グループ	68,000	381	25,908,000
丸三証券	31,000	364	11,284,000
東洋証券	36,000	203	7,308,000
東海東京HD	91,000	363	33,033,000
水戸証券	30,000	209	6,270,000
いちよし証券	20,800	543	11,294,400
松井証券	49,400	671	33,147,400
NK S Jホールディングス	176,800	1,758	310,814,400
マネックスG	924	18,390	16,992,360
カブドットコム証券	34,100	314	10,707,400
極東証券	12,100	801	9,692,100
フィデアホール	49,700	177	8,796,900
池田泉州HD	64,600	501	32,364,600
M S & A D	239,000	1,541	368,299,000
SONY F H	77,200	1,463	112,943,600
第一生命	4,286	103,800	444,886,800
東京海上HD	309,200	2,227	688,588,400
N E Cキャピタルソリューション	4,200	1,191	5,002,200
T & Dホールディングス	275,300	947	260,709,100
三井不動産	377,000	1,925	725,725,000
三菱地所	560,000	1,765	988,400,000
平和不動産	17,300	1,059	18,320,700
東京建物	155,000	385	59,675,000
ダイビル	21,600	744	16,070,400
東急不動産	175,000	566	99,050,000
京阪神ビルディング	15,700	404	6,342,800
住友不動産	192,000	2,525	484,800,000
東宝不動産	9,800	508	4,978,400
大京	127,000	216	27,432,000
テーオーシー	28,500	454	12,939,000
東京楽天地	17,000	308	5,236,000
レオパレス21	67,600	316	21,361,600
フジ住宅	11,700	449	5,253,300
空港施設	14,000	391	5,474,000
住友不動産販売	2,930	3,765	11,031,450
ゴールドクレスト	6,800	1,271	8,642,800
東栄住宅	5,700	964	5,494,800
リロ・ホールディング	2,900	3,200	9,280,000
東急リバブル	9,000	1,368	12,312,000
飯田産業	7,900	820	6,478,000
アーネストワン	13,200	1,188	15,681,600
タカラレーベン	9,100	847	7,707,700
サンヨーハウジ 名古屋	47	88,400	4,154,800

イオンモール	36,300	2,258	81,965,400
フージャースコーポレーション	115	61,700	7,095,500
タクトホーム	48	86,100	4,132,800
トーセイ	129	45,700	5,895,300
エヌ・ティ・ティ都市開発	507	76,500	38,785,500
東武鉄道	465,000	439	204,135,000
相鉄ホールディングス	132,000	274	36,168,000
東京急行	478,000	434	207,452,000
京浜急行	208,000	735	152,880,000
小田急電鉄	261,000	840	219,240,000
京王電鉄	227,000	614	139,378,000
京成電鉄	125,000	705	88,125,000
富士急行	25,000	500	12,500,000
新京成電鉄	16,000	357	5,712,000
東日本旅客鉄道	150,500	5,430	817,215,000
西日本旅客鉄道	70,700	3,335	235,784,500
東海旅客鉄道	67,600	6,730	454,948,000
西日本鉄道	102,000	336	34,272,000
ハマキョウレックス	2,800	2,601	7,282,800
近畿日本鉄道	729,000	331	241,299,000
阪急阪神HLDGS	514,000	443	227,702,000
南海電鉄	169,000	385	65,065,000
京阪電鉄	178,000	389	69,242,000
名古屋鉄道	282,000	224	63,168,000
日本通運	323,000	309	99,807,000
ヤマトホールディングス	152,600	1,248	190,444,800
山九	97,000	319	30,943,000
日新	36,000	204	7,344,000
丸全昭和運輸	34,000	241	8,194,000
センコー	36,000	357	12,852,000
トナミホールディングス	22,000	183	4,026,000
日本梱包運輸	25,700	953	24,492,100
福山通運	50,000	425	21,250,000
セイノーホールディングス	62,000	517	32,054,000
神奈川中央交通	15,000	471	7,065,000
日立物流	14,600	1,165	17,009,000
日本郵船	649,000	186	120,714,000
商船三井	399,000	226	90,174,000
川崎汽船	364,000	122	44,408,000
NSユニテッド海運	51,000	102	5,202,000
飯野海運	38,500	267	10,279,500
日本航空	68,200	3,750	255,750,000
全日本空輸	1,591,000	177	281,607,000
三菱倉庫	59,000	1,154	68,086,000
三井倉庫	41,000	296	12,136,000
住友倉庫	58,000	385	22,330,000
渋沢倉庫	26,000	249	6,474,000
ヤマタネ	58,000	113	6,554,000
東陽倉庫	22,000	189	4,158,000
日本トランスシティ	27,000	300	8,100,000
安田倉庫	8,100	561	4,544,100
東洋埠頭	37,000	133	4,921,000
上組	88,000	658	57,904,000
郵船ロジスティクス	7,300	781	5,701,300
近鉄エクスプレス	7,600	2,709	20,588,400

東京放送HD	44,100	805	35,500,500
日本テレビHD	72,200	1,099	79,347,800
テレビ朝日	20,400	1,109	22,623,600
スカパーJSATHD	710	35,150	24,956,500
テレビ東京HD	7,100	904	6,418,400
アイ・ティー・シーネットワーク	12,400	641	7,948,400
イー・アクセス	887	62,500	55,437,500
NECモバイルリング	3,200	3,610	11,552,000
日本電信電話	336,800	3,595	1,210,796,000
KDDI	113,100	5,890	666,159,000
光通信	8,700	3,640	31,668,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,582	121,200	797,738,400
GMOインターネット	27,600	494	13,634,400
学研ホールディングス	28,000	221	6,188,000
ゼンリン	11,500	1,068	12,282,000
角川グループHD	7,300	2,311	16,870,300
東京電力	686,600	237	162,724,200
中部電力	247,900	1,147	284,341,300
関西電力	330,900	879	290,861,100
中国電力	111,700	1,316	146,997,200
北陸電力	79,500	975	77,512,500
東北電力	202,600	798	161,674,800
四国電力	73,100	1,250	91,375,000
九州電力	178,900	896	160,294,400
北海道電力	76,000	935	71,060,000
沖縄電力	5,100	2,602	13,270,200
電源開発	50,300	2,097	105,479,100
東京瓦斯	970,000	406	393,820,000
大阪瓦斯	782,000	319	249,458,000
東邦瓦斯	205,000	473	96,965,000
北海道瓦斯	21,000	227	4,767,000
西部瓦斯	95,000	217	20,615,000
静岡瓦斯	22,500	603	13,567,500
松竹	55,000	863	47,465,000
東宝	57,400	1,392	79,900,800
エイチ・アイ・エス	7,200	2,781	20,023,200
東映	36,000	458	16,488,000
NTTデータ	494	254,200	125,574,800
共立メンテナンス	5,200	1,782	9,266,400
イチネンホールディングス	12,200	483	5,892,600
スペース	6,200	739	4,581,800
インファーマシーズ	4,600	4,500	20,700,000
東京テアトル	59,000	110	6,490,000
よみうりランド	27,000	281	7,587,000
東京都競馬	79,000	130	10,270,000
常磐興産	40,000	130	5,200,000
カナモト	11,000	1,217	13,387,000
東京ドーム	72,000	288	20,736,000
DTS	9,000	1,085	9,765,000
スクウェア・エニックス・HD	29,100	1,092	31,777,200
シーイーシー	8,500	490	4,165,000
カプコン	16,000	1,484	23,744,000
日本空港ビルデング	27,400	888	24,331,200
トランス・コスモス	11,900	898	10,686,200
乃村工藝社	21,000	338	7,098,000

ジャステック	7,000	504	3,528,000
S C S K	18,700	1,368	25,581,600
藤田観光	30,000	293	8,790,000
日本管財	3,200	1,522	4,870,400
トーカイ	4,700	2,150	10,105,000
セコム	87,400	4,185	365,769,000
アイネス	13,000	523	6,799,000
メイテック	13,800	1,865	25,737,000
T K C	7,400	1,444	10,685,600
アサツー ディ・ケイ	14,200	1,963	27,874,600
富士ソフト	11,800	1,626	19,186,800
応用地質	10,400	987	10,264,800
船井総合研究所	11,400	548	6,247,200
N S D	16,900	742	12,539,800
コナミ	36,500	2,069	75,518,500
ベネッセホールディングス	25,500	3,505	89,377,500
イオンディライト	8,400	1,623	13,633,200
ニチイ学館	17,800	660	11,748,000
ダイセキ	13,600	1,168	15,884,800
元気寿司	4,700	1,052	4,944,400
トラスコ中山	10,000	1,514	15,140,000
ヤマダ電機	36,450	3,115	113,541,750
オートバックスセブン	9,400	3,470	32,618,000
アークランドサカモト	6,000	1,285	7,710,000
ニトリホールディングス	15,650	6,280	98,282,000
吉野家ホールディングス	213	105,100	22,386,300
加藤産業	11,900	1,493	17,766,700
イエローハット	8,600	1,298	11,162,800
富士エレクトロニクス	4,800	1,105	5,304,000
松屋フーズ	4,500	1,500	6,750,000
J B C Cホールディングス	9,700	619	6,004,300
サガミチェーン	12,000	660	7,920,000
日 伝	3,700	2,133	7,892,100
因幡電機産業	9,800	2,400	23,520,000
住金物産	46,000	218	10,028,000
プレナス	9,200	1,362	12,530,400
ミニストップ	6,000	1,424	8,544,000
アークス	13,100	1,739	22,780,900
バ ロ ー	17,300	1,328	22,974,400
ミスミグループ本社	29,900	2,235	66,826,500
ベ ル ク	5,700	1,229	7,005,300
大 庄	6,500	1,058	6,877,000
タキヒヨー	14,000	437	6,118,000
ファーストリテイリング	16,000	20,830	333,280,000
ソフトバンク	365,200	3,130	1,143,076,000
スズケン	30,600	2,454	75,092,400
サンドラッグ	15,000	2,899	43,485,000
ペルーナ	11,700	608	7,113,600
合計			91,258,540,710

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	243,926,774	283,405,868
コール・ローン	123,472,335	70,318,692
株式	41,136,751,524	51,613,745,366
投資証券	763,792,723	1,121,855,937
派生商品評価勘定	-	8,171,156
未収入金	2,230,434	63,293,777
未収配当金	88,923,834	122,149,355
差入委託証拠金	293,608,652	246,353,113
流動資産合計	42,652,706,276	53,529,293,264
資産合計	42,652,706,276	53,529,293,264
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	22,146,049	-
未払金	34,987,580	-
未払解約金	5,200,000	39,111,000
流動負債合計	62,333,629	39,111,000
負債合計	62,333,629	39,111,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 53,616,195,771	51,632,637,762
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 11,025,823,124	1,857,544,502
元本等合計	42,590,372,647	53,490,182,264
純資産合計	42,590,372,647	53,490,182,264
負債純資産合計	42,652,706,276	53,529,293,264

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23年12月20日 至 平成24年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(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、原則として期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。

(追加情報)

自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
1. 1 期首	平成22年12月21日	平成23年12月20日
期首元本額	51,935,045,476円	53,616,195,771円
期中追加設定元本額	7,979,337,291円	5,472,237,765円
期中一部解約元本額	6,298,186,996円	7,455,795,774円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスV A	1,939,789,425円	1,898,609,298円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	104,533,081円	92,329,188円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,411,957,538円	1,266,749,181円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	195,834,213円	178,594,120円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	4,661,298,341円	4,073,250,741円

DCダイワ外国株式インデックス	15,968,028,450円	17,979,148,036円
ダイワ・ライフ・バランス30	621,697,754円	603,340,383円
ダイワ・ライフ・バランス50	344,430,292円	580,817,763円
ダイワ・ライフ・バランス70	217,399,756円	356,073,866円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,575,006,024円	1,585,334,486円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	6,577,928円	6,470,064円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	5,332,261円	7,501,912円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	510,144円	977,752円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	123,847,179円	107,015,823円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	1,859,829,310円	1,598,468,837円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	41,866,940円	33,962,760円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	415,146,585円	355,460,638円
ダイワ世界バランスファンド40VA	6,393,548,567円	5,197,453,690円
ダイワ世界バランスファンド60VA	1,560,652,613円	1,281,387,480円
ダイワ・バランスファンド35VA	12,410,007,067円	10,680,907,493円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	632,371,434円	538,968,077円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,966,271,831円	3,058,888,278円
ダイワライフスタイル25	26,318,532円	25,108,094円
ダイワライフスタイル50	75,960,384円	71,665,783円
ダイワライフスタイル75	57,980,122円	54,154,019円
計	53,616,195,771円	51,632,637,762円
2. 期末日における受益権の総数	53,616,195,771口	51,632,637,762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11,025,823,124円でありませず。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成24年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	479,246,792	557,323,594
投資証券	19,535,725	12,091,864
合計	498,782,517	569,415,458

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成23年12月1日から平成23年12月19日まで、及び平成24年12月1日から平成24年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	平成23年12月19日 現在			平成24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）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）

株価指数 先物取引								
買 建	658,689,570	-	636,558,021	22,131,549	650,088,950	-	658,253,694	8,164,744
合計	658,689,570	-	636,558,021	22,131,549	650,088,950	-	658,253,694	8,164,744

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	平成23年12月19日 現在				平成24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)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	72,061,612	-	72,055,200	6,412
アメリカ・ド ル	-	-	-	-	50,321,340	-	50,316,000	5,340
イギリス・ポ ンド	-	-	-	-	21,740,272	-	21,739,200	1,072
買 建	33,515,500	-	33,501,000	14,500	-	-	-	-
アメリカ・ド ル	23,364,600	-	23,361,000	3,600	-	-	-	-
ユーロ	10,150,900	-	10,140,000	10,900	-	-	-	-
合計	33,515,500	-	33,501,000	14,500	72,061,612	-	72,055,200	6,412

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成23年12月19日現在	平成24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)	0.7944円 (7,944円)	1.0360円 (10,360円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	AVON PRODUCTS	11,900	13.980	166,362.000	
	ABBOTT LABS	41,500	65.200	2,705,800.000	
	ALCOA	30,200	8.750	264,250.000	
	VERISK ANALYTICS INC-CL A	4,000	50.290	201,160.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	11,200	46.570	521,584.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	4,200	63.760	267,792.000	
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	6,629	35.000	232,015.000	
	AFLAC INC	12,800	54.090	692,352.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,300	46.880	154,704.000	
	MONSTER BEVERAGE CORP	4,300	52.760	226,868.000	
	ADOBE SYSTEMS	13,200	37.420	493,944.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,700	205.260	348,942.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,800	76.360	213,808.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,400	12.300	127,920.000	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,000	68.100	136,200.000	
	GARMIN LTD	3,200	41.420	132,544.000	
	AETNA INC	8,700	46.180	401,766.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	5,600	83.360	466,816.000	
	ALTERA CORPORATION	8,800	33.380	293,744.000	
	BEAM INC	4,000	61.860	247,440.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL	19,600	62.390	1,222,844.000	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,951	22.160	109,714.160	
	WR BERKLEY CORP	3,600	39.500	142,200.000	
	AUTOZONE INC	900	363.400	327,060.000	
	DOLLAR TREE INC	6,000	39.470	236,820.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL	3,200	51.690	165,408.000	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES	2,900	28.500	82,650.000	
	CELANESE CORP-SERIES A	4,200	43.000	180,600.000	
	D.R.HORTON INC	7,166	19.690	141,098.540	
	CONTINENTAL RESOURCES	1,200	73.140	87,768.000	
	DENTSPLY INTERNATIONAL IN	3,800	40.360	153,368.000	
	AUTODESK INC	6,100	34.880	212,768.000	
	MOODY'S CORP	5,500	49.670	273,185.000	
	DEVON ENERGY CORPORATION	10,200	52.130	531,726.000	
	ALBEMARLE CORP	2,200	60.190	132,418.000	
	CONSOL ENERGY INC	6,100	33.670	205,387.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	3,200	45.000	144,000.000	
	CITIGROUP INC	77,123	39.150	3,019,365.450	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	13,000	57.970	753,610.000	
AMERICAN ELEC POWER	13,000	43.530	565,890.000		
ALLEGHANY CORP	300	332.450	99,735.000		
DUN&BRADSTREET CORP	1,400	82.710	115,794.000		
HESS CORP	8,500	52.250	444,125.000		
COVIDIEN PLC	12,725	57.790	735,377.750		
DAVITA INC	2,500	109.710	274,275.000		

DANAHER CORP	15,500	55.400	858,700.000
AVNET INC	4,600	30.340	139,564.000
INTERCONTINENTALEXCHANGE	2,100	127.840	268,464.000
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	17,700	27.390	484,803.000
PEABODY ENERGY CORP	7,400	26.630	197,062.000
BUNGE LIMITED	3,800	72.270	274,626.000
TE CONNECTIVITY LTD	11,925	36.780	438,601.500
APPLE INC	24,900	519.170	12,927,333.000
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	14,100	40.180	566,538.000
BOEING CO	18,900	74.650	1,410,885.000
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,415	39.690	175,231.350
MEADWESTVACO CORP	4,800	30.810	147,888.000
SPECTRA ENERGY CORP	17,696	27.600	488,409.600
BECTON DICKINSON & CO	5,400	78.730	425,142.000
SAIC INC	8,600	11.690	100,534.000
NISOURCE INC	7,600	24.420	185,592.000
JOY GLOBAL INC	3,100	61.020	189,162.000
BMC SOFTWARE INC	4,000	41.070	164,280.000
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	4,400	62.190	273,636.000
BARD(C.R.) INC	2,300	96.790	222,617.000
BANK OF NEW YORK MELLON	31,371	25.400	796,823.400
VERIZON COMMUNICATIONS	75,500	44.120	3,331,060.000
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	24,500	89.980	2,204,510.000
ANSYS INC	2,300	67.990	156,377.000
H&R BLOCK INC	8,800	19.060	167,728.000
BB&T CORPORATION	19,200	29.150	559,680.000
HOSPIRA INC	4,520	31.890	144,142.800
BROADCOM CORP-CL A	13,350	32.510	434,008.500
BAKER HUGHES INC	11,623	40.640	472,358.720
BRISTOL MYERS SQUIBB	45,300	32.800	1,485,840.000
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,900	80.090	152,171.000
FIDELITY NATIONAL FINL-A	4,938	22.910	113,129.580
JPMORGAN CHASE & CO	100,920	43.480	4,388,001.600
LEGG MASON INC	3,850	25.770	99,214.500
T ROWE PRICE GROUP INC	6,900	65.840	454,296.000
CIGNA CORP	8,000	53.760	430,080.000
LKQ CORP	7,300	20.750	151,475.000
COMPUTER SCIENCES CORP	4,200	40.580	170,436.000
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,600	80.080	128,128.000
FRONTIER COMMUNICATIONS	26,442	4.620	122,162.040
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,300	63.590	209,847.000
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,860	62.490	366,191.400
DOLLAR GENERAL CORP	7,200	44.130	317,736.000
CATERPILLAR INC DEL	17,400	89.640	1,559,736.000
VIRGIN MEDIA INC	7,000	36.200	253,400.000
CMS ENERGY CORP	7,100	24.530	174,163.000
HERBALIFE LTD	3,400	42.840	145,656.000
MOSAIC CO/THE	7,900	56.030	442,637.000
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,600	66.000	369,600.000
CORNING INC	40,200	12.650	508,530.000
CISCO SYSTEMS	141,100	20.110	2,837,521.000
DU PONT	24,800	44.630	1,106,824.000
MORGAN STANLEY	39,700	18.530	735,641.000
DOW CHEMICAL	31,500	31.820	1,002,330.000
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,200	32.000	198,400.000
DELL INC	40,800	10.260	418,608.000
ENSCO PLC-CL A	6,200	57.950	359,290.000

DICK'S SPORTING GOODS INC	2,300	45.580	104,834.000
DTE ENERGY COMPANY	4,600	61.210	281,566.000
AGCO CORP	2,800	49.150	137,620.000
DOMINION RESOURCES INC/VA	15,300	51.960	794,988.000
DENBURY RESOURCES INC	11,300	16.060	181,478.000
DEERE & CO	9,800	86.370	846,426.000
AIRGAS INC	1,700	89.780	152,626.000
QUANTA SERVICES INC	6,400	27.260	174,464.000
TIME WARNER INC	25,633	47.940	1,228,846.020
VMWARE INC-CLASS A	2,400	94.240	226,176.000
URBAN OUTFITTERS INC	3,700	39.560	146,372.000
NASDAQ STOCK MARKET INC	3,900	24.690	96,291.000
KINDER MORGAN MANAGEMENT	2,720	74.550	202,776.000
CONSOLIDATED EDISON INC	7,700	56.980	438,746.000
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	3,500	52.120	182,420.000
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,300	57.500	132,250.000
NYSE EURONEXT	6,900	23.660	163,254.000
COLGATE PALMOLIVE CO	12,700	106.210	1,348,867.000
AMETEK INC	6,525	37.440	244,296.000
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,000	53.350	213,400.000
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,300	54.750	454,425.000
COSTCO WHOLESALE CORP	11,400	98.780	1,126,092.000
SCANA CORP	3,500	46.570	162,995.000
GREEN MOUNTAIN COFFEE	3,800	38.930	147,934.000
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,200	130.120	156,144.000
CHIPOTLE MEXICAN GRILL IN	900	286.680	258,012.000
LEUCADIA NATIONAL CORP	5,800	23.680	137,344.000
CUMMINS INC	4,900	105.750	518,175.000
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,500	11.130	150,255.000
LORILLARD INC	3,400	118.780	403,852.000
TRANSDIGM GROUP INC	1,200	128.220	153,864.000
SBA COMMUNICATIONS CORP-C	3,200	70.120	224,384.000
KINDER MORGAN INC	17,400	34.460	599,604.000
HCA HOLDINGS INC	5,100	31.210	159,171.000
CABOT OIL & GAS CORP	5,600	47.750	267,400.000
METROPCS COMMUNICATIONS	7,300	9.990	72,927.000
DOLBY LABORATORIES-A	1,500	35.340	53,010.000
COCA COLA CO	108,400	37.500	4,065,000.000
COCA-COLA ENTERPRISES	7,700	31.090	239,393.000
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,700	38.600	220,020.000
EATON VANCE CORP	3,700	31.410	116,217.000
FMC TECHNOLOGIES INC	6,700	40.720	272,824.000
FRANKLIN RESOURCES INC	3,900	128.820	502,398.000
CSX CORP	27,700	19.910	551,507.000
FLUOR CORP	4,700	57.840	271,848.000
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,700	87.170	235,359.000
EXPEDIA INC	2,675	60.600	162,105.000
AUTOLIV INC	2,600	63.000	163,800.000
AMAZON.COM INC	9,600	253.990	2,438,304.000
FLOWSERVE CORP	1,500	141.910	212,865.000
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,200	91.870	293,984.000
EXXON MOBIL CORP	122,955	88.870	10,927,010.850
RALCORP HOLDINGS INC	1,600	89.190	142,704.000
EQUINIX INC	1,200	201.470	241,764.000
FLIR SYSTEMS INC	4,500	20.430	91,935.000
AES CORP	17,900	10.900	195,110.000
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	2,800	75.880	212,464.000

