

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

## 第一部 【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

DCダイワ・ターゲットイヤー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なわないものとします。

### (3) 【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### (4) 【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

#### ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5) 【申込手数料】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。  
収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位

(7) 【申込期間】

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

(8) 【申込取扱場所】

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

## (11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

## (12) 【その他】

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

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

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

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

当ファンドは、積立投資専用です。

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

ロ．収益分配金は、自動的に再投資されます。

振替受益権について

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

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

## (参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

取得申込金額に利息は付きません。

## 第二部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

##### (注1) 商品分類の定義

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

##### (注2) 属性区分の定義

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

- ・「為替ヘッジなし」...目論見書等において、為替のヘッジを行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。

◆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。

## 〈2013年12月時点の基本配分比率〉

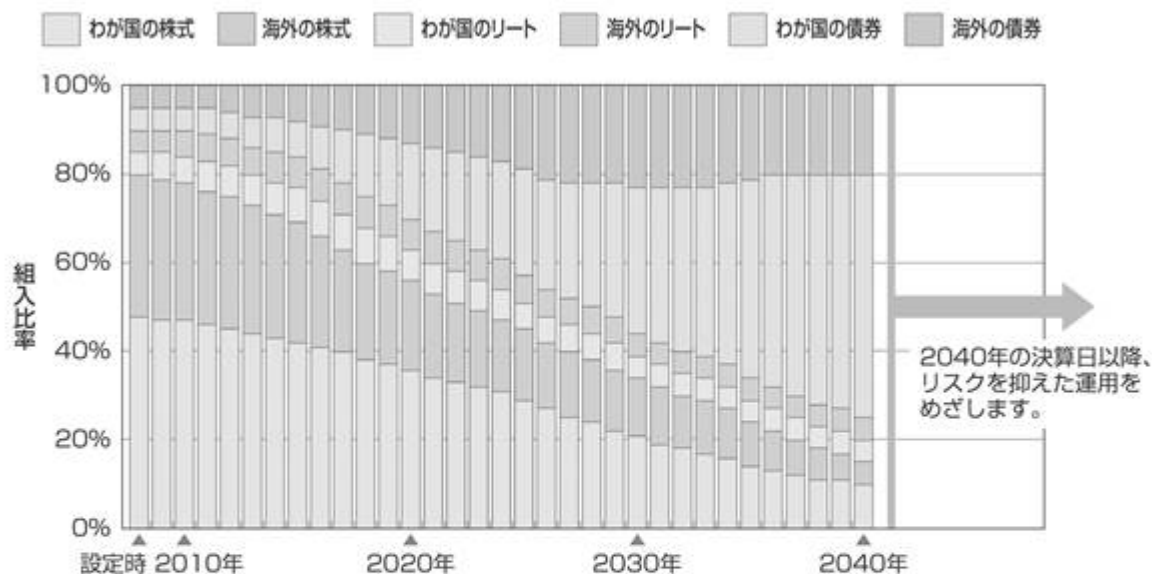
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	44%	29%	7%	6%	7%	7%

## 〈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) 2013年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2012年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。



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

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

### 運用プロセス



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

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

### 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

### 3 海外の株式への投資にあたっては、投資成果を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<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークである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<sup>(注1)</sup> ÷ 基準時の時価総額<sup>(注2)</sup> × 1,000

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

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

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

## 5

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

## 運用プロセス



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

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

## S&amp;P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

## [特徴]

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

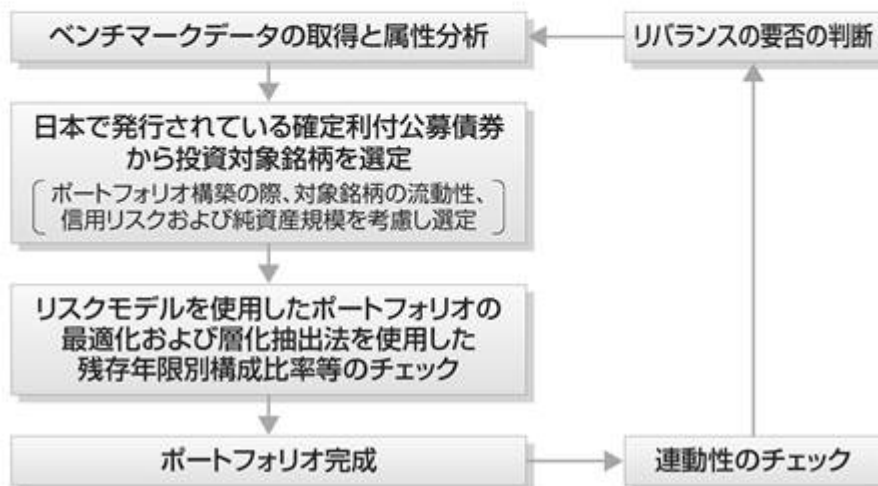
本商品は、スタンダード&プアーズおよびその関連会社（以下、S&P）によって支持、保証、販売または販売促進されるものではありません。S&Pは、明示的にも暗示的にも、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または本商品に関する投資について、またS&P先進国REIT指数（除く日本）が市場全般のパフォーマンスに追従する能