EVEREST RE GROUP LTD	1,300	107.090	139,217.000
EOG RESOURCES INC	7,200	120.970	870,984.000
EQUITABLE RESOURCES INC	4,200	57.280	240,576.000
AKAMA I TECHNOLOGIES	5,100	39.460	201,246.000
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,100	43.780	310,838.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,790	40.740	398,844.600
FORD MOTOR CO	94,423	11.390	1,075,477.970
MACY'S INC	10,798	38.710	417,990.580
DISCOVERY COMMUNICATION-A	4,140	62.210	257,549.400
FOREST LABORATORIES INC	7,500	35.850	268,875.000
LIBERTY GLOBAL INC	3,535	61.630	217,862.050
DISCOVERY COMMUNICATION-C	2,540	57.470	145,973.800
WARNER CHILCOTT PLC-CL A	5,200	11.600	60,320.000
FOSSIL INC	1,500	91.090	136,635.000
NEXTERA ENERGY INC	10,700	70.520	754,564.000
FREEPORT-MCMORAN COPPER	25,408	33.640	854,725.120
US BANCORP	50,100	32.090	1,607,709.000
FAMILY DOLLAR STORES	2,900	66.100	191,690.000
F5 NETWORKS INC	2,100	92.580	194,418.000
FASTENAL CO	7,400	43.700	323,380.000
FISERV INC	3,800	80.500	305,900.000
GENERAL ELECTRIC CO	278,400	21.930	6,105,312.000
GOODYEAR TIRE&RUBBER	7,100	13.080	92,868.000
GENERAL MOTORS CO	20,500	24.850	509,425.000
LINKEDIN CORP-A	2,200	114.330	251,526.000
GENERAL DYNAMICS CORP	7,900	68.000	537,200.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,000	123.490	1,481,880.000
LIBERTY MEDIA CO-LIBER-A	2,700	114.140	308,178.000
GAMESTOP CORP-CLASS A	4,900	27.520	134,848.000
GOOGLE INC-CL A	6,900	720.990	4,974,831.000
GENERAL MILLS INC	17,300	41.730	721,929.000
FIRSTENERGY CORP	10,968	41.230	452,210.640
GENUINE PARTS CO	4,200	63.320	265,944.000
FIFTH THIRD BANCORP	25,800	14.660	378,228.000
HARRIS CORP	3,400	48.640	165,376.000
HALLIBURTON CO	24,500	33.540	821,730.000
HOME DEPOT INC	39,900	63.310	2,526,069.000
ASSURANT INC	3,300	35.080	115,764.000
HERSHEY CO/THE	4,300	74.640	320,952.000
HARLEY-DAVIDSON INC	6,200	49.220	305,164.000
HUMANA INC	4,600	66.800	307,280.000
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,600	55.690	311,864.000
HELMERICH & PAYNE	3,000	54.300	162,900.000
WINDSTREAM CORP	17,100	8.820	150,822.000
HENRY SCHEIN INC	2,600	82.040	213,304.000
HEWLETT-PACKARD CO	53,100	14.210	754,551.000
DIRECTV	16,582	50.580	838,717.560
HOLLYFRONTIER CORP	5,000	46.260	231,300.000
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,600	44.290	159,444.000
HEINZ H J CO	8,400	59.860	502,824.000
INT'L BUSINESS MACHINES	28,700	193.620	5,556,894.000
INTERNATIONAL PAPER	11,600	38.160	442,656.000
INGERSOLL-RAND CO-CL A	8,129	47.350	384,908.150
LEGGETT & PLATT INC	4,200	26.700	112,140.000
LIBERTY GLOBAL INC-C	2,835	57.220	162,218.700
JUNIPER NETWORKS INC	14,600	19.780	288,788.000
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3,100	87.520	271,312.000

JOHNSON & JOHNSON	72,700	70.940	5,157,338.000
HOLOGIC INC	7,100	19.790	140,509.000
KIMBERLY-CLARK CORP	10,500	85.520	897,960.000
KROGER CO	13,900	26.570	369,323.000
KLA-TENCOR CORPORATION	4,600	47.350	217,810.000
LOCKHEED MARTIN CORP	7,300	90.420	660,066.000
LIMITED BRANDS	6,500	51.440	334,360.000
LOWE'S COS INC	31,700	35.850	1,136,445.000
ELI LILLY & CO	28,000	48.340	1,353,520.000
LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN	4,300	21.710	93,353.000
LAM RESEARCH CORP	4,700	36.280	170,516.000
RANGE RESOURCES CORP	4,400	63.520	279,488.000
LSI CORP	17,000	6.750	114,750.000
LOEWS CORP	8,500	41.030	348,755.000
LINCOLN NATIONAL CORP	7,149	26.000	185,874.000
MCDONALD'S CORP	27,000	89.910	2,427,570.000
3M CO	17,400	93.030	1,618,722.000
FACEBOOK INC-A	18,200	26.790	487,578.000
MANPOWER INC	2,300	42.080	96,784.000
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	6,700	54.590	365,753.000
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,300	95.320	123,916.000
CONCHO RESOURCES INC	2,700	82.690	223,263.000
PHILLIPS 66	15,800	53.520	845,616.000
MURPHY OIL CORP	4,900	60.030	294,147.000
MGM RESORTS INTERNATIONAL	10,800	11.420	123,336.000
MATTEL INC	9,000	37.200	334,800.000
KBR INC	4,200	30.230	126,966.000
MCCORMICK & CO-NON VTG SH	3,100	65.980	204,538.000
MYLAN INC	10,400	28.200	293,280.000
METLIFE INC	22,300	32.030	714,269.000
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	14,500	8.330	120,785.000
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,728	54.280	365,195.840
MONSANTO CO	14,306	90.670	1,297,125.020
ROCKWELL INTL CORP	4,000	82.590	330,360.000
MERCK & CO INC	80,621	43.630	3,517,494.230
MASCO CORP	9,700	16.390	158,983.000
M & T BANK CORP	3,100	99.890	309,659.000
MARSH & MCLENNAN COS	15,000	34.490	517,350.000
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	6,582	36.840	242,480.880
NETAPP INC	10,200	33.170	338,334.000
NIKE INC -CL B	9,800	97.990	960,302.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,700	61.620	536,094.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,300	31.850	168,805.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,500	67.130	436,345.000
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	7,400	34.370	254,338.000
NEWMONT MINIG CORP	13,200	44.670	589,644.000
KRAFT FOODS GROUP INC	15,103	46.330	699,721.990
ADT CORP/THE	6,262	46.330	290,118.460
MCKESSON CORP	6,200	98.630	611,506.000
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,900	29.580	233,682.000
XYLEM INC	5,700	26.550	151,335.000
PHILIP MORRIS INTERNATION	44,400	87.390	3,880,116.000
NUCOR CORP	8,800	42.760	376,288.000
NABORS INDUSTRIES LTD	8,300	13.730	113,959.000
WESTERN UNION CO	16,746	13.230	221,549.580
NEWELL RUBBERMAID INC	8,200	21.930	179,826.000
OCCIDENTAL PETROLEUM	21,700	76.520	1,660,484.000

OMNICARE INC	3,200	35.870	114,784.000
PAYCHEX INC	9,300	33.910	315,363.000
J.C.PENNY CO INC(HLDG CO)	4,400	20.640	90,816.000
PATTERSON COS INC	2,900	33.700	97,730.000
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,100	90.590	280,829.000
ALTRIA GROUP INC	53,800	32.990	1,774,862.000
OWENS-ILLINOIS INC	4,600	20.500	94,300.000
PG & E CORPORATION	11,200	40.980	458,976.000
PFIZER INC	198,663	25.350	5,036,107.050
XCEL ENERGY INC	12,700	27.340	347,218.000
STRYKER CORP	8,500	56.160	477,360.000
PARKER HANNIFIN CORP	4,200	83.590	351,078.000
PALL CORP	3,100	60.330	187,023.000
PIONEER NATURAL RESOURCES	3,100	104.520	324,012.000
PROCTER & GAMBLE CO	73,437	69.930	5,135,449.410
EXELON CORP	22,722	29.930	680,069.460
ALEXION PHARMACEUTICALS	5,200	95.190	494,988.000
CONOCOPHILLIPS	30,500	58.280	1,777,540.000
PEPSICO INC	41,400	70.370	2,913,318.000
PLAINS EXPLORATION&PRODUC	3,200	45.950	147,040.000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,500	52.000	650,000.000
AMERICAN WATER WORKS CO	4,400	38.020	167,288.000
ACCENTURE LTD-CL A	17,200	71.330	1,226,876.000
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,800	35.810	136,078.000
PENTAIR LTD-REGISTERED	5,605	48.980	274,532.900
QUALCOMM INC	44,900	62.060	2,786,494.000
PARTNERRE LTD	1,800	82.140	147,852.000
INVESCO LTD	12,650	25.780	326,117.000
ADVANCE AUTO PARTS	2,050	73.050	149,752.500
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,500	27.850	208,875.000
MDU RESOURCES GROUP INC	5,200	21.510	111,852.000
ENERGEN CORP	2,000	44.600	89,200.000
RAYTHEON CO	8,800	58.170	511,896.000
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	2,200	58.550	128,810.000
RED HAT INC	5,200	51.300	266,760.000
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,800	179.400	322,920.000
REPUBLIC SERVICES INC	7,900	29.280	231,312.000
PRICELINE.COM INC	1,300	616.870	801,931.000
ROSS STORES INC	5,900	54.660	322,494.000
QEP RESOURCES INC	5,200	30.140	156,728.000
QUEST DIAGNOSTICS	4,400	59.460	261,624.000
ROBERT HALF INTL INC	3,700	29.860	110,482.000
REYNOLDS AMERICAN INC	9,000	42.880	385,920.000
RALPH LAUREN CORP	1,700	153.600	261,120.000
ROWAN COS PLC	3,700	31.440	116,328.000
ROCKWELL COLLINS INC.	3,500	56.880	199,080.000
REGIONS FINANCIAL CORP	40,435	6.910	279,405.850
CHEVRON CORP	51,718	108.680	5,620,712.240
EDISON INTERNATIONAL	8,600	44.990	386,914.000
SYMANTEC CORP	18,100	18.510	335,031.000
STANLEY BLACK & DECKER IN	4,522	72.150	326,262.300
SYNOPSYS INC	3,900	32.240	125,736.000
CBRE GROUP INC	8,500	19.780	168,130.000
COBALT INT'L ENERGY	5,200	25.360	131,872.000
SLM CORP	12,400	17.110	212,164.000
SANDISK CORP	6,800	42.700	290,360.000
SOUTHERN CO	23,700	43.740	1,036,638.000

SYSCO CORP	15,400	31.940	491,876.000
TRAVELERS COS INC	10,523	74.190	780,701.370
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,800	33.120	324,576.000
SPX CORP	1,400	63.620	89,068.000
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,100	22.660	92,906.000
STERICYCLE INC	2,400	93.650	224,760.000
SCHLUMBERGER LTD	35,067	69.680	2,443,468.560
RACKSPACE HOSTING INC	2,700	68.550	185,085.000
AT&T INC	152,895	34.230	5,233,595.850
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,000	10.360	62,160.000
SIGMA-ALDRICH	3,300	73.020	240,966.000
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,300	153.430	352,889.000
SEMPRA ENERGY	6,000	72.740	436,440.000
TIFFANY & CO	3,600	58.830	211,788.000
SEAGATE TECHNOLOGY	9,200	28.050	258,060.000
TEXAS INSTRUMENT INC	30,000	30.890	926,700.000
SALESFORCE.COM INC	3,500	168.910	591,185.000
SUPERIOR ENERGY SERVICES	4,200	20.120	84,504.000
TRW INC	3,000	51.110	153,330.000
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,000	67.650	135,300.000
TIME WARNER CABLE	8,053	95.930	772,524.290
TYCO INTERNATIONAL LTD	12,525	29.080	364,227.000
UNION PACIFIC CORP	12,700	125.690	1,596,263.000
MARATHON OIL CORP	18,400	30.700	564,880.000
MARATHON PETROLEUM CORP	9,000	62.960	566,640.000
UNITED TECHNOLOGIES	23,200	79.990	1,855,768.000
UNITED PARCEL SERVICE-B	19,500	73.360	1,430,520.000
SPRINT NEXTEL CORP	78,322	5.560	435,470.320
UNUM GROUP	7,000	20.890	146,230.000
AMEREN CORPORATION	6,500	29.980	194,870.000
UNITEDHEALTH GROUP INC	27,626	54.360	1,501,749.360
USX-US STEEL GRP	4,400	24.020	105,688.000
VERISIGN INC	4,000	36.240	144,960.000
VALERO ENERGY CORP	14,692	34.040	500,115.680
ULTA SALON COSME	1,400	97.240	136,136.000
WEYERHAEUSER CO	13,994	27.810	389,173.140
WELLPOINT INC	8,800	60.030	528,264.000
THE WALT DISNEY CO.	44,800	49.280	2,207,744.000
WELLS FARGO & CO	132,572	34.380	4,557,825.360
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,200	53.920	118,624.000
WASTE MANAGEMENT INC	11,400	33.740	384,636.000
WILLIAMS COMPANY	15,900	31.890	507,051.000
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,800	87.200	156,960.000
WHITING PETROLEUM CORP	3,300	42.400	139,920.000
WHIRLPOOL CORP	2,100	101.350	212,835.000
WAL-MART STORES	49,200	69.200	3,404,640.000
ZIMMER HOLDINGS INC	4,600	68.120	313,352.000
WEATHERFORD INTERNATIONAL	21,600	10.650	230,040.000
WYNN RESORTS LTD	2,300	113.690	261,487.000
XEROX CORP	37,044	6.940	257,085.360
TJX COMPANIES INC	19,700	43.620	859,314.000
WATERS CORP	2,500	88.180	220,450.000
WATSON PHARMACEUTICALS IN	3,600	87.990	316,764.000
WHOLE FOODS MARKET INC	4,700	89.840	422,248.000
WALGREEN CO	22,900	37.140	850,506.000
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	4,700	34.260	161,022.000
WESTERN DIGITAL CORP	6,300	38.040	239,652.000

WISCONSIN ENERGY CORP	6,400	37.670	241,088.000
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	14,100	30.640	432,024.000
VISA INC-CLASS A SHS	13,900	149.130	2,072,907.000
PPL CORPORATION	15,700	29.270	459,539.000
PITNEY BOWES INC	5,500	10.860	59,730.000
PEPCO HOLDINGS INC	6,400	19.810	126,784.000
PULTE GROUP INC	8,200	18.040	147,928.000
ULTRA PETROLEUM CORP	4,100	19.430	79,663.000
PPG INDUSTRIES INC	4,000	130.200	520,800.000
NORTHERN TRUST CORP	6,100	48.700	297,070.000
PRECISION CASTPARTS CORP	3,900	186.500	727,350.000
NVIDIA CORP	17,050	12.530	213,636.500
PNC FINANCIAL SERVICES	14,193	57.870	821,348.910
LIBERTY INTERACTIVE CORP	14,550	19.340	281,397.000
TERADATA CORP	4,700	60.990	286,653.000
TYSON FOODS INC-CL A	8,800	19.700	173,360.000
NETFLIX.COM INC	1,500	94.700	142,050.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC	9,600	64.800	622,080.000
NRG ENERGY INC	6,900	23.450	161,805.000
TORCHMARK CORP	2,450	51.810	126,934.500
TEXTRON INC	7,500	24.350	182,625.000
NEWS CORP-CL A	41,250	25.060	1,033,725.000
NEWS CORP-CLASS B	11,600	25.750	298,700.000
OMNICOM GROUP	7,200	49.770	358,344.000
ORACLE CORPORATION	103,283	32.330	3,339,139.390
MASTERCARD INC-CLASS A	2,900	489.320	1,419,028.000
ONEOK INC	5,600	43.720	244,832.000
CENTURYLINK INC	16,395	39.470	647,110.650
ROPER INDUSTRIES INC	2,500	110.130	275,325.000
YUM! BRANDS INC	12,200	69.070	842,654.000
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,400	145.460	203,644.000
MOLSON COORS BREWING CO-B	3,800	43.490	165,262.000
NOBLE ENERGY INC	4,800	100.600	482,880.000
BANK OF AMERICA CORP	287,501	11.000	3,162,511.000
NORDSTROM INC	4,100	52.280	214,348.000
AMERICAN EXPRESS CO	26,900	57.270	1,540,563.000
ANALOG DEVICES INC	7,900	41.550	328,245.000
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,500	16.880	109,720.000
AMERICAN INTL GROUP	27,472	34.950	960,146.400
ANADARKO PETROLEUM CORP	13,300	74.880	995,904.000
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	4,300	34.990	150,457.000
HUDSON CITY BANCORP INC	14,800	8.150	120,620.000
NEWFIELD EXPLORATION COMP	3,600	26.370	94,932.000
AVERY DENNISON CORP	3,000	34.090	102,270.000
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	8,000	72.960	583,680.000
EMERSON ELECTRIC CO	19,100	52.250	997,975.000
AON CORP	8,500	57.060	485,010.000
AMGEN	20,600	89.550	1,844,730.000
CORE LABORATORIES N.V.	1,200	104.030	124,836.000
ALLERGAN INC	8,100	93.270	755,487.000
COACH INC	7,800	57.890	451,542.000
EATON CORP PLC	12,486	52.450	654,890.700
CROWN CASTLE INTL CORP	8,000	71.240	569,920.000
CELGENE CORP	11,700	80.420	940,914.000
CONSTELLATION BRANDS INC-	4,200	35.550	149,310.000
APPLIED MATERIALS INC	32,000	11.090	354,880.000
CIT GROUP INC	5,100	38.150	194,565.000

CIMAREX ENERGY CO	2,500	56.890	142,225.000
CME GROUP INC	8,500	51.610	438,685.000
NATIONAL OILWELL VARCO IN	11,444	66.300	758,737.200
ECOLAB INC	7,700	71.080	547,316.000
EQUIFAX INC	3,500	54.900	192,150.000
GAP INC	8,900	31.910	283,999.000
GILEAD SCIENCES INC	20,000	75.460	1,509,200.000
COVENTRY HEALTH CARE INC	3,550	44.560	158,188.000
ST JUDE MEDICAL INC	8,200	35.720	292,904.000
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	5,448	44.590	242,926.320
HORMEL FOODS CORP	4,400	31.390	138,116.000
SAFEWAY INC	6,300	17.810	112,203.000
STATE STREET CORP	13,043	46.430	605,586.490
STAPLES INC	19,900	11.760	234,024.000
SUNTRUST BANKS INC	15,048	27.850	419,086.800
SCHWAB(CHARLES) CORP	29,800	13.870	413,326.000
IHS INC-CLASS A	1,400	93.090	130,326.000
BAXTER INTL INC	14,400	66.330	955,152.000
CAMPBELL SOUP CO	4,900	36.160	177,184.000
CROWN HOLDINGS INC	4,300	37.140	159,702.000
CHUBB CORP	7,200	76.770	552,744.000
CARDINAL HEALTH INC	9,500	42.320	402,040.000
CAREFUSION CORP	6,650	28.260	187,929.000
FEDEX CORP	7,900	91.020	719,058.000
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	15,254	58.010	884,884.540
FMC CORP	3,800	57.330	217,854.000
FLEXTRONICS INTL LTD	22,600	6.130	138,538.000
CERNER CORP	4,000	78.090	312,360.000
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,400	66.380	159,312.000
CITRIX SYSTEMS INC	5,100	66.180	337,518.000
INTEL CORP	133,300	20.560	2,740,648.000
CAMERON INTERNATIONAL COR	6,900	54.360	375,084.000
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	13,800	10.970	151,386.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS	12,000	22.050	264,600.000
IRON MOUNTAIN INC	3,647	30.960	112,911.120
CREE INC	3,300	34.040	112,332.000
ILLINOIS TOOL WORKS	11,100	60.260	668,886.000
SIRIUS XM RADIO INC	109,600	2.915	319,484.000
ILLUMINA INC	3,400	51.860	176,324.000
CHESAPEAKE ENERGY CORP	17,900	16.740	299,646.000
SEALED AIR CORP	5,500	16.300	89,650.000
INTUITIVE SURGICAL INC	1,100	551.000	606,100.000
CALPINE CORP	9,300	17.930	166,749.000
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	6,100	14.890	90,829.000
CARMAX INC	6,500	34.820	226,330.000
COMERICA INC	5,800	29.360	170,288.000
DUKE ENERGY CORP	18,428	64.760	1,193,397.280
TARGET CORP	16,400	61.090	1,001,876.000
DOVER CORP	4,900	64.250	314,825.000
WW GRAINGER INC	1,600	191.660	306,656.000
JACOBS ENGINEERING GROUP	3,500	42.040	147,140.000
JOHNSON CONTROLS INC	18,600	28.690	533,634.000
CINTAS CORP	3,700	42.150	155,955.000
CA INC	8,805	22.010	193,798.050
CONAGRA INC	11,000	30.320	333,520.000
CLOROX COMPANY	3,200	75.600	241,920.000
ENTERGY CORP	4,700	64.350	302,445.000

MICROSOFT CORP	200,100	27.090	5,420,709.000
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,800	50.040	240,192.000
CVS CAREMARK CORP	33,574	49.040	1,646,468.960
MEDTRONIC INC	27,700	42.240	1,170,048.000
MICRON TECHNOLOGY INC	28,500	6.610	188,385.000
BLACKROCK INC-CLASS A	3,600	205.290	739,044.000
CENTERPOINT ENERGY INC	10,700	19.840	212,288.000
HASBRO INC	3,600	36.750	132,300.000
KELLOGG CO	6,500	56.860	369,590.000
KEYCORP	26,000	8.390	218,140.000
KANSAS CITY SOUTHERN	3,200	82.490	263,968.000
MONDELEZ INTERNATIONAL IN	45,311	26.060	1,180,804.660
KOHL'S CORP	5,900	44.190	260,721.000
SEARS HOLDING CORP	1,225	44.070	53,985.750
NEW YORK COMMUNITY BANCOR	11,100	12.950	143,745.000
APACHE CORP	10,210	77.460	790,866.600
ACE LTD	9,200	80.900	744,280.000
ARROW ELECTRONICS INC	3,200	37.970	121,504.000
ALLSTATE	12,900	40.790	526,191.000
EBAY INC	30,800	51.310	1,580,348.000
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,800	65.760	249,888.000
XILINX INC	7,500	35.480	266,100.000
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	21,410	55.330	1,184,615.300
DISH NETWORK CORP	6,200	36.220	224,564.000
YAHOO! INC	29,400	19.690	578,886.000
ESTEE LAUDER COMPANIES-A	6,600	60.820	401,412.000
TOLL BROTHERS INC	4,500	32.220	144,990.000
TRIMBLE NAVIGATION LTD	3,000	58.840	176,520.000
LINEAR TECHNOLOGY CORP	6,300	33.750	212,625.000
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	7,500	16.190	121,425.000
NOBLE CORP	6,500	34.620	225,030.000
PROGRESSIVE CORP	16,000	21.270	340,320.000
PRAXAIR INC	8,100	107.720	872,532.000
PACCAR INC	8,837	44.350	391,920.950
PETSMART INC	2,800	71.020	198,856.000
PVH CORP	1,600	110.230	176,368.000
EMC CORP/MASS	55,300	25.270	1,397,431.000
BIOGEN IDEC INC	5,930	152.650	905,214.500
INTL GAME TECHNOLOGY	8,100	14.360	116,316.000
STARBUCKS CORP	20,100	54.580	1,097,058.000
PERRIGO CO	2,400	102.670	246,408.000
NORTHEAST UTILITIES	8,180	39.270	321,228.600
INTUIT INC	7,700	61.210	471,317.000
BORG-WARNER AUTOMOTIVE	3,100	66.460	206,026.000
BEST BUY COMPANY INC	9,000	12.270	110,430.000
BALL CORP	4,200	44.200	185,640.000
BOSTON SCIENTIFIC CORP	36,247	5.740	208,057.780
BED BATH & BEYOND INC	6,100	58.990	359,839.000
XL GROUP PLC	8,400	24.840	208,656.000
ELECTRONIC ARTS INC	9,100	15.420	140,322.000
VULCAN MATERIALS CO	3,700	52.710	195,027.000
VERTEX PHARMACEUTICALS IN	5,400	41.870	226,098.000
VF CORP	2,400	151.110	362,664.000
CBS CORP-CL B	15,671	35.730	559,924.830
VIACOM INC-CLASS B	12,471	53.410	666,076.110
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,700	81.960	139,332.000
NUANCE COMMUNICATIONS INC	7,200	22.310	160,632.000

	VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	3,200	71.500	228,800.000	
	CARNIVAL CORP	12,400	38.600	478,640.000	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES	4,100	33.920	139,072.000	
	COMCAST CORP -CL A	55,970	37.550	2,101,673.500	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	15,200	36.230	550,696.000	
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 348,844,689.720 (29,257,604,126)	
イギリス・ボンド		株	イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	
	KAZAKHMYS PLC	5,900	7.825	46,167.500	
	BP PLC	516,200	4.270	2,204,174.000	
	UNILEVER PLC	35,260	24.210	853,644.600	
	BARCLAYS PLC	319,700	2.569	821,309.300	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	50,400	8.595	433,188.000	
	TUI TRAVEL PLC	16,100	2.822	45,434.200	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	45,600	3.917	178,615.200	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,300	62.200	143,060.000	
	REXAM PLC	24,200	4.427	107,133.400	
	PRUDENTIAL PLC	68,800	8.800	605,440.000	
	INMARSAT PLC	12,800	6.000	76,800.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	59,891	3.017	180,691.140	
	JOHNSON MATTHEY PLC	5,809	24.110	140,054.990	
	BAE SYSTEMS PLC	91,400	3.385	309,389.000	
	AVIVA PLC	77,400	3.694	285,915.600	
	EURASIAN NATURAL RESOURCE	7,400	2.706	20,024.400	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	134,302	13.655	1,833,893.810	
	MELROSE PLC	30,600	2.261	69,186.600	
	INVENSYS PLC	23,500	3.203	75,270.500	
	REED ELSEVIER PLC	34,046	6.280	213,808.880	
	BG GROUP PLC	91,200	10.320	941,184.000	
	DIAGEO PLC	67,300	18.360	1,235,628.000	
	RIO TINTO PLC-REG	36,200	34.700	1,256,140.000	
	STANDARD CHARTERED PLC	65,300	15.000	979,500.000	
	TESCO PLC	219,300	3.417	749,348.100	
	FRESNILLO PLC	5,000	19.400	97,000.000	
	SMITH & NEPHEW PLC	25,700	6.710	172,447.000	
	GLENORE INTERNATIONAL PL	101,400	3.518	356,725.200	
	SMITHS GROUP PLC	11,433	11.530	131,822.490	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	10,000	9.815	98,150.000	
	PEARSON PLC	21,763	11.750	255,715.250	
	SAINSBURY (J) PLC	36,125	3.486	125,931.750	
	NEXT PLC	4,400	37.110	163,284.000	
	WHITBREAD PLC	4,911	24.190	118,797.090	
	IMI PLC	8,300	10.660	88,478.000	
	BUNZL PLC	9,655	10.520	101,570.600	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	21,800	3.490	76,082.000	
	GKN PLC	45,700	2.256	103,099.200	
	VODAFONE GROUP PLC	1,328,037	1.582	2,100,954.530	
	BALFOUR BEATTY PLC	21,400	2.670	57,138.000	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	3,900	23.460	91,494.000	
	KINGFISHER PLC	67,511	2.750	185,655.250	
	WPP PLC	33,800	8.700	294,060.000	
	UNITED UTILITIES GROUP PL	19,627	7.045	138,272.210	
	SEVERN TRENT PLC	6,633	15.660	103,872.780	
	RECKITT BENCKISER PLC	17,800	39.200	697,760.000	
	SCHROEDERS PLC	3,200	16.580	53,056.000	

TATE&LYLE PLC	11,800	7.515	88,677.000
AMEC PLC	7,900	10.140	80,106.000
SSE PLC	25,200	14.430	363,636.000
WEIR GROUP PLC (THE)	6,300	17.880	112,644.000
ASTRAZENECA PLC	33,600	29.295	984,312.000
WOLSELEY PLC	7,233	28.090	203,174.970
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	155,800	1.442	224,663.600
3I GROUP PLC	27,591	2.162	59,651.740
BRITISH SKY BROADCASTING	29,100	7.660	222,906.000
SAGE GROUP PLC (THE)	32,100	2.909	93,378.900
NATIONAL GRID PLC	97,828	7.030	687,730.840
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,139,965	0.468	533,503.620
RSA INSURANCE GROUP PLC	102,300	1.247	127,568.100
IMPERIAL TOBACCO GROUP	26,700	24.260	647,742.000
CENTRICA PLC	139,260	3.347	466,103.220
ARM HOLDINGS PLC	36,500	7.450	271,925.000
BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	52,960	31.940	1,691,542.400
ICAP PLC	16,900	3.086	52,153.400
SABMILLER PLC	25,900	27.865	721,703.500
BHP BILLITON PLC	57,677	21.245	1,225,347.860
ASSOCIATED BRITISH FOODS	9,900	15.300	151,470.000
HSBC HOLDINGS PLC	492,800	6.415	3,161,312.000
SHIRE PLC	15,500	19.230	298,065.000
OLD MUTUAL PLC	137,725	1.747	240,605.570
ANGLO AMERICAN PLC	37,783	18.565	701,441.390
MORRISON SUPERMARKETS	59,900	2.660	159,334.000
CARNIVAL PLC	5,061	24.710	125,057.310
COMPASS GROUP PLC	49,700	7.350	365,295.000
BT GROUP PLC	215,500	2.367	510,088.500
XSTRATA PLC	56,300	10.475	589,742.500
BURBERRY GROUP PLC	12,189	12.580	153,337.620
INTERCONTINENTAL HOTELS	7,746	16.460	127,499.160
AGGREKO PLC	7,671	16.640	127,645.440
CAPITA PLC	18,190	7.550	137,334.500
SERCO GROUP PLC	15,300	5.375	82,237.500
INTERTEK GROUP PLC	4,700	30.760	144,572.000
ITV PLC	94,200	1.013	95,424.600
TULLOW OIL PLC	25,400	12.050	306,070.000
VEDANTA RESOURCES PLC	3,500	11.150	39,025.000
PETROFAC LTD	7,000	16.800	117,600.000
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,349	10.700	46,534.300
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	100,300	21.325	2,138,897.500
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	71,681	22.010	1,577,698.810
MEGGITT PLC	23,600	3.881	91,591.600
G4S PLC	40,800	2.503	102,122.400
COBHAM PLC	31,500	2.140	67,410.000
ADMIRAL GROUP PLC	5,700	11.510	65,607.000
INVESTEC PLC	16,400	4.085	66,994.000
ANTOFAGASTA PLC	10,800	13.590	146,772.000
STANDARD LIFE PLC	67,400	3.336	224,846.400
EXPERIAN PLC	28,054	10.130	284,187.020
RESOLUTION LTD	42,476	2.495	105,977.620
イギリス・ボンド 小計			イギリス・ボンド 40,826,632.460 (5,547,522,819)
イスラエル・シュケル	株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル

	BEZEQ ISRAELI TELECOM COR	56,400	4.490	253,236.000
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	46.300	648,200.000
	TEVA PHARMACEUTICAL IND L	27,200	144.700	3,935,840.000
	BANK HAPOALIM BM	36,300	16.400	595,320.000
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,600	12.800	481,280.000
	NICE SYSTEMS LTD	2,100	127.600	267,960.000
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	800	247.400	197,920.000
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 6,379,756.000 (141,566,785)
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	87,600	36.350	3,184,260.000
	LEND LEASE	16,100	8.960	144,256.000
	ASCIANO LTD	28,600	4.470	127,842.000
	ALUMINA LTD	69,900	0.940	65,706.000
	WOODSIDE PETROLEUM	17,800	34.000	605,200.000
	OZ MINERALS LTD	9,707	7.310	70,958.170
	FORTESCUE METALS GROUP	39,700	4.470	177,459.000
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	8.280	97,704.000
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	61,800	24.480	1,512,864.000
	WESTPAC BANKING	82,898	25.750	2,134,623.500
	SANTOS LIMITED	26,800	10.850	290,780.000
	AUSTRALIA & NZLAND BK	73,600	24.490	1,802,464.000
	RIO TINTO LTD	12,200	63.520	774,944.000
	ORIGIN ENERGY LIMITED	30,600	11.320	346,392.000
	AMCOR	35,600	8.050	286,580.000
	METCASH LTD	23,500	3.220	75,670.000
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP	20,500	3.480	71,340.000
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,800	3.650	170,820.000
	NEWCREST MINING	21,400	23.200	496,480.000
	INCITEC PIVOT LTD	45,600	3.250	148,200.000
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	43,800	61.290	2,684,502.000
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,800	18.990	91,152.000
	ORICA LIMITED	10,300	24.020	247,406.000
	QBE INSURANCE	33,200	10.300	341,960.000
	LEIGHTON HOLDINGS	4,600	16.960	78,016.000
	WOOLWORTHS	33,300	29.220	973,026.000
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	15,900	13.270	210,993.000
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	2.910	59,655.000
	CROWN LTD	16,900	10.190	172,211.000
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	38,700	1.395	53,986.500
	TELSTRA CORPORATION	121,200	4.290	519,948.000
	AMP LIMITED	79,400	4.700	373,180.000
	JAMES HARDIE INDUSTRIES	15,900	8.950	142,305.000
	MACQUARIE GROUP LIMITED	9,800	33.300	326,340.000
	CSL LIMITED	13,900	53.350	741,565.000
	WESFARMERS LIMITED	27,200	35.590	968,048.000
	COCHLEAR LIMITED	1,700	76.960	130,832.000
	SUNCORP GROUP LTD	36,300	10.010	363,363.000
	BORAL LIMITED	22,700	4.340	98,518.000
	ASX LTD	5,000	30.390	151,950.000
	COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	8.730	121,347.000
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LT	14,000	1.860	26,040.000
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	58,400	4.700	274,480.000
	SONIC HEALTHCARE LTD	11,300	13.100	148,030.000
	TRANSURBAN GROUP	37,500	6.170	231,375.000

	ILUKA RESOURCES LTD	12,000	7.960	95,520.000
	TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	4.600	86,480.000
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	5,400	9.040	48,816.000
	SYDNEY AIRPORT	11,300	3.450	38,985.000
	WORLEYPARSONS LTD	6,100	23.010	140,361.000
	TATTS GROUP LTD	36,900	2.910	107,379.000
	AGL ENERGY LTD	16,100	14.600	235,060.000
	BRAMBLES LTD	42,700	7.340	313,418.000
	ALS LTD	9,500	9.650	91,675.000
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 23,272,465.170 (2,059,613,168)
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル
	IMPERIAL OIL LTD	7,900	42.240	333,696.000
	SILVER WHEATON CORP	9,300	36.490	339,357.000
	INTACT FINANCIAL CORP	3,700	63.270	234,099.000
	BCE INC	6,830	42.670	291,436.100
	FRANCO-NEVADA CORP	4,000	57.560	230,240.000
	SUNCOR ENERGY INC	42,180	32.180	1,357,352.400
	METRO INC-A	2,800	62.640	175,392.000
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,300	76.940	330,842.000
	BANK OF NOVA SCOTIA	30,400	56.640	1,721,856.000
	CANADIAN IMPERIAL BANK	10,900	81.420	887,478.000
	TORONTO-DOMINION BANK	25,000	81.200	2,030,000.000
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,100	23.710	192,051.000
	MEG ENERGY CORP	3,800	31.730	120,574.000
	ROYAL BANK OF CANADA	39,300	59.070	2,321,451.000
	TOURMALINE OIL CORP	3,800	30.730	116,774.000
	VERMILION ENERGY INC	2,800	51.400	143,920.000
	TRANSCANADA CORP	19,400	45.820	888,908.000
	BAYTEX ENERGY CORP	3,400	43.000	146,200.000
	BONAVISTA ENERGY CORP	4,600	14.300	65,780.000
	PENGROWTH ENERGY CORP	14,700	4.840	71,148.000
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,300	28.620	237,546.000
	BOMBARDIER INC 'B'	41,400	3.480	144,072.000
	BARRICK GOLD CORP	27,600	33.920	936,192.000
	CAE INC	9,200	10.050	92,460.000
	THOMSON REUTERS CORP	9,804	28.700	281,374.800
	POTASH CORP OF SASKATCHEW	23,500	40.250	945,875.000
	INMET MINING CRP	1,600	72.850	116,560.000
	LOBLAW COMPANIES LTD	3,500	40.690	142,415.000
	OSISKO MINING CORP	10,900	7.730	84,257.000
	CANADIAN UTILITIES LTD A	1,800	70.000	126,000.000
	ROGERS COMMUNICATIONS-B	10,200	44.550	454,410.000
	AGNICO-EAGLE MINES	4,800	52.210	250,608.000
	ATHABASCA OIL CORP	9,000	10.310	92,790.000
	KINROSS GOLD CORP	32,100	9.570	307,197.000
	BANK OF MONTREAL	17,300	59.940	1,036,962.000
	POWER CORP OF CANADA	9,200	24.630	226,596.000
	CAMECO CORP	10,300	19.840	204,352.000
	POWER FINANCIAL CORP	6,300	26.940	169,722.000
	NEW GOLD INC	14,000	10.930	153,020.000
	TECK RESOURECES LIMITED-B	15,800	35.030	553,474.000
	NEXEN INC	14,300	26.320	376,376.000
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,300	69.680	160,264.000
	VITERRA INC	8,300	16.240	134,792.000

TALISMAN ENERGY INC	27,000	11.090	299,430.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES	11,100	7.650	84,915.000	
AGRIUM INC	4,000	96.770	387,080.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCE	29,900	27.640	826,436.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,800	47.420	275,036.000	
TRANSALTA CORP	6,700	14.630	98,021.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,400	69.710	97,594.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,600	18.380	84,548.000	
RESEARCH IN MOTION	13,800	13.660	188,508.000	
SUN LIFE FINANCIAL SVSC	15,800	26.740	422,492.000	
ENBRIDGE INC	20,400	42.190	860,676.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	15,400	35.420	545,468.000	
BROOKFIELD OFFICE PROPERT	8,750	16.660	145,775.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	48,800	13.000	634,400.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS I	7,800	58.510	456,378.000	
GOLDCORP INC	21,859	36.330	794,137.470	
ENCANA CORP	19,800	19.760	391,248.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	4,600	97.970	450,662.000	
IAMGOLD CORPORATION	11,000	11.470	126,170.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSUR	2,800	29.550	82,740.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,400	35.320	120,088.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	11,700	89.970	1,052,649.000	
CGI GROUP INC - CL A	5,300	23.260	123,278.000	
HUSKY ENERGY INC	9,700	29.010	281,397.000	
ONEX CORPORATION	3,500	41.720	146,020.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	9,800	22.360	219,128.000	
TELUS CORPORATION-NON VOT	4,500	65.000	292,500.000	
FINNING INTERNATIONAL INC	5,200	24.060	125,112.000	
SHOPPERS DRUG MART CORP	5,500	42.600	234,300.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,400	41.150	181,060.000	
ELDORADO GOLD CORPORATION	19,100	13.360	255,176.000	
CENTERRA GOLD INC	4,600	8.990	41,354.000	
IGM FINANCIAL INC	3,100	40.690	126,139.000	
OPEN TEXT CORP	2,000	54.860	109,720.000	
CI FINANCIAL CORP	5,600	24.180	135,408.000	
SAPUTO INC	3,700	49.880	184,556.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LT	13,600	20.110	273,496.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD	3,700	48.130	178,081.000	
YAMANA GOLD INC	20,000	16.900	338,000.000	
FORTIS INC	4,900	33.980	166,502.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,400	21.280	72,352.000	
CRESCENT POINT ENERGY COR	9,400	37.390	351,466.000	
CENOVUS ENERGY INC	20,900	32.550	680,295.000	
TIM HORTONS INC	4,400	48.660	214,104.000	
CATAMARAN CORP	5,400	49.450	267,030.000	
CANADIAN OIL SANDS LTD	13,500	19.250	259,875.000	
ENERPLUS CORP	6,000	12.670	76,020.000	
PENN WEST PETROLEUM LTD	13,600	11.150	151,640.000	
ARC RESOURCES LTD	8,400	23.710	199,164.000	
PACIFIC RUBIALES ENERGY C	8,400	23.250	195,300.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 33,528,793.770 (2,859,335,533)	
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	38,000		19.690	748,220.000
DBS GROUP HOLDINGS LTD	52,000		14.900	774,800.000

SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	10.930	180,017.100
FRASER & NEAVE LTD	26,000	9.630	250,380.000
KEPPEL CORP	41,500	10.880	451,520.000
UOL GROUP LIMITED	19,400	5.830	113,102.000
CITY DEVELOPMENT	17,000	13.120	223,040.000
CAPITALAND LIMITED	79,000	3.680	290,720.000
SEMBCORP MARINE LTD	25,000	4.540	113,500.000
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	49,000	4.020	196,980.000
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	3,000	48.470	145,410.000
O.C.B.C.	74,000	9.720	719,280.000
GENTING SINGAPORE PLC	175,000	1.360	238,000.000
SINGAPORE TELECOM LTD	218,450	3.390	740,545.500
NOBLE GROUP LTD	115,181	1.145	131,882.240
SINGAP. TECH ENGINEERING	48,000	3.850	184,800.000
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	36,000	5.150	185,400.000
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	219,400	0.655	143,707.000
SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,000	6.980	188,460.000
OLAM INTERNATIONAL LTD	50,000	1.395	69,750.000
WILMAR INTERNATIONAL LTD	56,000	3.140	175,840.000
CAPITAMALLS ASIA LTD	45,000	1.995	89,775.000
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIE	56,000	2.750	154,000.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 6,509,128.840 (447,697,882)
スイス・フラン	株	スイス・フラン	スイス・フラン
ADECCO SA-REG	3,850	47.620	183,337.000
ROCHE HOLDING AG-GENUS	19,100	185.700	3,546,870.000
PARGESA HOLDING SA-BR	800	63.800	51,040.000
SIKA AG-BR	70	2,132.000	149,240.000
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	34,800.000	139,200.000
ABB LTD	59,350	18.820	1,116,967.000
ARYZTA AG	2,700	46.400	125,280.000
TRANSOCEAN LTD	10,250	41.220	422,505.000
SWISS RE LTD	9,400	65.650	617,110.000
NESTLE SA-REGISTERED	88,100	60.150	5,299,215.000
SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,500	130.900	196,350.000
CREDIT SUISSE GROUP AG	33,650	22.520	757,798.000
JULIUS BAER GROUP LTD	6,250	33.010	206,312.500
SULZER AG-REG	800	142.800	114,240.000
SGS SA	160	2,053.000	328,480.000
THE SWATCH GROUP AG-B	850	462.100	392,785.000
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,982	240.100	956,078.200
BALOISE HOLDING AG - REG	1,600	79.500	127,200.000
NOVARTIS AG-REG SHS	62,400	58.300	3,637,920.000
CIE FINANC RICHEMONT-A	14,700	72.400	1,064,280.000
UBS AG-REGISTERED	97,600	14.970	1,461,072.000
SWISSCOM AG-REG	670	398.000	266,660.000
GEBERIT AG-REG	1,150	198.500	228,275.000
GIVAUDAN REG	250	964.000	241,000.000
ACTELION LTD-REG	3,450	45.020	155,319.000
SYNGENTA AG	2,562	371.700	952,295.400
SONOVA HOLDING AG-REG	1,450	103.900	150,655.000
LONZA GROUP AG-REG	1,550	49.140	76,167.000
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	79.500	119,250.000
HOLCIM LTD-REG	6,200	65.150	403,930.000
SWISS LIFE HOLDING AG	950	123.300	117,135.000

	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,650	109.900	181,335.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 23,785,301.100 (2,173,500,815)	
スウェーデン・ク ローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	ERICSSON LM-B SHS	82,430	65.750	5,419,772.500	
	VOLVO AB-B SHS	38,900	92.600	3,602,140.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	1,700	553.000	940,100.000	
	S.K.F. AB-B SHS	10,900	159.600	1,739,640.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,400	176.900	1,132,160.000	
	NORDEA AB	70,900	61.200	4,339,080.000	
	ELEKTA AB-B SHS	8,800	102.500	902,000.000	
	SCANIA AB-B SHS	9,250	135.300	1,251,525.000	
	SWEDISH MATCH AB	5,350	222.400	1,189,840.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	117.400	1,050,730.000	
	GETINGE AB-B SHS	5,100	217.900	1,111,290.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	40,050	55.250	2,212,762.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	13,600	234.000	3,182,400.000	
	SWEDBANK AB	21,350	124.600	2,660,210.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B	26,100	224.300	5,854,230.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	15,250	135.800	2,070,950.000	
	SKANSKA AB-B	10,800	108.900	1,176,120.000	
	SANDVIK AB	27,950	100.800	2,817,360.000	
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	164.900	2,028,270.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	17,850	175.000	3,123,750.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,200	54.550	501,860.000	
	TELIASONERA AB	60,650	44.450	2,695,892.500	
	ALFA LAVAL AB	9,400	133.700	1,256,780.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	10,200	155.200	1,583,040.000	
	ASSA ABLOY AB-B	9,300	238.000	2,213,400.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	6,400	150.200	961,280.000	
	BOLIDEN AB	7,900	119.600	944,840.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,550	40.290	505,639.500	
	RATOS AB-B SHS	5,900	68.450	403,855.000	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,650	133.500	887,775.000	
	HEXAGON AB-B SHS	6,100	170.000	1,037,000.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 60,795,692.000 (765,417,762)	
デンマーク・ク ローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	11,200	914.500	10,242,400.000	
	DANSKE BANK A/S	17,100	97.850	1,673,235.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	19	39,560.000	751,640.000	
	TDC A/S	11,500	39.830	458,045.000	
	CARLSBERG AS-B	3,050	549.500	1,675,975.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,500	160.000	1,040,000.000	
	COLOPLAST-B	650	1,323.000	859,950.000	
	DSV A/S	5,600	138.500	775,600.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	825	481.600	397,320.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	32	42,040.000	1,345,280.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 19,219,445.000 (284,447,786)	
ニュージーランド ・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	

	TELECOM CORP OF NZ	65,589	2.160	141,672.240
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	8.140	163,614.000
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 305,286.240 (21,626,477)
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ
	NORSK HYDRO ASA	24,700	27.600	681,720.000
	DNB ASA	27,600	70.250	1,938,900.000
	ORKLA ASA	23,350	47.350	1,105,622.500
	TELENOR ASA	21,100	113.900	2,403,290.000
	STATOIL ASA	30,973	137.900	4,271,176.700
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,460	276.500	1,509,690.000
	SEADRILL LTD	9,850	205.900	2,028,115.000
	AKER SOLUTIONS ASA	4,250	114.500	486,625.000
	SUBSEA 7 SA	8,000	133.700	1,069,600.000
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 15,494,739.200 (231,491,404)
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ
	BAYER AG	22,500	72.270	1,626,075.000
	DEUTSCHE BANK AG-REG	25,600	32.540	833,024.000
	COMMERZBANK AG	104,850	1.446	151,613.100
	VOLKSWAGEN AG	700	160.350	112,245.000
	VOLKSWAGEN AG PFD	3,900	170.750	665,925.000
	M.A.N.	1,300	81.420	105,846.000
	SIEMENS AG	22,200	82.270	1,826,394.000
	E.ON SE	49,700	14.185	704,994.500
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	9,000	71.680	645,120.000
	GEA GROUP AG	5,050	24.905	125,770.250
	CONTINENTAL AG	3,050	85.710	261,415.500
	BASF SE	25,150	72.140	1,814,321.000
	LINDE	5,000	133.700	668,500.000
	K+S AG	4,850	34.985	169,677.250
	ALLIANZ SE-REG	12,500	103.700	1,296,250.000
	THYSSENKRUPP AG	11,350	17.915	203,335.250
	HENKEL AG & CO KGAA	4,750	61.110	290,272.500
	R.W.E. AG	13,200	31.275	412,830.000
	LUFTHANSA	6,750	14.030	94,702.500
	FRAPORT AG	1,100	44.300	48,730.000
	BRENTAG AG	1,400	100.600	140,840.000
	FRESENIUS SE & CO KGAA	3,300	87.790	289,707.000
	UNITED INTERNET AG-REG SH	4,100	16.020	65,682.000
	HOCHTIEF AG	1,450	44.005	63,807.250
	SAP AG	25,192	61.000	1,536,712.000
	MUNCHENER RUECK AG-REG	4,850	134.400	651,840.000
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,650	43.960	160,454.000
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	4,050	57.560	233,118.000
	BEIERSDORF AG	2,600	60.810	158,106.000
	CELESIO AG	2,800	12.905	36,134.000
	MERCK KGAA	1,850	102.100	188,885.000
	ADIDAS AG	5,570	68.210	379,929.700
	HENKEL KGAA	3,750	50.730	190,237.500
METRO AG	3,850	21.540	82,929.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	76,300	8.515	649,694.500	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,950	52.440	312,018.000	
DAIMLER AG	24,800	41.335	1,025,108.000	

QIAGEN N.V.	6,800	13.530	92,004.000
INFINEON TECHNOLOGIES AG	31,500	5.894	185,661.000
HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,850	58.050	107,392.500
DEUTSCHE POST AG	24,100	16.360	394,276.000
DEUTSCHE BOERSE AG	5,450	45.530	248,138.500
RWE AG-NON VTG PFD	1,150	28.755	33,068.250
SUEDZUCKER AG	2,250	30.660	68,985.000
LANXESS	2,450	67.240	164,738.000
SALZGITTER AG	1,250	39.360	49,200.000
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING	2,650	57.220	151,633.000
PHILIPS ELECTRONICS NV	27,876	19.995	557,380.620
ARCELORMITTAL	24,900	12.945	322,330.500
UNILEVER NV-CVA	43,900	29.280	1,285,392.000
HEINEKEN NV	6,650	49.255	327,545.750
REED ELSEVIER NV	20,077	10.900	218,839.300
AEGON NV	48,744	4.663	227,293.270
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	27,760	10.220	283,707.200
AKZO NOBEL	6,600	48.855	322,443.000
KONINKLIJKE DSM NV	4,400	44.990	197,956.000
WOLTERS KLUWER	8,850	15.310	135,493.500
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,100	33.210	69,741.000
ING GROEP N.V.	107,350	7.248	778,072.800
KONINKLIJKE KPN NV	28,500	3.937	112,204.500
ASML HOLDING NV	8,730	48.300	421,659.000
TNT EXPRESS NV	10,195	7.933	80,876.930
VOPAK	2,000	53.310	106,620.000
RANDSTAD HOLDING NV	3,250	26.695	86,758.750
FUGRO NV-CVA	1,900	44.595	84,730.500
HEINEKEN HOLDING NV	3,050	41.090	125,324.500
DE MASTER BLENDERS1753 NV	16,500	8.730	144,045.000
TOTAL SA	57,150	39.140	2,236,851.000
MICHELIN (CGDE) - B	4,850	71.470	346,629.500
AIR LIQUIDE	8,376	94.260	789,521.760
PPR	2,000	141.600	283,200.000
SCHNEIDER ELECTRIC SA	14,200	55.000	781,000.000
BOUYGUES	5,550	22.115	122,738.250
LAFARGE SA	5,300	46.265	245,204.500
BNP PARIBAS	27,050	43.845	1,186,007.250
PEUGEOT SA	6,800	5.602	38,093.600
NATIXIS	28,050	2.556	71,695.800
THALES SA	3,050	27.225	83,036.250
GROUPE DANONE	15,800	49.225	777,755.000
CARREFOUR	16,550	19.305	319,497.750
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	8,075	9.149	73,878.170
VIVENDI SA	35,391	16.770	593,507.070
L'OREAL	6,600	103.600	683,760.000
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	11,150	32.115	358,082.250
LEGRAND SA	6,767	31.470	212,957.490
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	71.400	110,670.000
PERNOD-RICARD	5,817	88.740	516,200.580
EURAZEO	1,077	36.355	39,154.330
SOCIETE GENERALE-A	18,850	29.590	557,771.500
LVMH	6,900	137.100	945,990.000
ACCOR SA	4,450	26.100	116,145.000
CAP GEMINI SA	4,300	33.625	144,587.500
PUBLICIS GROUPE	4,600	45.355	208,633.000
VALLOUREC	2,650	40.040	106,106.000

BUREAU VERITAS SA	1,550	86.000	133,300.000
SODEXO	2,450	64.010	156,824.500
ESSILOR INTERNATIONAL	5,400	76.520	413,208.000
AXA	48,100	13.015	626,021.500
CHRISTIAN DIOR	1,400	129.100	180,740.000
LAGARDERE S.C.A.	3,800	25.050	95,190.000
TECHNIP S.A.	2,850	85.880	244,758.000
EDENRED	5,050	23.385	118,094.250
RENAULT	5,350	41.800	223,630.000
STMICROELECTRONICS NV	19,150	5.295	101,399.250
ATOS	1,600	53.570	85,712.000
DASSAULT SYSTEMS SA	1,750	84.210	147,367.500
WENDEL	1,100	75.150	82,665.000
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ	4,650	22.845	106,229.250
FRANCE TELECOM SA	49,250	8.438	415,571.500
ALSTOM	5,750	30.315	174,311.250
CNP ASSURANCES	5,150	11.600	59,740.000
SANOFI	32,475	71.430	2,319,689.250
VINCI	12,300	35.790	440,217.000
EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	10,950	29.110	318,754.500
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,000	9.080	99,880.000
CREDIT AGRICOLE SA	25,700	5.909	151,861.300
GDF SUEZ	34,873	15.330	534,603.090
IMERYS SA	1,100	47.835	52,618.500
ELECTRICITE DE FRANCE	6,850	13.815	94,632.750
SES	8,700	21.620	188,094.000
SAFRAN SA	6,550	32.470	212,678.500
ILIAD SA	750	133.100	99,825.000
ARKEMA	1,600	81.520	130,432.000
ADP	950	61.240	58,178.000
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	25.125	101,756.250
GEMALTO	2,250	69.620	156,645.000
SCOR SE	5,900	20.430	120,537.000
GROUPE EUROTUNNEL SA-REGR	18,050	5.726	103,354.300
UCB SA	2,800	43.665	122,262.000
KBC GROUPE	5,100	25.000	127,500.000
COLRUYT SA	2,500	36.320	90,800.000
DELHAIZE GROUP	2,950	30.435	89,783.250
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	2,300	59.590	137,057.000
SOLVAY SA	1,550	108.000	167,400.000
UMICORE	2,950	41.700	123,015.000
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	22,050	66.140	1,458,387.000
AGEAS	6,640	22.100	146,744.000
BELGACOM SA	4,900	22.325	109,392.500
BANCO POPOLARE SCARL	50,150	1.182	59,277.300
FIAT SPA	26,650	3.752	99,990.800
PRYSMIAN SPA	5,700	14.320	81,624.000
ASSICURAZIONI GENERALI	31,143	13.330	415,136.190
SAIPEM	7,550	29.770	224,763.500
FIAT INDUSTRIAL	24,750	8.275	204,806.250
MEDIOBANCA SPA	17,115	4.390	75,134.850
TENARIS SA	13,400	14.990	200,866.000
UNICREDIT SPA	113,569	3.570	405,441.330
TELECOM ITALIA SPA	269,882	0.698	188,377.630
TELECOM ITALIA-RNC	170,950	0.623	106,501.850
INTESA SANPAOLO-RNC	21,350	1.050	22,417.500
INTESA SANPAOLO	274,297	1.284	352,197.340

ATLANTIA SPA	9,607	13.280	127,580.960
ENI SPA	66,200	18.250	1,208,150.000
FINMECCANICA SPA	11,225	4.206	47,212.350
MONTE DEI PASCHI SIENA	131,900	0.216	28,490.400
ENEL SPA	179,800	3.098	557,020.400
SNAM SPA	47,150	3.474	163,799.100
LUXOTTICA GROUP SPA	3,750	31.050	116,437.500
UNIONE DI BANCHE ITALIANE	26,800	3.246	86,992.800
TERNA SPA	37,300	2.988	111,452.400
PIRELLI & C.	7,645	8.895	68,002.270
ENEL GREEN POWER SPA	55,400	1.400	77,560.000
TELEFONICA S.A.	113,177	10.125	1,145,917.120
BANCO POPULAR ESPANOL	70,615	0.563	39,756.240
GRIFOLS SA-RTS	4,400	0.882	3,880.800
BANCO BILBAO VIZCAYA	149,862	6.830	1,023,557.460
IBERDROLA SA	109,684	3.958	434,129.270
BANCO DE SABADELL SA	58,786	2.150	126,389.900
REPSOL SA	22,550	16.085	362,716.750
GRIFOLS SA	4,400	24.320	107,008.000
BANCO SANTANDER SA	275,750	5.830	1,607,622.500
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	10,800	12.275	132,570.000
AMADEUS IT HOLDING SA-A	8,700	18.375	159,862.500
GAS NATURAL SDG SA	9,100	13.250	120,575.000
MAPFRE SA	21,450	2.250	48,262.500
CAIXABANK	24,750	2.620	64,845.000
ZARDOYA OTIS SA	3,700	10.860	40,182.000
INTL CONSOLIDATED AIRLINE	31,300	2.221	69,517.300
ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	3,876	17.375	67,345.500
ACCIONA SA	750	58.200	43,650.000
INDITEX	6,050	105.650	639,182.500
ENAGAS	5,650	16.265	91,897.250
RED ELECTRICA DE ESPANA	3,050	37.010	112,880.500
FERROVIAL SA	9,800	10.705	104,909.000
DISTRIBUIDORA INTERNACION	18,700	4.642	86,805.400
BANKIA SA	22,200	0.690	15,318.000
UPM-KYMMENE OYJ	15,050	8.950	134,697.500
NOKIA OYJ	101,250	2.968	300,510.000
WARTSILA OYJ	4,700	32.450	152,515.000
STORA ENSO OYJ-R SHS	17,750	5.260	93,365.000
METSO OYJ	3,750	31.090	116,587.500
ELISA OYJ-A SHARES	4,550	16.600	75,530.000
SAMPO OYJ-A SHS	11,150	24.380	271,837.000
FORTUM OYJ	12,150	14.350	174,352.500
KESKO OYJ-B SHS	1,950	24.790	48,340.500
KONE OYJ-B	4,250	57.050	242,462.500
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,800	32.030	121,714.000
NESTE OIL OYJ	4,300	9.595	41,258.500
POHJOLA BANK PLC	4,800	11.290	54,192.000
VERBUND AG	2,100	18.650	39,165.000
IMMOFINANZ AG	31,200	3.310	103,272.000
OMV AG	4,850	27.430	133,035.500
ERSTE GROUP BANK AG	6,550	23.225	152,123.750
TELEKOM AUSTRIA AG	11,000	5.498	60,478.000
VOESTALPINE AG	2,850	26.715	76,137.750
RAIFFEISEN BANK INTERNATI	1,900	31.150	59,185.000
VIENNA INSURANCE GROUP	1,000	38.720	38,720.000
JERONIMO MARTINS	6,000	14.895	89,370.000

	PORTUGAL TELECOM SGPS SA	20,300	3.786	76,855.800
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	57,950	2.270	131,546.500
	GALP ENERGIA SGPS SA-B	7,450	11.730	87,388.500
	ELAN CORPORATION PLC	14,200	7.704	109,396.800
	KERRY GROUP PLC-A	4,600	40.600	186,760.000
	CRH PLC	20,400	14.310	291,924.000
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	52,300	0.857	44,821.100
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLI	4,800	16.500	79,200.000
	OPAP SA	6,100	5.500	33,550.000
ユーロ 小計				ユーロ 63,973,590.820 (7,063,324,163)
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	37,500	66.000	2,475,000.000
	GALAXY ENTERTAINMENT	53,000	29.300	1,552,900.000
	MTR CORP	42,500	30.600	1,300,500.000
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	45,000	116.600	5,247,000.000
	HOPEWELL HOLDINGS	21,000	31.200	655,200.000
	SINO LAND	88,000	14.000	1,232,000.000
	CHEUNG KONG	40,000	119.300	4,772,000.000
	WHARF HOLDINGS	43,000	59.050	2,539,150.000
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	20,000	93.550	1,871,000.000
	CLP HOLDINGS LIMITED	52,500	64.800	3,402,000.000
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	13.980	573,180.000
	HUTCHISON WHAMPOA	61,300	80.100	4,910,130.000
	HENDERSON LAND DEVELOPMNT	26,000	55.700	1,448,200.000
	HK & CHINA GAS	151,284	20.900	3,161,835.600
	HANG SENG BANK	22,400	118.100	2,645,440.000
	WHEELLOCK & CO	25,000	38.400	960,000.000
	NEW WORLD DEVELOPMENT	115,000	12.220	1,405,300.000
	WING HANG BANK LIMITED	6,000	79.000	474,000.000
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,500	49.800	323,700.000
	HONG KONG EX & CL	28,900	130.600	3,774,340.000
	LI & FUNG LTD	164,000	13.620	2,233,680.000
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	63,000	30.050	1,893,150.000
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	87.100	566,150.000
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	25.850	542,850.000
	NWS HOLDINGS LTD	46,500	12.600	585,900.000
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	40.300	906,750.000
	BANK OF EAST ASIA	37,040	29.450	1,090,828.000
	SJM HOLDINGS LTD	57,000	17.780	1,013,460.000
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTUR	15,000	46.850	702,750.000
	AIA GROUP LTD	301,000	31.650	9,526,650.000
	SANDS CHINA LTD	68,000	33.900	2,305,200.000
	SHANGRI-LA ASIA	42,000	15.160	636,720.000
	BANK OF CHINA HONG KONG	106,500	24.350	2,593,275.000
	WYNN MACAU LTD	46,000	21.200	975,200.000
香港・ドル 小計				香港・ドル 70,295,438.600 (760,596,646)
合計				51,613,745,366 [51,613,745,366]

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,547	339,234.930
	SIMON PROPERTY GROUP INC	8,187	1,272,832.890
	BOSTON PROPERTIES INC	4,000	419,360.000
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	12,200	242,292.000
	VORNADO REALTY TRUST	4,527	353,875.590
	EQUITY RESIDENTIAL	8,000	445,840.000
	AMERICAN TOWER CORP	10,800	830,520.000
	HOST HOTELS&RESORTS INC	19,493	298,632.760
	KIMCO REALTY CORP	11,700	225,693.000
	PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	4,500	195,660.000
	RAYONIER INC	3,300	164,010.000
	VENTAS INC	8,100	513,378.000
	AMERICAN CAPITAL AGENCY	7,900	244,505.000
	PROLOGIS INC	12,262	432,112.880
	DUKE REALTY CORP	8,000	109,120.000
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,700	176,426.000
	HEALTH CARE REIT INC	7,100	415,563.000
	HCP INC	11,200	494,368.000
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	115,005.000
	MACERICH CO/THE	3,700	213,009.000
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	27,000	383,130.000
	PUBLIC STORAGE	3,900	555,360.000
	REGENCY CENTERS CORP	2,700	124,308.000
	SL GREEN REALTY CORP	2,200	168,124.000
	UDR INC	6,500	148,980.000
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,100	203,732.000
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 9,085,072.050 (761,964,992)
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド
	LAND SECURITIES PLC	21,700	175,553.000
	SEGRO PLC	25,350	61,448.400
	HAMMERSON PLC	20,400	98,654.400
	BRITISH LAND CO PLC	24,600	137,514.000
	CAPITAL SHOPPING CENTRES	15,900	56,619.900
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 529,789.700 (71,987,825)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	WESTFIELD RETAIL TRUST	81,396	243,374.040
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	65,500	128,052.500
	DEXUS PROPERTY GROUP	143,700	148,729.500
	GPT GROUP	35,960	129,815.600
	MIRVAC GROUP	93,400	141,034.000
	STOCKLAND	69,500	239,775.000
	WESTFIELD GROUP	58,196	621,533.280
	GOODMAN GROUP	47,100	209,595.000
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,861,908.920 (164,778,940)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	CAPITAMALL TRUST	79,000	164,320.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 164,320.000

			(11,301,929)
ユーロ			ユーロ
	CORIO NV	2,024	70,030.400
	ICADE	800	55,792.000
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,450	441,122.500
	GECINA SA	650	56,179.500
	KLEPIERRE	3,200	93,824.000
	FONCIERE DES REGIONS	950	59,764.500
ユーロ 小計			ユーロ 776,712.900 (85,756,871)
香港・ドル			香港・ドル
	LINK REIT	60,000	2,409,000.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 2,409,000.000 (26,065,380)
投資証券 合計			1,121,855,937 [1,121,855,937]
合計			1,121,855,937 [1,121,855,937]

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 563銘柄 投資証券 26銘柄	97.5%	2.5%	56.9%
イギリス・ポンド	株式 99銘柄 投資証券 5銘柄	98.7%	1.3%	10.7%
イスラエル・シケル	株式 7銘柄	100%	-%	0.3%
オーストラリア・ドル	株式 54銘柄 投資証券 8銘柄	92.6%	7.4%	4.2%
カナダ・ドル	株式 93銘柄	100%	-%	5.4%
シンガポール・ドル	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	97.5%	2.5%	0.9%
スイス・フラン	株式 32銘柄	100%	-%	4.1%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	100%	-%	1.5%
デンマーク・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	0.5%
ニュージーランド・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	0.0%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	100%	-%	0.4%
ユーロ	株式 217銘柄 投資証券 6銘柄	98.8%	1.2%	13.6%
香港・ドル	株式 34銘柄 投資証券 1銘柄	96.7%	3.3%	1.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	177,659,220	1,238,107,617
投資証券	17,987,548,910	54,153,182,670
未収配当金	143,419,843	326,119,044
流動資産合計	18,308,627,973	55,717,409,331
資産合計	18,308,627,973	55,717,409,331
負債の部		
流動負債		
未払金	1,362,794	1,060,828,470
未払解約金	70,000,000	2,300,000
流動負債合計	71,362,794	1,063,128,470
負債合計	71,362,794	1,063,128,470
純資産の部		
元本等		
元本	1 19,205,025,479	42,668,886,025
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 967,760,300	11,985,394,836
元本等合計	18,237,265,179	54,654,280,861
純資産合計	18,237,265,179	54,654,280,861
負債純資産合計	18,308,627,973	55,717,409,331

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23年12月20日 至 平成24年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（追加情報）

自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
----	---------------	---------------

1.	1 期首	平成22年12月21日	平成23年12月20日
	期首元本額	21,026,889,156円	19,205,025,479円
	期中追加設定元本額	1,361,133,030円	25,555,648,236円
	期中一部解約元本額	3,182,996,707円	2,091,787,690円
	期末元本額の内訳		
	ファンド名		
	ダイワJ - REITオープン	5,969,259,752円	6,449,948,969円
	ダイワJ - REITオープン (毎月分配型)	12,437,640,997円	35,303,663,988円
	DC・ダイワJ - REITオープン	794,238,705円	910,680,229円
	DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	2,134,627円	2,070,438円
	DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	1,648,624円	2,340,121円
	DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	102,774円	182,280円
	計	19,205,025,479円	42,668,886,025円
2.	期末日における受益権の総数	19,205,025,479口	42,668,886,025口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は967,760,300円であります。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資証券	2,122,265,038	3,547,436,380
合計	2,122,265,038	3,547,436,380

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成23年9月16日から平成23年12月19日まで、及び平成24年9月19日から平成24年12月18日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成23年12月19日現在	平成24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)	0.9496円 (9,496円)	1.2809円 (12,809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	2,545	1,471,010,000	
	MIDリート投資法人	2,400	495,600,000	
	森ヒルズリート	3,026	1,346,570,000	
	野村不レジデンシャル	1,973	895,742,000	
	産業ファンド	1,838	1,194,700,000	
	アドバンス・レジデンス	14,377	2,477,157,100	
	ケネディクスレジデンシャル	986	173,240,200	
	API投資法人	2,683	1,392,477,000	
	日本ビルファンド	8,012	6,986,464,000	
	ジャパンリアルエステイト	7,766	6,282,694,000	
	日本リテールファンド	27,175	4,103,425,000	
	オリックス不動産投資	3,718	1,535,534,000	
	日本プライムリアルティ	10,783	2,642,913,300	
	プレミア投資法人	2,571	776,442,000	
	東急リアル・エステート	2,214	996,300,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,266	638,064,000	
	野村不動産オフィスF	3,988	1,936,174,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	27,492	2,586,997,200	
	森トラスト総合リート	3,163	2,172,981,000	
	インヴィンシブル投資法人	16,406	101,225,020	
フロンティア不動産投資	2,973	2,235,696,000		
平和不動産リート	10,278	568,373,400		

日本ロジスティクスファンド投資法人	1,934	1,406,018,000	
福岡リート投資法人	1,608	990,528,000	
ケネディクス不動産投資法人	3,745	1,072,942,500	
積水ハウス・S I 投資法人	1,792	680,960,000	
いちご不動産投資法人	11,016	514,998,000	
大和証券オフィス投資法人	3,499	955,576,900	
阪急リート投資法人	1,116	449,190,000	
スタートアップリート投資法人	1,411	174,117,400	
トップリート投資法人	2,026	734,425,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	2,098	1,376,288,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	27,595	665,315,450	
日本賃貸住宅投資法人	17,394	918,403,200	
ジャパンエクセレント投資法人	2,466	1,204,641,000	
投資証券 合計		54,153,182,670	
合計		54,153,182,670	

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23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	4,230,748	4,718,835
コール・ローン	4,287,612	4,249,606
投資証券	476,896,312	593,275,591
未収入金	412,106	2,420
未収配当金	1,218,354	1,361,468
流動資産合計	487,045,132	603,607,920
資産合計	487,045,132	603,607,920
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	1 554,892,740	512,564,161
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 67,847,608	91,043,759
元本等合計	487,045,132	603,607,920
純資産合計	487,045,132	603,607,920
負債純資産合計	487,045,132	603,607,920

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23年12月20日 至 平成24年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として期末日の対顧客先物売買取引において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>

3. 収益及び費用の計上基準	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。

（追加情報）

自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	平成22年12月21日 574,332,197円 144,942,314円 164,381,771円	平成23年12月20日 554,892,740円 164,647,283円 206,975,862円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	176,575,383円	39,114,697円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	374,085,265円	468,426,083円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	2,329,216円	2,311,194円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	1,808,284円	2,541,542円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	94,592円	170,645円
計	554,892,740円	512,564,161円
2. 期末日における受益権の総数	554,892,740口	512,564,161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67,847,608円であります。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	14,393,032	7,513,745
合計	14,393,032	7,513,745

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成23年12月1日から平成23年12月19日まで、及び平成24年12月1日から平成24年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成23年12月19日現在	平成24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)	0.8777円 (8,777円)	1.1776円 (11,776円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	600	13,140.000	
		EXCEL TRUST INC	400	5,028.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,000	133,190.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,147	489,264.090	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,600	167,744.000	
		BIOMED REALTY TRUST INC	1,600	30,400.000	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	1,555	40,103.450	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	4,677	92,885.220	
		VORNADO REALTY TRUST	1,764	137,891.880	
		ROUSE PROPERTIES	261	4,204.710	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,100	172,763.000	
		EPR PROPERTIES	500	22,815.000	
		AMERICAN REALTY CAPITAL	1,800	21,114.000	
		CHATHAM LODGING TRUST	200	2,942.000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	400	7,980.000	
		RETAIL OPPORTUNITY INVEST	600	7,746.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	7,600	116,432.000	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY	700	16,681.000	
		CORESITE REALTY CORP	200	5,230.000	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES	200	4,026.000	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES	400	4,756.000	
		RLJ LODGING TRUST	1,100	20,669.000	
		KIMCO REALTY CORP	4,200	81,018.000	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERI	600	6,012.000	
		WHITESTONE REIT	200	2,732.000	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TR	1,800	31,968.000	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES	300	2,631.000	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	300	18,510.000	
		SELECT INCOME REIT	100	2,423.000	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	400	10,720.000	
		STAG INDUSTRIAL INC	200	3,586.000	
		VENTAS INC	3,079	195,147.020	
		GOVERNMENT PROP INCOME	400	9,216.000	
		SABRA HEALTH CARE REIT	400	8,572.000	
		UMH PROPERTIES	200	2,002.000	
		TERRENO REALTY CORP	100	1,540.000	
		AMERICAN REALTY CAP PROP	100	1,274.000	
		SUN COMMUNITIES INC	300	11,637.000	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY	500	7,665.000	
		ACADIA REALTY TRUST	511	12,836.320	
		PROLOGIS INC	4,746	167,249.040	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ	700	48,832.000	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	1,500	17,700.000	
		SAUL CENTERS INC	100	4,267.000	
		BRE PROPERTIES-CL A	800	38,976.000	
		CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	1,645	35,104.300	

MACK-CALI REALTY CORP	900	23,085.000
COLONIAL PROPERTIES TRUST	900	18,549.000
CAMDEN PROPERTY TRUST	900	60,003.000
COUSINS PROPERTIES INC	958	7,884.340
DDR CORP	2,456	37,846.960
DUKE REALTY CORP	2,900	39,556.000
EASTGROUP PROPERTIES INC	300	15,732.000
EQUITY ONE INC	600	12,546.000
ESSEX PROPERTY TRUST INC	400	57,456.000
FELCOR LODGING TRUST INC	1,400	5,880.000
FIRST INDUSTRIAL REALTY	1,000	13,690.000
FEDERAL REALTY INVS TRUST	700	72,646.000
GLIMCHER REALTY TRUST	1,500	15,945.000
GETTY REALTY CORP	300	5,271.000
HEALTH CARE REIT INC	2,700	158,031.000
HCP INC	4,600	203,044.000
HIGHWOODS PROPERTIES INC	800	26,032.000
HOME PROPERTIES INC	500	29,890.000
HOSPITALITY PROPERTIES	1,300	29,601.000
HEALTHCARE REALTY TRUST	900	20,997.000
COMMONWEALTH REIT	875	13,825.000
KILROY REALTY CORP	800	36,800.000
LASALLE HOTEL PROPERTIES	900	21,834.000
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,200	41,820.000
LTC PROPERTIES INC	300	9,954.000
LEXINGTON REALTY TRUST	1,400	13,902.000
MID-AMERICA APARTMENT COM	400	25,292.000
MACERICH CO/THE	1,400	80,598.000
EQUITY LIFESTYLE PROPERTI	400	26,644.000
MPG OFFICE TRUST INC	500	1,420.000
MISSION WEST PROPERTIES	200	1,806.000
NATL HEALTHINVESTORS INC	300	16,965.000
NATIONAL RETAIL PROPERTIE	1,100	33,715.000
REALTY INCOME CORP	1,400	57,106.000
CORPORATE OFFICE PROPERTI	800	19,784.000
PENN REAL ESTATE INVEST	600	10,446.000
PARKWAY PROPERTIES INC	300	4,083.000
POST PROPERTIES INC	600	29,142.000
PUBLIC STORAGE	1,500	213,600.000
PS BUSINESS PARKS INC/CA	200	12,896.000
REGENCY CENTERS CORP	900	41,436.000
RAMCO-GERSHENSON PROPERTI	400	5,276.000
TANGER FACTORY OUTLET CEN	1,000	33,550.000
SL GREEN REALTY CORP	900	68,778.000
SENIOR HOUSING PROP TRUST	1,800	41,094.000
TAUBMAN CENTERS INC	600	45,852.000
URSTADT BIDDLE-CL A	300	5,691.000
UDR INC	2,600	59,592.000
UNIVERSAL HEALTH RLTY INC	100	4,891.000
WASHINGTON REAL ESTATE IN	700	18,256.000
WEINGARTEN REALTY INVESTO	1,200	32,244.000
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	700	6,867.000
AGREE REALTY CORP	100	2,592.000
OMEGA HEALTHCARE INVESTOR	1,100	25,091.000
INLAND REAL ESTATE CORP	800	6,648.000
STRATEGIC HOTELS&RESORTS	2,000	12,520.000
CUBESMART	1,200	17,064.000

	SUNSTONE HOTEL INVESTORS	1,347	13,658.580
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,300	85,436.000
	CEDAR REALTY TRUST	700	3,787.000
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,000	35,480.000
	FIRST POTOMAC REALTY TRUS	600	7,170.000
	WINTHROP REALTY TRUST	300	3,270.000
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,800	8,424.000
	INVESTORS REAL ESTATE TRU	1,000	8,760.000
	KITE REALTY GROUP TRUST	800	4,208.000
	MONMOUTH REIT-CLASS A	400	3,944.000
	ONE LIBERTY PROPERTIES IN	100	2,025.000
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITI	1,000	45,500.000
	EDUCATION REALTY TRUST	1,200	12,456.000
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	100	1,782.000
	DIAMONDROCK HOSPITALITY	1,942	17,206.120
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	1,400	16,184.000
	CAPLEASE INC	700	3,752.000
	FRANKLIN STREET PROPERTIE	800	9,736.000
	DOUGLAS EMMETT	1,400	32,116.000
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	2,700	17,226.000
	RETAIL PROPERTIES OF AME-	300	3,582.000
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 4,527,085.030 (379,686,621)
イギリス・ボンド			イギリス・ボンド
	LAND SECURITIES PLC	8,150	65,933.500
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	7,200	5,508.000
	SEGRO PLC	8,000	19,392.000
	HAMMERSON PLC	7,600	36,753.600
	BRITISH LAND CO PLC	9,300	51,987.000
	GREAT PORTLAND ESTATES PL	3,250	15,808.000
	CAPITAL SHOPPING CENTRES	6,450	22,968.450
	DERWENT LONDON PLC	900	18,981.000
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	730	2,525.800
	WORKSPACE GROUP PLC	1,270	3,973.830
	SHAFTESBURY PLC	2,600	14,417.000
	BIG YELLOW GROUP PLC	1,200	4,104.000
	LONDON & STAMFORD PROPERT	5,800	6,229.200
	METRIC PROPERTY INVESTMEN	2,700	2,646.000
イギリス・ボンド 小計			イギリス・ボンド 271,227.380 (36,854,376)
イスラエル・シュケル			イスラエル・シュケル
	REIT 1 LTD	900	6,164.100
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 6,164.100 (136,781)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	CROMWELL PROPERTY GROUP	10,050	8,442.000
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	2,400	8,088.000
	WESTFIELD RETAIL TRUST	29,400	87,906.000
	BWP TRUST	4,500	9,765.000
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	24,600	48,093.000
	COMMONWEALTH PROPERTY OFF	24,600	25,953.000

	DEXUS PROPERTY GROUP	51,700	53,509.500
	GPT GROUP	16,900	61,009.000
	INVESTA OFFICE FUND	6,825	20,611.500
	CHARTER HALL RETAIL REIT	3,000	11,670.000
	MIRVAC GROUP	35,400	53,454.000
	STOCKLAND	23,300	80,385.000
	WESTFIELD GROUP	21,600	230,688.000
	ABACUS PROPERTY GROUP	3,300	7,128.000
	GOODMAN GROUP	14,840	66,038.000
	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	15,100	34,428.000
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROU	500	1,525.000
	CHARTER HALL GROUP	2,350	7,919.500
	ALE PROPERTY GROUP	2,000	4,680.000
	ASPEN GROUP	7,000	1,575.000
	CHALLENGER DIVERSIFIED PR	1,164	2,851.800
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 825,719.300 (73,076,158)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	ARTIS REAL ESTATE INVESTM	500	7,860.000
	DUNDEE INTERNATIONAL REIT	300	3,252.000
	NORTHWEST HEALTHCARE PROP	100	1,249.000
	BROOKFIELD CANADA OFFICE	200	5,902.000
	RETROCOM MID-MARKET REIT	200	1,104.000
	INTERRENT REAL ESTATE INV	200	1,050.000
	CALLOWAY REAL ESTATE INVE	600	17,184.000
	CAN APARTMENT PROP REAL	500	12,240.000
	CAN REAL ESTATE INVEST TR	300	13,104.000
	CHARTWELL SENIORS HOUSING	1,000	10,560.000
	COMINAR REAL ESTATE INV-T	590	13,263.200
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-	1,000	23,950.000
	INNVEST REAL ESTATE INVES	500	2,055.000
	MORGUARD REAL ESTATE-TR U	300	5,346.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVST	1,500	41,100.000
	DUNDEE REAL ESTATE INVEST	500	18,670.000
	BOARDWALK REAL ESTATE INV	300	19,218.000
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA	400	10,696.000
	NORTHERN PROPERTY REAL ES	200	6,170.000
	CROMBIE REAL ESTATE INVES	200	2,940.000
	ALLIED PROPERTIES REAL ES	300	9,780.000
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 226,693.200 (19,332,396)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	FIRST REAL ESTATE INVT TR	6,000	6,240.000
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRI	4,400	6,402.000
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	21,000	34,440.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	19,000	45,220.000
	CAPITAMALL TRUST	26,000	54,080.000
	SUNTEC REIT	22,000	35,750.000
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	14,000	15,680.000
	K-REIT ASIA	7,400	9,398.000
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	4,960	6,150.400
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	7,000	9,135.000
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUS	11,779	7,774.140
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	7,000	13,440.000

	FRASERS CENTREPOINT TRUST	5,000	9,750.000
	STARHILL GLOBAL REIT	15,000	11,550.000
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	4,000	6,360.000
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	4,000	8,640.000
	LIPPO MALLS INDONESIA RET	14,000	6,580.000
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUS	11,880	15,741.000
	CACHE LOGISTICS TRUST	6,000	7,260.000
	MAPLETREE COMMERCIAL TR	12,000	14,340.000
	FAR EAST HOSPITALITY TRUS	7,000	7,070.000
	SABANA SHARIAH COMP IND R	6,000	6,720.000
	ASCENDAS HOSPITALITY TRST	5,000	4,600.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 342,320.540 (23,544,806)
ニュージーランド ・ドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	3,000	4,830.000
	KIWI INCOME PROPERTY TRU	10,000	11,450.000
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY	3,500	4,340.000
	GOODMAN PROPERTY TRUST	9,500	9,500.000
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 30,120.000 (2,133,701)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT	650	6,035.250
	HAMBORNER REIT AG	400	3,020.000
	WERELDHAVE NV	250	11,863.750
	CORIO NV	1,015	35,119.000
	EUROCOMMERCIAL -CVA	350	10,571.750
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS	624	3,812.640
	VASTNED RETAIL NV	200	6,579.000
	ICADE	250	17,435.000
	ANF IMMOBILIER	150	4,114.500
	ALTAREA	20	2,290.000
	UNIBAIL-RODAMCO SE	950	171,047.500
	GECINA SA	250	21,607.500
	KLEPIERRE	1,000	29,320.000
	FONCIERE DES REGIONS	400	25,164.000
	SILIC	100	8,520.000
	STE DE LA TOUR EIFFEL	50	2,244.000
	MERCIALYS	550	9,237.250
	AEDIFICA	100	4,274.000
	COFINIMMO	150	13,162.500
	BEFIMMO S.C.A	150	7,403.250
WAREHOUSES DE PAUW SCA	133	5,943.770	
BENI STABILI SPA	10,100	4,353.100	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRI	1,800	1,386.000	
ユーロ 小計			ユーロ 404,503.760 (44,661,260)
香港・ドル	YUEXIU REIT ASSET MANAGEM	9,000	32,940.000
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVE	14,000	46,900.000
	FORTUNE REIT	13,000	82,940.000
	PROSPERITY REIT	13,000	30,160.000
	LINK REIT	24,000	963,600.000
	REGAL REAL ESTATE INV	8,000	17,600.000

	CHAMPION REIT	29,000	105,850.000
	香港・ドル 小計		香港・ドル 1,279,990.000 (13,849,492)
投資証券 合計			593,275,591 [593,275,591]
合計			593,275,591 [593,275,591]

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 124銘柄	100%	64.0%
イギリス・ポンド	投資証券 14銘柄	100%	6.2%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	100%	0.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 21銘柄	100%	12.3%
カナダ・ドル	投資証券 21銘柄	100%	3.3%
シンガポール・ドル	投資証券 23銘柄	100%	4.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券 4銘柄	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 23銘柄	100%	7.5%
香港・ドル	投資証券 7銘柄	100%	2.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	57,462,319	61,385,036
国債証券	7,423,993,600	9,285,473,460
地方債証券	1,056,055,443	1,256,203,804
特殊債券	1,359,843,757	1,186,483,343
社債券	1,645,633,070	1,435,651,138
未収利息	48,866,359	52,830,941
前払費用	3,615,898	2,604,830
流動資産合計	11,595,470,446	13,280,632,552
資産合計	11,595,470,446	13,280,632,552
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	10,612,000
流動負債合計	-	10,612,000
負債合計	-	10,612,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,296,043,254	11,560,180,230
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,299,427,192	1,709,840,322
元本等合計	11,595,470,446	13,270,020,552
純資産合計	11,595,470,446	13,270,020,552
負債純資産合計	11,595,470,446	13,280,632,552

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23年12月20日 至 平成24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。

（追加情報）

自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
----	---------------	---------------

	平成22年12月21日	平成23年12月20日
1. 1 期首		
期首元本額	10,613,829,095円	10,296,043,254円
期中追加設定元本額	2,148,257,758円	2,549,014,275円
期中一部解約元本額	2,466,043,599円	1,284,877,299円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・ライフ・バランス30	2,340,902,165円	2,824,598,123円
ダイワ・ライフ・バランス50	474,405,764円	1,004,914,241円
ダイワ・ライフ・バランス70	122,814,940円	246,466,815円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽/安定コース）	193,871,212円	258,354,186円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽/6分散コース）	123,148,571円	165,011,146円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽/成長コース）	27,098,910円	38,091,598円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	12,717,017円	17,241,701円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	3,824,343円	7,351,171円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	73,716円	170,188円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	3,765,413,977円	3,755,037,683円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	330,890,183円	333,120,994円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	944,368,105円	923,637,821円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	1,956,514,351円	1,986,184,563円
計	10,296,043,254円	11,560,180,230円
2. 期末日における受益権の総数	10,296,043,254口	11,560,180,230口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	54,916,300	28,101,780
地方債証券	1,620,589	1,428,252
特殊債証券	2,104,627	1,106,887
社債証券	654,744	848,052
合計	57,986,772	31,484,971

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成23年12月1日から平成23年12月19日まで、及び平成24年12月1日から平成24年12月18日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1262円 (11,262円)	1.1479円 (11,479円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 1 4 2年国債	25,000,000	25,001,500	
	3 1 5 2年国債	5,000,000	5,000,300	
	3 1 6 2年国債	20,000,000	20,001,200	
	3 1 7 2年国債	85,000,000	85,005,950	
	3 1 8 2年国債	60,000,000	60,004,200	
	3 1 9 2年国債	30,000,000	30,002,400	
	3 2 0 2年国債	25,000,000	25,002,000	
	3 2 1 2年国債	15,000,000	15,001,350	
	3 2 2 2年国債	180,000,000	180,016,200	
	8 2 5年国債	96,000,000	96,961,920	

8 5	5年国債	10,000,000	10,105,700
8 6	5年国債	119,000,000	120,049,580
8 7	5年国債	123,000,000	123,993,840
8 8	5年国債	73,000,000	73,662,110
8 9	5年国債	125,000,000	125,950,000
9 1	5年国債	53,000,000	53,443,080
9 2	5年国債	130,000,000	130,730,600
9 3	5年国債	3,000,000	3,036,330
9 4	5年国債	52,000,000	52,785,200
9 5	5年国債	90,000,000	91,440,900
9 6	5年国債	56,000,000	56,715,680
9 7	5年国債	35,000,000	35,347,550
9 8	5年国債	83,000,000	83,534,520
9 9	5年国債	38,000,000	38,382,660
1 0 1	5年国債	110,000,000	111,115,400
1 0 2	5年国債	37,000,000	37,227,920
1 0 3	5年国債	50,000,000	50,305,500
1 0 4	5年国債	40,000,000	40,067,200
1 0 5	5年国債	180,000,000	180,280,800
1 0 6	5年国債	197,000,000	197,185,180
1	40年国債	24,000,000	26,092,320
2	40年国債	23,000,000	23,791,430
3	40年国債	19,000,000	19,581,210
4	40年国債	30,000,000	30,766,800
5	40年国債	23,000,000	22,241,920
2 6 8	10年国債	10,000,000	10,314,900
2 6 9	10年国債	54,000,000	55,458,540
2 7 0	10年国債	8,000,000	8,240,240
2 7 2	10年国債	105,000,000	108,759,000
2 7 4	10年国債	11,000,000	11,462,330
2 7 5	10年国債	30,000,000	31,170,900
2 7 6	10年国債	25,000,000	26,125,500
2 7 7	10年国債	58,000,000	60,815,320
2 7 8	10年国債	20,000,000	21,100,200
2 7 9	10年国債	2,000,000	2,122,960
2 8 0	10年国債	3,000,000	3,187,140
2 8 6	10年国債	51,000,000	54,735,750
2 8 7	10年国債	116,000,000	125,014,360
2 8 8	10年国債	148,000,000	158,633,800
2 8 9	10年国債	57,000,000	60,712,980
2 9 0	10年国債	55,000,000	58,426,500
2 9 1	10年国債	39,000,000	41,227,290
2 9 2	10年国債	82,000,000	88,386,160
2 9 3	10年国債	9,000,000	9,772,470
2 9 4	10年国債	28,000,000	30,251,200
2 9 5	10年国債	45,000,000	48,116,250
2 9 6	10年国債	9,000,000	9,640,440
2 9 7	10年国債	16,000,000	17,062,400
2 9 8	10年国債	44,000,000	46,662,000
2 9 9	10年国債	122,000,000	129,479,820
3 0 0	10年国債	20,000,000	21,471,600
3 0 1	10年国債	50,000,000	53,721,500
3 0 2	10年国債	15,000,000	16,021,050
3 0 3	10年国債	59,000,000	63,043,860
3 0 4	10年国債	30,000,000	31,858,500
3 0 5	10年国債	72,000,000	76,464,000
3 0 6	10年国債	60,000,000	64,134,600

307	10年国債	93,000,000	98,754,840
308	10年国債	55,000,000	58,390,750
309	10年国債	125,000,000	130,846,250
310	10年国債	134,000,000	139,153,640
311	10年国債	31,000,000	31,717,340
312	10年国債	83,000,000	87,368,290
313	10年国債	99,000,000	104,898,420
314	10年国債	62,000,000	64,689,560
315	10年国債	67,000,000	70,392,880
316	10年国債	80,000,000	83,402,400
317	10年国債	38,000,000	39,546,600
318	10年国債	13,000,000	13,421,070
319	10年国債	94,000,000	97,679,160
320	10年国債	75,000,000	77,297,250
321	10年国債	100,000,000	102,873,000
322	10年国債	40,000,000	40,800,800
323	10年国債	49,000,000	49,872,690
324	10年国債	113,000,000	113,954,850
325	10年国債	170,000,000	171,004,700
2	30年国債	9,000,000	10,154,430
3	30年国債	4,000,000	4,444,880
4	30年国債	8,000,000	9,602,000
5	30年国債	8,000,000	8,707,440
6	30年国債	9,000,000	10,052,820
7	30年国債	12,000,000	13,185,600
8	30年国債	5,000,000	5,063,100
9	30年国債	11,000,000	10,383,450
10	30年国債	12,000,000	10,690,080
11	30年国債	12,000,000	11,891,520
12	30年国債	8,000,000	8,464,880
13	30年国債	13,000,000	13,519,740
14	30年国債	18,000,000	19,951,020
15	30年国債	18,000,000	20,251,080
16	30年国債	15,000,000	16,865,250
17	30年国債	15,000,000	16,588,200
18	30年国債	20,000,000	21,743,800
19	30年国債	14,000,000	15,230,600
20	30年国債	14,000,000	15,734,040
21	30年国債	15,000,000	16,299,450
22	30年国債	15,000,000	16,858,950
23	30年国債	18,000,000	20,230,920
24	30年国債	14,000,000	15,722,000
25	30年国債	19,000,000	20,609,300
26	30年国債	32,000,000	35,330,240
27	30年国債	28,000,000	31,463,600
28	30年国債	33,000,000	37,073,850
29	30年国債	42,000,000	46,311,720
30	30年国債	42,000,000	45,419,220
31	30年国債	41,000,000	43,450,980
32	30年国債	44,000,000	47,543,760
33	30年国債	54,000,000	54,831,600
34	30年国債	48,000,000	50,693,280
35	30年国債	54,000,000	54,597,780
36	30年国債	58,000,000	58,539,980
37	30年国債	24,000,000	23,640,480
30	利付国債20年	16,000,000	17,584,000
32	利付国債20年	8,000,000	8,931,280

3 3	利付国債 2 0 年	5,000,000	5,687,000
3 6	利付国債 2 0 年	33,000,000	37,400,880
3 7	利付国債 2 0 年	5,000,000	5,690,350
3 8	利付国債 2 0 年	11,000,000	12,430,990
3 9	2 0 年国債	32,000,000	35,996,800
4 0	2 0 年国債	51,000,000	56,959,350
4 1	2 0 年国債	40,000,000	42,969,200
4 2	2 0 年国債	13,000,000	14,846,910
4 3	2 0 年国債	14,000,000	16,359,700
4 4	2 0 年国債	24,000,000	27,510,480
4 5	2 0 年国債	20,000,000	22,792,800
4 6	2 0 年国債	19,000,000	21,413,570
4 7	2 0 年国債	23,000,000	25,976,430
4 8	2 0 年国債	9,000,000	10,389,060
4 9	2 0 年国債	4,000,000	4,494,720
5 0	2 0 年国債	30,000,000	33,236,100
5 1	2 0 年国債	25,000,000	27,932,500
5 2	2 0 年国債	19,000,000	21,387,920
5 3	2 0 年国債	13,000,000	14,652,560
5 4	2 0 年国債	14,000,000	15,899,100
5 5	2 0 年国債	41,000,000	45,849,070
5 6	2 0 年国債	12,000,000	13,413,240
5 7	2 0 年国債	24,000,000	26,600,400
5 8	2 0 年国債	35,000,000	38,798,200
5 9	2 0 年国債	28,000,000	30,516,920
6 0	2 0 年国債	12,000,000	12,731,400
6 1	2 0 年国債	25,000,000	25,509,750
6 2	2 0 年国債	12,000,000	11,982,480
6 3	2 0 年国債	27,000,000	29,657,880
6 4	2 0 年国債	24,000,000	26,600,160
6 5	2 0 年国債	27,000,000	29,896,830
6 6	2 0 年国債	6,000,000	6,579,960
6 7	2 0 年国債	10,000,000	11,060,800
6 8	2 0 年国債	25,000,000	28,449,750
6 9	2 0 年国債	22,000,000	24,810,060
7 0	2 0 年国債	16,000,000	18,558,720
7 1	2 0 年国債	23,000,000	26,183,660
7 2	2 0 年国債	38,000,000	42,822,960
7 3	2 0 年国債	10,000,000	11,149,000
7 4	2 0 年国債	27,000,000	30,410,100
7 5	2 0 年国債	14,000,000	15,757,560
7 6	2 0 年国債	25,000,000	27,560,000
7 7	2 0 年国債	9,000,000	10,025,640
7 8	2 0 年国債	17,000,000	18,710,200
7 9	2 0 年国債	12,000,000	13,347,960
8 0	2 0 年国債	16,000,000	17,985,280
8 1	2 0 年国債	10,000,000	11,105,700
8 2	2 0 年国債	34,000,000	38,164,660
8 3	2 0 年国債	33,000,000	36,984,420
8 4	2 0 年国債	21,000,000	23,281,860
8 5	2 0 年国債	36,000,000	40,278,600
8 6	2 0 年国債	6,000,000	6,860,160
8 7	2 0 年国債	14,000,000	15,835,400
8 8	2 0 年国債	29,000,000	33,109,590
8 9	2 0 年国債	23,000,000	25,973,440
9 0	2 0 年国債	40,000,000	45,093,600
9 1	2 0 年国債	13,000,000	14,818,960

9 2	2 0 年国債	51,000,000	56,773,710
9 3	2 0 年国債	3,000,000	3,295,980
9 4	2 0 年国債	61,000,000	67,761,850
9 5	2 0 年国債	32,000,000	36,324,480
9 6	2 0 年国債	20,000,000	22,168,200
9 7	2 0 年国債	16,000,000	17,926,400
9 8	2 0 年国債	39,000,000	43,182,360
9 9	2 0 年国債	50,000,000	55,263,500
1 0 0	2 0 年国債	32,000,000	35,755,520
1 0 1	2 0 年国債	19,000,000	21,742,270
1 0 2	2 0 年国債	27,000,000	30,870,990
1 0 3	2 0 年国債	18,000,000	20,321,820
1 0 4	2 0 年国債	14,000,000	15,424,780
1 0 5	2 0 年国債	42,000,000	46,151,280
1 0 6	2 0 年国債	16,000,000	17,812,640
1 0 7	2 0 年国債	38,000,000	41,667,760
1 0 8	2 0 年国債	22,000,000	23,499,300
1 0 9	2 0 年国債	25,000,000	26,619,250
1 1 0	2 0 年国債	30,000,000	32,823,000
1 1 1	2 0 年国債	14,000,000	15,480,360
1 1 2	2 0 年国債	58,000,000	63,271,620
1 1 3	2 0 年国債	72,000,000	78,359,760
1 1 4	2 0 年国債	51,000,000	55,331,940
1 1 5	2 0 年国債	19,000,000	20,900,570
1 1 6	2 0 年国債	20,000,000	21,963,400
1 1 7	2 0 年国債	53,000,000	57,396,350
1 1 8	2 0 年国債	18,000,000	19,180,980
1 1 9	2 0 年国債	30,000,000	31,053,600
1 2 0	2 0 年国債	31,000,000	31,127,410
1 2 1	2 0 年国債	60,000,000	62,835,600
1 2 2	2 0 年国債	10,000,000	10,319,200
1 2 3	2 0 年国債	50,000,000	53,794,500
1 2 4	2 0 年国債	30,000,000	31,810,200
1 2 5	2 0 年国債	27,000,000	29,412,450
1 2 6	2 0 年国債	19,000,000	20,101,620
1 2 7	2 0 年国債	20,000,000	20,847,400
1 2 8	2 0 年国債	28,000,000	29,115,800
1 2 9	2 0 年国債	39,000,000	39,942,240
1 3 0	2 0 年国債	41,000,000	41,880,680
1 3 1	2 0 年国債	25,000,000	25,125,000
1 3 2	2 0 年国債	30,000,000	30,086,400
1 3 3	2 0 年国債	37,000,000	37,720,760
1 3 4	2 0 年国債	23,000,000	23,401,350
1 3 5	2 0 年国債	20,000,000	20,014,400
1 3 6	2 0 年国債	23,000,000	22,649,940
1 3 7	2 0 年国債	20,000,000	19,970,600
1 3 8	2 0 年国債	26,000,000	25,109,760
1 3 9	2 0 年国債	27,000,000	26,526,690
1 4 0	2 0 年国債	78,000,000	77,712,180
国債証券 合計			9,285,473,460
地方債証券	6 2 4 東京都公債	100,000,000	103,415,700
	6 5 3 東京都公債	100,000,000	106,593,300
	2 0 - 6 北海道公債	100,000,000	107,768,800
	2 9 3 大阪府公債	100,000,000	106,957,300
	2 1 - 2 埼玉県公債	100,000,000	107,591,500
	1 2 共同発行地方	50,000,000	50,795,350

	1 4 共同発行地方	36,400,000	37,102,556
	2 0 共同発行地方	100,000,000	102,627,100
	2 7 共同発行地方	34,000,000	34,987,768
	3 0 共同発行地方	50,000,000	51,597,450
	7 6 共同発行地方	100,000,000	106,560,400
	2 1 - 6 大阪市公債	100,000,000	107,476,300
	1 2 - ゆ 名古屋市債	20,000,000	20,316,180
	1 8 - 4 札幌市公債	100,000,000	106,087,600
	1 8 - 2 北九州市債	100,000,000	106,326,500
地方債証券 合計			1,256,203,804
特殊債券	4 7 日本政策投資 B	100,000,000	101,690,700
	3 2 8 政保道路債	41,000,000	41,807,331
	3 3 3 政保道路債	21,000,000	21,572,880
	3 3 4 政保道路債	2,000,000	2,053,164
	2 7 政保道路機構	50,000,000	53,378,700
	5 6 政保道路機構	100,000,000	106,117,600
	1 2 2 政保道路機構	100,000,000	102,743,600
	8 4 2 政保公営企業	5,000,000	5,140,350
	2 政保地方公営機	100,000,000	107,576,400
	2 6 公営企業	100,000,000	106,673,200
	1 9 0 政保首都高速	3,000,000	3,046,812
	1 3 首都高速道路	100,000,000	102,825,900
	2 7 国際協力銀行	100,000,000	106,396,300
	1 4 政保国民生活	19,000,000	19,453,606
	2 成田国際空港	100,000,000	104,021,900
	い 7 1 5 利付商工債	100,000,000	100,988,500
い 7 2 8 利付農林債	100,000,000	100,996,400	
特殊債券 合計			1,186,483,343
社債券	3 3 中日本高速道	100,000,000	102,666,900
	2 サントリーホールディング	100,000,000	101,371,100
	7 小松製作所	100,000,000	101,361,000
	5 0 東芝	100,000,000	101,146,600
	1 明治安田 2 0 1 1 基	100,000,000	101,393,700
	9 トヨタ自動車	100,000,000	101,290,900
	6 ドン・キホーテ	100,000,000	101,153,100
	5 8 伊藤忠商事	100,000,000	101,030,300
	4 住友信託 劣後	100,000,000	102,854,800
	7 三井住友 B K 劣後	100,000,000	101,930,600
	1 4 0 オリックス	100,000,000	101,320,300
	3 1 三井不動産	100,000,000	102,438,900
	3 7 8 東北電力	100,000,000	110,664,200
	2 6 1 北海道電力	3,000,000	3,291,438
1 0 電源開発	100,000,000	101,737,300	
社債券 合計			1,435,651,138
合計			13,163,811,745

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23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	37,175,393	27,877,420
コール・ローン	884,066,405	537,111,026
国債証券	103,977,680,653	122,093,696,759
派生商品評価勘定	544,995	15,974,172
未収利息	1,195,050,742	1,263,041,161
前払費用	37,966,877	52,894,512
流動資産合計	106,132,485,065	123,990,595,050
資産合計	106,132,485,065	123,990,595,050
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,364,916	-
未払解約金	37,161,000	111,837,000
流動負債合計	46,525,916	111,837,000
負債合計	46,525,916	111,837,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 61,598,892,147	62,378,283,951
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	44,487,067,002	61,500,474,099
元本等合計	106,085,959,149	123,878,758,050
純資産合計	106,085,959,149	123,878,758,050
負債純資産合計	106,132,485,065	123,990,595,050

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23年12月20日 至 平成24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. デリバティブ取引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、原則として期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。

(追加情報)

自 平成23年12月20日
至 平成24年12月18日

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
1. 1 期首	平成22年12月21日	平成23年12月20日
期首元本額	59,018,260,058円	61,598,892,147円
期中追加設定元本額	7,363,810,077円	5,769,603,459円
期中一部解約元本額	4,783,177,988円	4,990,211,655円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV A	3,148,379,152円	2,974,807,305円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	100,208,533円	95,890,683円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	716,398,300円	654,002,925円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	219,022,709円	214,361,998円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	2,275,449,547円	2,082,860,310円
DCダイワ外国債券インデックス	28,200,447,353円	31,419,798,219円
ダイワ・ライフ・バランス30	421,260,981円	467,863,815円
ダイワ・ライフ・バランス50	77,987,625円	149,813,996円
ダイワ・ライフ・バランス70	39,979,195円	73,565,981円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	126,668,617円	152,702,210円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	80,431,958円	98,001,903円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	17,430,860円	22,671,186円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	5,452,209円	6,349,507円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	1,836,845円	3,242,282円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	40,519円	100,995円
ダイワ世界バランスファンド40VA	3,454,624,729円	3,130,953,524円

ダイワ世界バランスファンド60VA	361,405,640円	330,699,379円
ダイワ・バランスファンド35VA	12,763,721,808円	11,017,887,488円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	2,454,489,323円	2,175,325,799円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	1,913,718,330円	1,760,038,112円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	743,294,509円	647,231,776円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	4,407,803,202円	4,827,949,151円
ダイワライフスタイル25	24,680,560円	25,861,244円
ダイワライフスタイル50	35,087,572円	37,012,365円
ダイワライフスタイル75	9,072,071円	9,291,798円
計	61,598,892,147円	62,378,283,951円
2. 期末日における受益権の総数	61,598,892,147口	62,378,283,951口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	2,138,079,985	371,009,306
合計	2,138,079,985	371,009,306

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成23年12月1日から平成23年12月19日まで、及び平成24年12月1日から平成24年12月18日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成23年12月19日 現在				平成24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）	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	814,644,540	-	805,824,619	8,819,921	672,422,328	-	688,396,500	15,974,172
アメリカ・ドル	320,553,871	-	320,233,760	320,111	238,163,097	-	241,907,250	3,744,153
イギリス・ポンド	135,377,931	-	135,166,179	211,752	105,681,776	-	108,408,300	2,726,524
オーストラリア・ドル	11,259,247	-	11,277,040	17,793	24,384,296	-	25,088,560	704,264
カナダ・ドル	24,408,096	-	24,238,440	169,656	18,034,349	-	18,492,740	458,391
シンガポール・ドル	-	-	-	-	6,087,716	-	6,187,500	99,784
スイス・フラン	3,723,510	-	3,653,760	69,750	6,512,979	-	6,672,200	159,221
スウェーデン・クローナ	4,955,669	-	4,959,240	3,571	9,267,730	-	9,389,790	122,060
デンマーク・クローネ	6,940,370	-	6,784,050	156,320	12,146,285	-	12,476,400	330,115
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	3,927,420	-	4,028,400	100,980
ポーランド・ズロチ	5,790,762	-	5,710,210	80,552	11,427,768	-	11,785,890	358,122
メキシコ・ペソ	7,092,386	-	7,099,300	6,914	15,381,933	-	15,884,120	502,187
ユーロ	294,542,698	-	286,702,640	7,840,058	211,828,625	-	218,059,750	6,231,125
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	9,578,354	-	10,015,600	437,246
合計	814,644,540	-	805,824,619	8,819,921	672,422,328	-	688,396,500	15,974,172

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成23年12月19日現在	平成24年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7222円 (17,222円)	1.9859円 (19,859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	4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	アメリカ・ドル 2,868,000.000	アメリカ・ドル 2,994,249.360	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000	2,905,618.600	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	2,771,469.640	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,037,735.660	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	2,654,000.000	2,866,213.840	
		4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	4,047,059.520	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,331,634.320	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,046,848.160	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,061,371.400	
		5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,246,151.400	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,316,341.250	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,705,835.520	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,378,126.480	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,097,403.650	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,851,835.770	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,974,187.980	

3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	4,366,862.500	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,438,336.000	
4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,725,546.220	
3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	3,805,000.000	4,428,335.100	
2% U.S. TREASURY NOTE 20131130	2,466,000.000	2,509,056.360	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,139,000.000	3,182,161.250	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140131	2,450,000.000	2,492,777.000	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	3,161,000.000	3,495,591.850	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140228	3,716,000.000	3,790,431.480	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,195,000.000	2,350,691.350	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140331	2,341,000.000	2,387,070.880	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,463,000.000	2,620,385.700	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,386,000.000	3,462,185.000	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,001,000.000	2,146,992.960	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20190515	1,531,000.000	1,731,224.180	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	4,930,000.000	5,074,005.300	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160531	621,000.000	680,522.850	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140630	2,833,000.000	2,936,461.160	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160630	2,121,000.000	2,327,797.500	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140731	3,238,000.000	3,362,306.820	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160731	1,833,000.000	2,014,008.750	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20190815	3,116,000.000	3,625,497.160	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140831	3,958,000.000	4,100,369.260	
3% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,488,000.000	2,716,572.560	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140930	3,971,000.000	4,121,302.350	
3% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,499,000.000	2,731,506.960	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20141031	4,082,000.000	4,242,871.620	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,319,000.000	2,549,624.550	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20191115	4,020,000.000	4,615,442.400	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20141130	3,594,000.000	3,723,994.980	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20161130	4,149,000.000	4,507,473.600	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20141231	4,437,000.000	4,650,685.920	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20161231	4,011,000.000	4,443,746.790	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20150131	2,315,000.000	2,411,466.050	

3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170131	2,884,000.000	3,182,753.560	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20200215	5,630,000.000	6,570,773.000	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20150228	4,921,000.000	5,146,627.850	
3% U.S. TREASURY NOTE 20170228	2,687,000.000	2,955,700.000	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150331	5,843,000.000	6,139,240.100	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20170331	4,635,000.000	5,154,259.050	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150430	2,218,000.000	2,332,781.500	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170430	1,653,000.000	1,831,854.600	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20200515	5,259,000.000	6,102,859.140	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20150531	2,576,000.000	2,690,091.040	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20170531	2,835,000.000	3,099,222.000	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20150630	4,658,000.000	4,842,317.060	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20170630	3,468,000.000	3,755,705.280	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20150731	2,386,000.000	2,474,449.020	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20170731	1,773,000.000	1,910,744.370	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20200815	4,929,000.000	5,406,077.910	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150831	2,519,000.000	2,581,672.720	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170831	2,903,000.000	3,063,564.930	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150930	2,568,000.000	2,632,893.360	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170930	2,831,000.000	2,987,469.370	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20151031	1,265,000.000	1,297,257.500	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20171031	382,000.000	403,277.400	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20201115	4,509,000.000	4,939,789.860	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20151130	3,151,000.000	3,244,175.070	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20171130	883,000.000	948,598.070	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20131215	3,091,000.000	3,108,989.620	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20151231	2,515,000.000	2,647,716.550	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20171231	253,000.000	278,279.760	
1% U.S. TREASURY NOTE 20140115	2,967,000.000	2,993,050.260	
2% U.S. TREASURY NOTE 20160131	635,000.000	666,794.450	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20180131	255,000.000	278,913.900	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,528,000.000	2,558,689.920	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20210215	4,076,000.000	4,779,110.000	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,590,000.000	2,732,942.100	

2.75% U.S. TREASURY NOTE 20180228	1,234,000.000	1,358,942.500	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140315	2,588,000.000	2,621,540.480	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20160331	1,300,000.000	1,378,039.000	
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20180331	1,300,000.000	1,440,452.000	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140415	3,179,000.000	3,221,948.290	
2% U.S. TREASURY NOTE 20160430	260,000.000	273,650.000	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20180430	260,000.000	284,840.400	
1% U.S. TREASURY NOTE 20140515	3,661,000.000	3,700,612.020	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20210515	4,417,000.000	5,003,445.090	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20160531	3,832,000.000	4,002,638.960	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20180531	1,322,000.000	1,430,747.720	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20140615	4,416,000.000	4,450,135.680	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20160630	3,406,000.000	3,529,569.680	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20180630	3,782,000.000	4,094,431.020	
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20140715	4,093,000.000	4,117,926.370	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20160731	2,053,000.000	2,128,447.750	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20180731	1,341,000.000	1,442,620.980	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,097,000.000	2,105,912.250	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20210815	1,418,000.000	1,488,233.540	
1% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,108,000.000	2,147,272.040	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20180831	2,730,000.000	2,821,809.900	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140915	3,109,000.000	3,109,839.430	
1% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,793,000.000	2,844,586.710	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20180930	2,835,000.000	2,908,965.150	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20141015	2,784,000.000	2,796,611.520	
1% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,718,000.000	2,768,201.460	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20181031	1,920,000.000	2,010,144.000	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20141115	4,179,000.000	4,188,277.380	
2% U.S. TREASURY NOTE 20211115	1,353,000.000	1,402,140.960	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20131130	1,843,000.000	1,844,511.260	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20161130	3,027,000.000	3,067,652.610	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20181130	2,165,000.000	2,218,692.000	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20141215	4,827,000.000	4,826,806.920	
0.125% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,052,000.000	3,050,687.640	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20161231	4,265,000.000	4,319,464.050	

1.375% U.S. TREASURY NOTE 20181231	1,861,000.000	1,906,352.570	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150115	4,162,000.000	4,160,501.680	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140131	3,738,000.000	3,740,766.120	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20170131	2,970,000.000	3,006,293.400	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20190131	1,426,000.000	1,449,386.400	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150215	3,983,000.000	3,980,968.670	
2% U.S. TREASURY NOTE 20220215	3,224,000.000	3,330,037.360	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140228	4,760,000.000	4,762,951.200	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20170228	2,408,000.000	2,437,136.800	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20190228	1,843,000.000	1,884,172.620	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20150315	3,557,000.000	3,564,611.980	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140331	3,693,000.000	3,694,994.220	
1% U.S. TREASURY NOTE 20170331	3,856,000.000	3,920,433.760	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20190331	2,821,000.000	2,902,188.380	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20150415	3,410,000.000	3,416,513.100	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,658,000.000	3,659,280.300	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20170430	2,375,000.000	2,401,148.750	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20190430	559,000.000	566,071.350	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150515	2,261,000.000	2,258,083.310	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20220515	6,262,000.000	6,306,961.160	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	3,589,000.000	3,589,969.030	
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20170531	2,125,000.000	2,124,830.000	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20190531	2,385,000.000	2,394,301.500	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20150615	3,379,000.000	3,384,406.400	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140630	4,207,000.000	4,208,135.890	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20170630	3,906,000.000	3,923,694.180	
1% U.S. TREASURY NOTE 20190630	2,659,000.000	2,644,641.400	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150715	3,665,000.000	3,658,842.800	
0.125% U.S. TREASURY NOTE 20140731	4,077,000.000	4,069,498.320	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20170731	3,817,000.000	3,788,067.140	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20190731	2,784,000.000	2,742,434.880	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	4,788,000.000	4,778,040.960	
1.625% U.S. TREASURY NOTE 20220815	5,191,000.000	5,148,381.890	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140831	2,946,000.000	2,946,324.060	

0.625% U.S. TREASURY NOTE 20170831	2,211,000.000	2,205,472.500	
1% U.S. TREASURY NOTE 20190831	1,331,000.000	1,320,072.490	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150915	3,987,000.000	3,977,471.070	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140930	5,184,000.000	5,184,155.520	
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20170930	1,183,000.000	1,178,883.160	
1% U.S. TREASURY NOTE 20190930	2,215,000.000	2,194,666.300	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20151015	3,548,000.000	3,538,988.080	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20141031	5,156,000.000	5,156,154.680	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20171031	1,178,000.000	1,180,108.620	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20191031	147,000.000	147,871.710	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,473,000.000	1,474,090.020	
1.625% U.S. TREASURY NOTE 20221115	1,328,000.000	1,311,492.960	
11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,160,650.950	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,277,220.500	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	1,971,148.640	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,068,596.360	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,040,012.500	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,332,685.840	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,302,537.720	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,135,439.600	
8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,671,477.250	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	1,156,162.560	
7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,414,630.520	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,388,627.500	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,259,754.510	
6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,257,796.010	
6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,237,176.450	
6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	957,102.300	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	1,236,000.000	1,837,005.000	
5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	1,149,882.810	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,297,075.780	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	2,059,729.740	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	1,005,532.320	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	2,084,576.790	

	5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,324,000.000	1,890,724.960	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	2,992,881.830	
	4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	599,000.000	817,635.000	
	5% U.S. TREASURY BOND 20370515	547,000.000	772,292.890	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	1,370,000.000	1,778,205.200	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	1,242,000.000	1,642,346.280	
	3.5% U.S. TREASURY BOND 20390215	3,416,000.000	3,861,138.960	
	4.25% U.S. TREASURY BOND 20390515	2,709,000.000	3,457,361.250	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20390815	1,977,000.000	2,621,363.610	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20391115	2,786,000.000	3,625,923.280	
	4.625% U.S. TREASURY BOND 20400215	1,517,000.000	2,050,437.880	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20400515	2,169,000.000	2,823,929.550	
	3.875% U.S. TREASURY BOND 20400815	4,184,000.000	5,029,586.400	
	4.25% U.S. TREASURY BOND 20401115	3,269,000.000	4,174,839.900	
	4.75% U.S. TREASURY BOND 20410215	3,086,000.000	4,254,822.500	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20410515	3,356,000.000	4,374,042.600	
	3.75% U.S. TREASURY BOND 20410815	1,367,000.000	1,607,072.540	
	3.125% U.S. TREASURY BOND 20411115	4,039,000.000	4,228,307.930	
	3.125% U.S. TREASURY BOND 20420215	3,921,000.000	4,101,091.530	
	3% U.S. TREASURY BOND 20420515	4,432,000.000	4,516,828.480	
	2.75% U.S. TREASURY BOND 20420815	1,731,000.000	1,671,886.350	
	2.75% U.S. TREASURY BOND 20421115	1,930,000.000	1,860,790.200	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 598,572,003.500 (50,202,233,934)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	868,000.000	1,185,427.600	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	641,000.000	784,584.000	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1,343,000.000	2,032,899.100	
	6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	909,000.000	1,336,502.700	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,815,000.000	2,221,197.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	2,873,000.000	3,102,265.400	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	2,179,879.200	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,477,054.100	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,614,931.100	

	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	1,989,000.000	2,594,650.500	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	2,236,000.000	2,756,093.600	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	1,708,000.000	2,091,958.400	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	2,475,000.000	2,785,860.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	2,492,779.500	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,465,000.000	1,801,071.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	1,604,000.000	1,934,744.800	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	2,258,821.400	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,806,000.000	2,351,050.800	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	1,915,000.000	2,321,171.500	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	1,820,000.000	2,187,276.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20390907	1,178,000.000	1,422,081.600	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	1,201,000.000	1,433,633.700	
	2.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140307	2,218,000.000	2,269,235.800	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20340907	1,300,000.000	1,633,840.000	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190907	1,972,000.000	2,289,689.200	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20600122	1,011,000.000	1,188,127.200	
	2.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150122	2,529,000.000	2,653,679.700	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200907	2,316,000.000	2,699,992.800	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20401207	2,133,000.000	2,573,891.100	
	2% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160122	2,338,000.000	2,443,677.600	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210907	2,437,000.000	2,850,558.900	
	1.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170122	1,814,000.000	1,889,825.200	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20520722	665,000.000	731,899.000	
	1% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170907	1,563,000.000	1,572,378.000	
	1.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220907	365,000.000	360,693.000	
	3.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20440122	91,000.000	91,081.900	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 71,614,502.400 (9,730,978,586)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	1,385,000.000	1,492,656.050	
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	1,411,000.000	1,587,332.670	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	2,178,000.000	2,452,014.180	

	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,755,000.000	2,081,254.500	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20140615	1,215,000.000	1,276,940.700	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	1,928,000.000	2,100,324.640	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,475,000.000	1,771,017.750	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	1,050,000.000	1,078,024.500	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20160615	1,221,000.000	1,300,572.570	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20141021	1,385,000.000	1,428,101.200	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	1,441,000.000	1,615,778.890	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,073,000.000	1,273,211.070	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20151021	615,000.000	648,007.050	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170721	866,000.000	917,942.680	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	399,000.000	445,639.110	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	452,000.000	422,086.640	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	479,000.000	444,363.510	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 22,335,267.710 (1,976,671,192)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	372,000.000	656,762.280	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	946,000.000	1,632,304.080	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,910,606.100	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	2,126,410.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	2,112,000.000	2,229,025.920	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,119,056.120	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,563,000.000	2,300,267.100	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	571,000.000	622,898.190	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	1,747,000.000	1,944,393.530	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	2,018,000.000	2,313,798.440	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	2,083,000.000	2,362,205.320	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,608,000.000	1,650,981.840	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,224,000.000	1,625,361.840	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141201	1,657,000.000	1,683,777.120	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,476,000.000	1,667,142.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,394,000.000	1,438,398.900	

	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20151201	973,000.000	1,022,068.390	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,257,000.000	1,407,425.190	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	629,000.000	643,819.240	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140301	1,068,000.000	1,079,235.360	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160901	761,000.000	799,826.220	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140801	268,000.000	272,743.600	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,949,000.000	2,105,173.370	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	379,000.000	473,833.380	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140201	283,000.000	282,654.740	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170301	1,457,000.000	1,465,042.640	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150201	803,000.000	800,470.550	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140501	450,000.000	447,687.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150801	430,000.000	433,061.600	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170901	216,000.000	217,082.160	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141101	594,000.000	592,384.320	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	205,000.000	196,728.250	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160201	294,000.000	293,750.100	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180301	325,000.000	322,003.500	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 40,138,378.390 (3,423,000,908)	
シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	583,863.700	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	343,000.000	360,962.910	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	662,000.000	789,256.260	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	804,283.680	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	412,000.000	493,407.080	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	510,655.440	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20150701	759,000.000	808,585.470	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	434,000.000	479,296.580	
	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20141001	179,000.000	182,542.410	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	340,000.000	389,034.800	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	323,000.000	350,774.770	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	246,000.000	275,820.120	

	1.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20160401	548,000.000	563,108.360	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	117,000.000	126,741.420	
	0.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20140201	178,000.000	177,998.220	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	227,000.000	242,204.460	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 7,138,535.680 (490,988,485)	
スイス・フラン	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20140106	384,000.000	401,867.520	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	778,000.000	1,047,063.520	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	380,000.000	553,637.200	
	3.75% SWISS GOVERNMENT BOND 20150610	86,000.000	94,630.960	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	754,000.000	819,326.560	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	223,000.000	265,836.070	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	1,559,000.000	1,792,974.720	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	194,000.000	229,094.600	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	485,000.000	557,711.200	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 5,762,142.350 (526,544,568)	
スウェーデン・ク ローナ	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	7,275,000.000	7,871,113.500	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	6,885,000.000	7,548,920.550	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	4,340,000.000	5,521,782.000	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,705,000.000	5,054,346.250	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,828,654.250	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	9,440,000.000	11,183,284.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,940,000.000	6,163,687.400	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	6,260,000.000	7,351,243.200	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	1,970,000.000	1,950,615.200	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 58,473,647.150 (736,183,218)	
デンマーク・ク ローネ	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	5,600,000.000	9,087,960.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	8,732,000.000	9,767,353.240	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	9,491,000.000	11,215,040.150	

	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	12,250,000.000	18,465,650.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	10,522,721.430	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	943,000.000	1,094,709.840	
	2% DANISH GOVERNMENT BOND 20141115	5,534,000.000	5,757,407.580	
	2.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20161115	1,146,000.000	1,254,984.600	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 67,165,826.840 (994,054,237)	
ノルウェー・ク ローネ	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	6,089,000.000	6,593,534.540	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	4,760,000.000	5,312,731.200	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	4,210,000.000	4,908,860.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	3,718,000.000	4,235,545.600	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 21,050,671.340 (314,497,030)	
ポーランド・ズロ チ	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	3,221,000.000	3,474,492.700	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,670,820.300	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	4,466,000.000	4,843,287.680	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20140425	3,090,000.000	3,190,672.200	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	2,458,000.000	2,751,116.500	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290425	1,935,000.000	2,335,545.000	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20150425	3,068,000.000	3,218,301.320	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20201025	2,012,000.000	2,229,034.440	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20160425	2,218,000.000	2,336,884.800	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20211025	739,000.000	847,780.800	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20140125	307,000.000	296,350.170	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20161025	2,921,000.000	3,071,723.600	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20140725	2,157,000.000	2,049,797.100	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20170425	1,135,000.000	1,198,094.650	
4% POLAND GOVERNMENT BOND 20231025	247,000.000	249,299.570		
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 34,763,200.830 (939,996,951)	
マレーシア・リン ギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	

	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	2,614,000.000	2,712,495.520	
	4.72% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150930	1,107,000.000	1,153,626.840	
	5.094% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140430	2,395,000.000	2,459,329.700	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	1,849,000.000	1,932,075.570	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	938,000.000	1,066,280.880	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,038,568.300	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	560,124.690	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	867,924.900	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,093,000.000	1,156,142.610	
	3.741% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150227	1,056,000.000	1,070,182.080	
	3.835% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150812	653,000.000	664,780.120	
	4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	1,427,000.000	1,474,190.890	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,885,000.000	1,966,469.700	
	3.434% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140815	192,000.000	193,084.800	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	946,000.000	1,018,558.200	
	3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	738,000.000	747,343.080	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	572,000.000	567,383.960	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	746,745.740	
	3.197% MALAYSIAN GOVERNMENT 20151015	1,827,000.000	1,830,379.950	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	432,000.000	445,197.600	
	3.314% MALAYSIAN GOVERNMENT 20171031	44,000.000	44,102.520	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	444,000.000	445,149.960	
	マレーシア・リングgit 小計		マレーシア・リングgit 24,160,137.610 (662,954,176)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20231207	2,516,000.000	3,042,951.040	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20131219	6,720,000.000	6,942,969.600	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20241205	8,291,000.000	11,585,263.030	
	9.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20141218	10,588,000.000	11,562,731.280	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20151217	4,320,000.000	4,683,268.800	
	7.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20270603	8,568,000.000	9,937,080.720	
	7.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20161215	10,474,000.000	11,336,952.860	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20171214	7,015,000.000	7,844,664.050	

	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20361120	6,874,000.000	9,837,312.660	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20290531	7,549,000.000	9,458,972.490	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20181213	6,960,000.000	8,152,804.800	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20381118	9,694,000.000	12,198,832.660	
	7% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20140619	3,526,000.000	3,662,632.500	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20200611	15,980,000.000	18,790,882.000	
	6% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20150618	12,538,000.000	12,913,136.960	
	6.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20210610	9,343,000.000	10,126,971.130	
	6.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20160616	11,839,000.000	12,352,220.650	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20310529	8,456,000.000	9,864,600.480	
	6.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20220609	8,422,000.000	9,130,711.300	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20421113	1,732,000.000	2,021,780.920	
	5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20170615	2,474,000.000	2,474,272.140	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 187,921,012.070 (1,240,278,680)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	347,909.760	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,223,000.000	1,818,552.080	
	6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,705,001.980	
	5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,630,000.000	2,421,218.300	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,121,000.000	1,541,677.670	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,527,848.070	
	5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,705,000.000	2,580,210.600	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	3,111,646.860	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140104	2,190,000.000	2,287,301.700	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	2,896,023.130	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,247,865.960	
	4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,559,000.000	3,419,335.800	
	3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,164,800.000	
	3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,774,102.200	
	4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	2,977,279.200	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,497,192.800	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,834,670.200	

4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,473,314.670	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	2,120,399.380	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	1,851,000.000	2,229,214.830	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,848,000.000	2,816,333.520	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	3,179,189.160	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,920,484.340	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,417,271.250	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	2,639,000.000	3,033,768.010	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	1,680,140.940	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	2,072,000.000	2,267,389.600	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,547,000.000	2,833,257.330	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	2,065,000.000	2,420,531.050	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,563,000.000	1,703,466.810	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,956,000.000	2,084,059.320	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	3,175,000.000	3,295,427.750	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	549,000.000	579,255.390	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	69,000.000	69,834.210	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131213	1,786,000.000	1,790,393.560	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140314	977,000.000	980,106.860	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20140613	503,000.000	503,070.420	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20140912	1,155,000.000	1,155,288.750	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20141212	784,000.000	784,305.760	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140411	600,000.000	617,658.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20141010	1,406,000.000	1,469,958.940	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150227	2,401,000.000	2,533,871.340	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150410	2,471,000.000	2,600,258.010	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20151009	2,786,000.000	2,921,065.280	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160226	1,926,000.000	2,045,489.040	
2.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160408	1,642,000.000	1,787,349.840	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20161014	997,000.000	1,038,395.440	
0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170224	785,000.000	802,160.100	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170407	2,302,000.000	2,325,802.680	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20171013	149,000.000	150,034.060	

8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	966,818.740	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	2,061,050.050	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	1,968,000.000	2,773,699.200	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	3,629,838.550	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	2,925,000.000	3,441,087.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,507,000.000	3,650,668.330	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	2,544,153.570	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140425	2,491,000.000	2,625,389.450	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,908,042.920	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,430,000.000	4,094,768.300	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,787,000.000	2,116,272.620	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	2,232,000.000	2,409,957.360	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	3,752,000.000	4,054,673.840	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,758,880.200	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	3,814,000.000	4,197,764.680	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,558,000.000	3,017,928.400	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	3,288,000.000	3,745,229.280	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,585,000.000	4,315,766.400	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	2,191,924.800	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,637,411.280	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	1,897,000.000	2,252,687.500	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,365,000.000	3,024,740.400	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	2,610,000.000	3,040,676.100	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,712,000.000	4,264,419.840	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	905,000.000	1,072,741.750	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,534,845.600	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,841,000.000	4,122,084.380	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	2,872,000.000	3,218,937.600	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	2,443,000.000	2,674,352.100	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	113,000.000	115,942.520	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	38,000.000	38,845.500	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140112	2,099,000.000	2,155,211.220	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140712	3,622,000.000	3,790,350.560	

2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150115	2,178,000.000	2,286,290.160	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150712	2,614,000.000	2,740,517.600	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160225	2,429,000.000	2,584,868.930	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160725	2,673,000.000	2,882,643.390	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170225	2,315,000.000	2,435,449.450	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140925	1,032,000.000	1,045,127.040	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170725	1,868,000.000	1,901,100.960	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	1,082,144.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,780,034.130	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	1,767,000.000	1,870,440.180	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	1,536,000.000	1,660,170.240	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,235,000.000	1,606,710.300	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	1,398,000.000	1,582,857.540	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,132,000.000	1,349,128.920	
4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	1,405,000.000	1,658,321.500	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,460,740.100	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,417,000.000	1,683,991.140	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150115	1,506,000.000	1,589,086.020	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,848,000.000	2,151,996.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,433,000.000	1,851,034.760	
1% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140115	12,000.000	12,125.880	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,655,000.000	1,899,261.450	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170115	2,154,000.000	2,336,788.440	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150415	1,280,000.000	1,300,096.000	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	750,000.000	794,317.500	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	600,000.000	619,248.000	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180115	433,000.000	445,686.900	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,821,899.200	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,613,000.000	1,995,393.910	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,868,000.000	3,322,750.080	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,736,220.920	
6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	3,466,280.600	
5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	2,040,476.800	

5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,528,000.000	2,744,700.160	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	3,521,000.000	3,632,967.800	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,814,803.520	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	1,989,771.800	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,322,723.780	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	2,400,000.000	2,398,584.000	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	2,247,368.400	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	2,589,000.000	2,248,080.480	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	3,128,000.000	3,037,100.320	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	3,963,000.000	4,102,259.820	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	2,368,646.400	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,968,000.000	2,075,334.720	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	2,004,000.000	2,003,879.760	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	2,063,000.000	2,108,179.700	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	2,928,000.000	3,071,442.720	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	2,347,000.000	2,451,441.500	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	1,698,000.000	1,737,869.040	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901	3,598,000.000	3,705,832.060	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,707,000.000	1,750,033.470	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250301	2,403,000.000	2,483,596.620	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400901	1,647,000.000	1,645,847.100	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200301	2,560,000.000	2,620,953.600	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	2,891,000.000	2,938,701.500	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200901	2,000,000.000	2,009,580.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150615	833,000.000	846,836.130	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,361,000.000	2,331,322.230	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210301	2,144,000.000	2,100,712.640	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20151101	186,000.000	189,121.080	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,687,000.000	2,792,760.320	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140401	1,389,000.000	1,414,627.050	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160415	2,034,000.000	2,109,481.740	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140701	443,000.000	459,359.990	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160915	986,000.000	1,054,073.440	

5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,089,000.000	1,142,970.840	
6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20141115	2,210,000.000	2,376,656.100	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170501	2,315,000.000	2,465,475.000	
5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,088,000.000	1,175,420.800	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150301	1,330,000.000	1,339,376.500	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170601	932,000.000	991,377.720	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150715	1,412,000.000	1,484,816.840	
5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20221101	108,000.000	116,568.720	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20171101	1,261,000.000	1,271,605.010	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,385,000.000	1,876,661.150	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	451,158.680	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	986,887.800	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	1,258,000.000	1,350,035.280	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	2,105,069.850	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,213,591.680	
3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,328,030.500	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	1,542,000.000	1,803,384.420	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,189,931.050	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,742,890.710	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	1,569,000.000	1,647,528.450	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,799,708.910	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,555,000.000	1,672,993.400	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,792,000.000	2,063,219.200	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160328	516,000.000	555,855.840	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	1,297,000.000	1,559,564.680	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20210928	1,656,000.000	1,968,271.920	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170628	1,202,000.000	1,345,855.360	
4.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20260328	801,000.000	977,388.210	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220928	843,000.000	998,870.700	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320328	864,000.000	997,151.040	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190928	431,000.000	474,574.100	
4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	700,259.990	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	580,707.930	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	803,064.000	

4% IRISH TREASURY 20140115	1,001,000.000	1,026,275.250	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	702,000.000	764,463.960	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,241,000.000	1,267,880.060	
5% IRISH TREASURY 20201018	918,000.000	943,896.780	
4.5% IRISH TREASURY 20150218	538,000.000	571,237.640	
5.5% IRISH TREASURY 20171018	579,000.000	634,381.350	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	1,387,763.790	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	887,000.000	1,332,611.060	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,775,000.000	2,125,385.000	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	476,000.000	507,225.600	
3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	1,421,000.000	1,684,595.500	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	996,000.000	1,082,313.360	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	1,594,000.000	1,847,987.960	
4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	1,032,978.510	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	933,000.000	1,196,833.740	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	711,000.000	835,041.060	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	1,302,000.000	1,566,397.140	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20141020	1,349,000.000	1,433,568.810	
4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	929,000.000	1,221,458.490	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	1,137,000.000	1,267,516.230	
3.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20220420	554,000.000	648,495.780	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20221122	686,000.000	788,076.800	
1.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190618	338,000.000	356,928.000	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20440620	290,000.000	321,438.900	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	1,280,000.000	1,416,230.400	
3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	452,328.350	
4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	668,530.500	
3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140915	1,280,000.000	1,349,619.200	
4% FINNISH GOVERNMENT BOND 20250704	560,000.000	691,986.400	
3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20200415	880,000.000	1,017,183.200	
1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20160415	839,000.000	884,062.690	
3.5% FINNISH GOVERNMENT BOND 20210415	459,000.000	535,262.850	
1.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170415	252,000.000	267,916.320	
2.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20280704	270,000.000	293,592.600	
1.625% FINNISH GOVERNMENT BOND 20220915	395,000.000	396,027.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,006,000.000	2,054,224.240	

	4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	2,167,000.000	2,231,663.280	
	5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,398,000.000	1,391,499.300	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,739,346.400	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	2,565,000.000	2,645,335.800	
	4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,725,000.000	2,133,130.000	
	3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,859,725.890	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	1,006,916.960	
	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	982,820.320	
	4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,467,021.800	
	4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,777,000.000	1,662,614.510	
	4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140131	1,304,000.000	1,328,645.600	
	4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,366,993.400	
	4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,725,122.500	
	3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20141031	2,091,000.000	2,106,473.400	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	893,000.000	746,601.580	
	4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,491,000.000	2,342,312.210	
	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,135,000.000	1,032,747.850	
	3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150430	1,805,000.000	1,800,415.300	
	4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,651,263.110	
	3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160430	863,000.000	851,245.940	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,551,819.600	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,074,000.000	1,086,275.820	
	3.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140430	3,738,000.000	3,787,341.600	
	4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20161031	1,446,000.000	1,463,279.700	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,283,000.000	1,323,157.900	
	4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150730	1,293,000.000	1,319,726.310	
	3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20151031	342,000.000	343,662.120	
	4.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180131	23,000.000	23,035.420	
	ユーロ 小計		ユーロ 453,428,363.440 (50,063,025,607)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	7.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20140115	1,423,000.000	1,458,873.830	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20141221	1,962,000.000	2,098,829.880	

	13.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20150915	6,184,000.000	7,445,412.320	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20170915	8,860,000.000	9,731,558.200	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20181221	8,461,000.000	9,258,872.300	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	9,236,000.000	9,704,449.920	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	11,696,000.000	14,933,101.920	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	6,158,000.000	4,965,688.040	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	8,963,000.000	9,133,297.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	4,116,000.000	3,371,744.880	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	3,957,000.000	3,646,256.790	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	1,593,000.000	1,696,752.090	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	2,911,000.000	3,072,356.730	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 80,517,193.900 (792,289,187)	
国債証券 合計			122,093,696,759 [122,093,696,759]	
合計			122,093,696,759 [122,093,696,759]	

- (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 209銘柄	100%	41.2%
イギリス・ポンド	国債証券 36銘柄	100%	8.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 17銘柄	100%	1.6%
カナダ・ドル	国債証券 34銘柄	100%	2.8%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券 9銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 9銘柄	100%	0.6%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.8%
ノルウェー・クローネ	国債証券 4銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	100%	0.8%
マレーシア・リンギット	国債証券 22銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 21銘柄	100%	1.0%
ユーロ	国債証券 247銘柄	100%	41.0%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	100%	0.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成24年12月28日

資産総額	3,512,918円
負債総額	650円
純資産総額（ - ）	3,512,268円
発行済数量	4,412,567口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.7960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24年12月28日

資産総額	97,333,784,764円
負債総額	348,794,000円
純資産総額（ - ）	96,984,990,764円
発行済数量	200,529,461,609口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.4836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24年12月28日

資産総額	54,894,238,350円
負債総額	87,583,407円
純資産総額（ - ）	54,806,654,943円
発行済数量	51,312,180,784口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0681円

(参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

平成24年12月28日

資産総額	65,328,346,752円
負債総額	3,277,129,020円
純資産総額（ - ）	62,051,217,732円
発行済数量	46,517,357,600口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3339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24年12月28日

資産総額	638,773,054円
負債総額	5,028,566円
純資産総額(-)	633,744,488円
発行済数量	514,381,000口
1単位当たり純資産額(/)	1.2321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24年12月28日

資産総額	13,342,492,825円
負債総額	50,346,850円
純資産総額(-)	13,292,145,975円
発行済数量	11,595,344,384口
1単位当たり純資産額(/)	1.1463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24年12月28日

資産総額	129,060,501,996円
負債総額	349,128,210円
純資産総額(-)	128,711,373,786円
発行済数量	62,444,311,771口
1単位当たり純資産額(/)	2.0612円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成24年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

平成24年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	4	90,730
追加型株式投資信託	420	7,381,068
株式投資信託 合計	424	7,471,798
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,449,257
公社債投資信託 合計	17	2,449,257
総合計	441	9,921,055

3 【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第54期事業年度に係る中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,820,358	3,745,233
有価証券	18,987,155	19,655,070
前払金	579	314
前払費用	24,840	90,562
未収入金	6,925	11,931
未収委託者報酬	6,933,076	6,516,540
未収収益	41,963	55,102
貯蔵品	23,337	11,888
繰延税金資産	286,080	630,508
その他	501,484	190,450
流動資産計	28,625,803	30,907,602
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	967,190	1,003,450
器具備品（純額）	332,407	513,162
建設仮勘定	634,782	484,571
	-	5,715
無形固定資産	2,414,530	2,870,849
ソフトウェア	1,364,617	2,173,517
ソフトウェア仮勘定	1,037,069	684,878
電話加入権	11,850	11,850
商標権	396	132

その他		596		471
投資その他の資産		18,825,476		16,375,520
投資有価証券		12,339,547		10,034,136
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		142,215		136,315
従業員に対する長期貸付金		99,889		112,674
差入保証金		609,781		542,920
長期前払費用		7,607		8,478
投資不動産(純額)	1	490,114	1	409,876
貸倒引当金		4,750		9,950
固定資産計		22,207,196		20,249,820
資産合計		50,833,000		51,157,423

(単位:千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	46,454	55,551
未払金	6,501,119	7,194,946
未払収益分配金	27,599	17,954
未払償還金	119,838	88,334
未払手数料	3,725,807	3,386,380
その他未払金	2,627,872	3,702,277
未払費用	2,395,029	3,313,011
未払法人税等	895,379	963,539
未払消費税等	383,973	229,365
賞与引当金	263,000	307,000
本社移転関連費用引当金	-	346,425
資産除去債務	-	292,000
その他	-	87,535
流動負債計	10,484,955	12,789,375
固定負債		
退職給付引当金	1,410,635	1,670,344
役員退職慰労引当金	59,160	68,068
繰延税金負債	1,977,913	1,782,558
固定負債計	3,447,708	3,520,970
負債合計	13,932,663	16,310,345
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		

繰越利益剰余金	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計	10,248,473	8,089,414
株主資本合計	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益	85,902	53,783
評価・換算差額等合計	18,137	87,663
純資産合計	36,900,336	34,847,077
負債・純資産合計	50,833,000	51,157,423

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	72,303,483	72,931,048
その他営業収益	345,390	401,212
営業収益計	72,648,873	73,332,260
営業費用		
支払手数料	41,437,322	41,050,089
広告宣伝費	967,991	709,853
公告費	1,256	699
受益証券発行費	3	74
調査費	6,192,360	7,993,144
調査費	831,159	878,635
委託調査費	5,361,200	7,114,509
委託計算費	718,414	733,156
営業雑経費	1,806,147	1,651,996
通信費	287,454	205,421
印刷費	674,758	472,511
協会費	47,465	52,117
諸会費	10,778	11,971
その他営業雑経費	785,691	909,973
営業費用計	51,123,496	52,139,015
一般管理費		
給料	4,192,794	4,452,711
役員報酬	157,200	209,630
給料・手当	3,545,655	3,646,155
賞与	226,939	289,926
賞与引当金繰入額	263,000	307,000
福利厚生費	619,459	728,342
交際費	68,476	71,356
寄付金	638	591
旅費交通費	266,082	215,939
租税公課	169,305	171,533
不動産賃借料	680,147	727,939
退職給付費用	334,864	422,030
役員退職慰労引当金繰入額	28,500	27,988
固定資産減価償却費	897,352	1,107,222
諸経費	1,170,318	1,077,041
一般管理費計	8,427,939	9,002,696
営業利益	13,097,437	12,190,548

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)		当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	573,514		74,753
有価証券利息		23,029		13,537
受取利息		2,673		2,771
時効成立分配金・償還金		149,120		42,189
投資有価証券売却益		38,591		117,695
有価証券償還益		3,185		68,106
その他		41,908		54,685
営業外収益計		832,022		373,739
営業外費用				
投資有価証券売却損		7,515		95,389
有価証券償還損		277		67,873
その他		180,501		67,829
営業外費用計		188,294		231,091
経常利益		13,741,165		12,333,196
特別利益				
貸倒引当金戻入額		614,232		-
特別利益計		614,232		-
特別損失				
固定資産除却損	2	1,067	2	4,871
減損損失	3	35,468	3	76,217
有価証券評価損		-		211,376
本社移転関連費用		-		346,425
その他		22,059		19,547
特別損失計		58,595		658,438
税引前当期純利益		14,296,802		11,674,757
法人税、住民税及び事業税		4,834,931		5,254,642
法人税等調整額		256,140		602,832
法人税等合計		5,091,072		4,651,809
当期純利益		9,205,730		7,022,948

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
当期首残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	2,800,000	-
当期変動額		
別途積立金の取崩	2,800,000	-
当期変動額合計	2,800,000	-
当期末残高	-	-
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,085,103	9,874,176
当期変動額		
別途積立金の取崩	2,800,000	-
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	789,072	2,159,059
当期末残高	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計		
当期首残高	12,259,401	10,248,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008

当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	10,248,473	8,089,414

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
株主資本合計		
当期首残高	38,929,401	36,918,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	18,061	104,040
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	85,978	137,920
当期変動額合計	85,978	137,920
当期末残高	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	55,712	85,902
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	141,615	32,119
当期変動額合計	141,615	32,119
当期末残高	85,902	53,783
評価・換算差額等合計		
当期首残高	73,774	18,137
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,636	105,800
当期変動額合計	55,636	105,800
当期末残高	18,137	87,663
純資産合計		
当期首残高	38,855,627	36,900,336
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,636	105,800
当期変動額合計	1,955,290	2,053,258
当期末残高	36,900,336	34,847,077

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法により計上しております。

3．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

(リース資産を除く)

定率法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	6～47年
器具備品	3～20年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

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

(3) 長期前払費用

定額法によっております。

4．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

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

（４）役員退職慰労引当金

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

（５）本社移転関連費用引当金

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

５．ヘッジ会計の方法

（１）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。

（２）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段・・・株価指数先物

ヘッジ対象・・・投資有価証券

（３）ヘッジ方針

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

（４）ヘッジ有効性評価の方法

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

６．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

表示方法の変更

（損益計算書）

１．前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めていた「有価証券償還益」は重要性が増し

たため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他」に表示していた45,094千円は、「有価証券償還益」3,185千円、「その他」41,908千円として組替えております。

2. 前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「有価証券償還損」は重要性が増したため、当事業年度より区分掲記することとしました。また、前事業年度において区分掲記していた「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」、「貯蔵品廃棄損」及び「投資不動産管理費用」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」に表示していた98,613千円、「貯蔵品廃棄損」に表示していた25,533千円、「投資不動産管理費用」に表示していた20,028千円、及び「その他」に表示していた36,603千円は、「有価証券償還損」277千円、「その他」180,501千円として組替えております。

3. 前事業年度において区分掲記していた「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」に表示していた21,290千円は、「その他」として組替えております。

追加情報

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
建物	854,118千円	986,089千円
器具備品	2,129,756千円	2,234,738千円
投資建物	700,991千円	712,587千円
投資器具備品	28,141千円	22,398千円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
未払金	2,591,913千円	3,577,654千円

3 保証債務

前事業年度（平成23年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,384,110千円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

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

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
受取配当金	460,584千円	-

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
器具備品	1,067千円	4,812千円
投資不動産	-	59千円
計	1,067千円	4,871千円

3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

場所 千葉県浦安市
用途 賃貸等不動産（浦安寮）
種類 建物及び土地

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

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

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

評価しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

場所 千葉県浦安市
用途 賃貸等不動産（浦安寮）
種類 建物及び土地

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

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

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

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

効力発生日 平成23年6月27日

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

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

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

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

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

おります。

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

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社ではこれをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し価格変動リスクをヘッジしております。なお、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止し、中止時点までのヘッジ手段に係る損益は、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで繰り延べております。

（ ）デリバティブ取引

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

信用リスクの管理

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

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

当事業年度(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

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

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

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

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

資 産

(1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

関係」をご参照下さい。

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

デリバティブ取引

注記事項（デリバティブ取引関係）をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
(1) その他有価証券 非上場株式	1,172,137	1,163,689
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069	5,141,069
(3) 差入保証金	609,781	542,920

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成23年3月31日現在）

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

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

2．その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	4,822,299	4,383,992	438,306
小計	4,822,299	4,383,992	438,306
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの （1）株式 （2）その他 証券投資信託の受益証券	54,283 25,277,982	55,101 25,890,888	818 612,906
小計	25,332,266	25,945,990	613,724
合計	30,154,565	30,329,983	175,417

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	6,864,572	6,497,516	367,056
小計	6,864,572	6,497,516	367,056
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの （1）株式	49,871	55,101	5,230

(2) その他 証券投資信託の受益証券	21,611,072	21,918,194	307,122
小計	21,660,944	21,973,296	312,352
合計	28,525,516	28,470,813	54,703

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

前事業年度（平成23年3月31日現在）

該当事項はありません。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

株式関連

(単位：千円)

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等	時価	評価損益
		うち1年超		

市場取引 以外の 取引	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	1,669,315	-	87,535	87,535
合計		1,669,315	-	87,535	87,535

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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

前事業年度（平成23年3月31日現在）

株式関連

（単位：千円）

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価
				うち1年超	
原則的 処理 方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,435,030	-	183,430
合計			2,435,030	-	183,430

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
退職給付債務	1,410,635千円	1,670,344千円
退職給付引当金	1,410,635千円	1,670,344千円

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
勤務費用	191,300千円	261,341千円
その他	143,564千円	160,689千円
退職給付費用	334,864千円	422,030千円

（注）「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：千円）

	前事業年度（平成23年3月31日 現在）	当事業年度（平成24年3月31日 現在）
繰延税金資産		
減損損失	928,499	838,826
退職給付引当金	573,987	599,247
連結法人間取引（譲渡損）	294,850	258,256
未払事業税	212,062	212,753
投資有価証券評価損	216,468	191,138
本社移転関連費用引当金	-	131,676
賞与引当金	107,014	116,690
出資金評価損	128,238	114,425
資産除去債務	-	110,989
有価証券評価損	-	80,344
器具備品	38,093	33,365
その他有価証券評価差額金	125,395	27,099
役員退職慰労引当金	24,072	25,804
未払社会保険料	11,722	14,071
その他	28,763	27,487
繰延税金資産小計	2,689,169	2,782,177
評価性引当額	1,547,609	1,379,241
繰延税金資産合計	1,141,560	1,402,935
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	2,772,301	2,428,233
建物（資産除去債務）	-	76,837
繰延ヘッジ損益	58,934	29,783
その他有価証券評価差額金	-	18,241
その他	2,156	1,888
繰延税金負債合計	2,833,392	2,554,985
繰延税金負債の純額	1,691,832	1,152,049

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

（単位：%）

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
法定実効税率	40.69	-
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.21	-
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	1.25	-
住民税均等割	0.02	-
評価性引当額	4.14	-

その他	0.07	-
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.60	-

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

3．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率の変更により繰延税金負債の純額（繰延税金資産の金額を控除した金額）が211,604千円減少し、法人税等調整額が205,949千円減少しております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

変動の内容	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
期首残高	-	-
見積りの変更に伴う増加額	-	292,000
期末残高	-	292,000

4．当該資産除去債務の金額の見積りの変更

当事業年度において、平成24年度中に予定している本社移転計画により、合理的な見積りが可能となったため、当該資産除去債務292,000千円を貸借対照表に計上しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	35,468	35,468

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	76,217	76,217

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証	1,384,110	-	-
子会社	Daiwa Asset Management (India) Private Limited	India	1,128	金融商品取引業	(所有) 直接 91.0	経営管理	増資の引受	3,204,985	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。
- (2) インド共和国における外国資本規制上の最低払込金額を満たすため、当社がDaiwa Asset Management(India)Private Limited社の行った増資を1株につき72円86銭で引き受けております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,372,770	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	21,941,957	未払手数料	2,760,790
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケッツ㈱	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	666,862	未払手数料	70,947
							為替予約	1,160,187	-	-

同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	1,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,085,626	未払費用	129,623
-------------	---------	--------	-------	---------	---	-----------	-----------	-----------	------	---------

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

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

当事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
1株当たり純資産額 14,146.05円	1株当たり純資産額 13,358.92円
1株当たり当期純利益 3,529.09円	1株当たり当期純利益 2,692.30円

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

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

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
当期純利益(千円)	9,205,730	7,022,948
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(追加情報)

前事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

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

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

(単位：千円)

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

(注) 取得付随費用を算入した後の金額になります。

当事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

該当事項はありません。

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成24年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		1,833,296
有価証券		16,491,682
未収委託者報酬		6,074,374
貯蔵品		9,897
繰延税金資産		576,334
その他		421,905
流動資産計		25,407,491
固定資産		
有形固定資産	1	812,139
無形固定資産		
ソフトウェア		2,304,771
その他		710,794
無形固定資産合計		3,015,566
投資その他の資産		
投資有価証券		13,513,781
その他	1	2,247,303
貸倒引当金		9,950
投資その他の資産合計		15,751,135
固定資産計		19,578,842
資産合計		44,986,333

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成24年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		4,702,038
未払費用		3,673,584
未払法人税等		743,636
賞与引当金		426,400
本社移転関連費用引当金		346,425
資産除去債務		292,000
その他	3	270,950
流動負債計		10,455,035
固定負債		
繰延税金負債		1,465,584
退職給付引当金		1,864,115
役員退職慰労引当金		47,925

固定負債計	3,377,624
負債合計	13,832,659
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	4,314,536
利益剰余金合計	4,688,834
株主資本合計	31,358,834
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	408,812
繰延ヘッジ損益	203,652
評価・換算差額等合計	205,160
純資産合計	31,153,673
負債・純資産合計	44,986,333

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		35,929,057
その他営業収益		221,982
営業収益計		36,151,039
営業費用		
支払手数料		20,053,264
その他営業費用		5,549,289
営業費用計		25,602,554
一般管理費	1	5,244,843
営業利益		5,303,641
営業外収益	2	410,550
営業外費用	1, 3	62,244
経常利益		5,651,948
特別利益		39,827
特別損失		14,428
税引前中間純利益		5,677,347
法人税、住民税及び事業税		2,153,585
法人税等調整額		97,806
中間純利益		3,621,569

(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24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	15,174,272
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
資本剰余金合計	
当期首残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	374,297
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	
当期首残高	7,715,116
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,022,149
中間純利益	3,621,569
当中間期変動額合計	3,400,580
当中間期末残高	4,314,536

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)
利益剰余金合計	
当期首残高	8,089,414
当中間期変動額	

剰余金の配当	7,022,149
中間純利益	3,621,569
当中間期変動額合計	3,400,580
当中間期末残高	4,688,834
株主資本合計	
当期首残高	34,759,414
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,022,149
中間純利益	3,621,569
当中間期変動額合計	3,400,580
当中間期末残高	31,358,834
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	33,879
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)	442,692
当中間期変動額合計	442,692
当中間期末残高	408,812
繰延ヘッジ損益	
当期首残高	53,783
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)	149,868
当中間期変動額合計	149,868
当中間期末残高	203,652
評価・換算差額等合計	
当期首残高	87,663
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)	292,823
当中間期変動額合計	292,823
当中間期末残高	205,160
純資産合計	
当期首残高	34,847,077
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,022,149
中間純利益	3,621,569
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	292,823
当中間期変動額合計	3,693,404
当中間期末残高	31,153,673

重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)
1. 資産の評価基準及び 評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。 その他有価証券 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部 純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算 定）を採用しております。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) デリバティブ 時価法により計上しております。</p>
2. 固定資産の減価償却 の方法	<p>(1) 有形固定資産及び投資不動産 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6～47年 器具備品 3～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能 期間（5年）に基づいております。</p> <p>(3) 長期前払費用 定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率 法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評 価法により計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会 計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中 間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金 は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績 等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであ ります。 また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中 間会計期間末要支給額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規 程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転関連費用引当金 本社移転に伴い発生する損失に備えるため、発生が見込まれる固 定資産除却損、移転費用について合理的な見積額を計上しております。</p>

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

会計方針の変更等

<p>当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)</p>
<p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年 4月 1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

<p>当中間会計期間末 (平成24年 9月30日)</p>	
1. 減価償却累計額	
有形固定資産	3,428,406千円
投資その他の資産	741,362千円
2. 債務保証	<p>子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,329,090千円に対して保証を行っております。</p>
3. 消費税等の取扱い	<p>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。</p>

(中間損益計算書関係)

<p>当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)</p>	
1. 減価償却累計額	

有形固定資産	207,578千円
無形固定資産	440,371千円
投資その他の資産	7,190千円
2. 営業外収益の主要項目	
受取配当金	219,419千円
投資有価証券売却益	90,397千円
有価証券償還益	64,318千円
3. 営業外費用の主要項目	
有価証券償還損	35,545千円
投資不動産管理費用	7,903千円
投資不動産償却費	6,376千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（千株）	当中間会計期間 増加株式数（千株）	当中間会計期間 減少株式数（千株）	当中間会計期間末 株式数（千株）
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

() デリバティブ取引

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

信用リスクの管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2．金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（<注2>参照のこと）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	1,833,296	1,833,296	-
(2) 未収委託者報酬	6,074,374	6,074,374	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	23,805,225	23,805,225	-

資産計	31,712,896	31,712,896	-
(1) 未払金	4,702,038	4,702,038	-
(2) 未払費用(*1)	2,991,665	2,991,665	-
負債計	7,693,704	7,693,704	-
デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(2,304)	(2,304)	-
デリバティブ取引計	(2,304)	(2,304)	-

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

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

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

資産

(1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払金、及び(2) 未払費用

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	1,059,169
子会社株式	5,141,069
長期差入保証金	1,587,878

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	1,833,296	-	-	-
未収委託者報酬	6,074,374	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期 があるもの	267,222	1,676,395	3,587,421	-
合計	8,174,892	1,676,395	3,587,421	-

（有価証券関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
証券投資信託の受益証券	2,985,292	2,807,373	177,919
小計	2,985,292	2,807,373	177,919
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
株式	31,019	55,101	24,082
証券投資信託の受益証券	20,788,914	21,578,724	789,810
小計	20,819,933	21,633,826	813,892
合計	23,805,225	24,441,199	635,973

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

（デリバティブ取引関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当する取引はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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

株式関連

（単位：千円）

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価	当該時価の 算定方法
				うち1年超		
原則的 処理方 法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	1,408,896	-	2,304	東京証券取引所から公表された価格 によっている。
合計			1,408,896	-	2,304	

（資産除去債務関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を平成23年12月から平成24年12月までの1年1ヶ月と見積り、過去の不動産賃貸借契約に係る原状回復費用の実績をもとに資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから割引前の見積り額を計上しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

変動の内容	金額
期首残高	292,000千円
時の経過による調整額	-
中間期末残高	292,000千円

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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

〔関連情報〕

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1．サービスごとの情報

当社のサービスは、単一であるため記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、

記載を省略しております。

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

当中間会計期間 （自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）	
1株当たり純資産額	11,943.02円
1株当たり中間純利益金額	1,388.35円
(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。	
2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。	
中間純利益(千円)	3,621,569
普通株式に係る中間純利益(千円)	3,621,569
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成24年12月3日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・本店の所在地の変更(東京都千代田区に変更)

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

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成24年4月1日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名称 大和証券株式会社

資本金の額 100,000百万円（平成24年4月1日現在）

事業の内容 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

該当ありません。

< 再信託受託会社の概要 >

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成24年3月末日現在）

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

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

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・ 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
 - ・ 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
使用開始日を記載することがあります。
 - 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - ・ 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - ・ 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- 次の事項を記載することがあります。
- ・ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
 - ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
- 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
- ファンドの形態等を記載することがあります。
- 図案を採用することがあります。
- ファンドの管理番号等を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成25年1月18日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成23年12月20日から平成24年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成24年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）](#)△

独立監査人の監査報告書

平成24年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成24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。

利害関係

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

以上

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月29日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成24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24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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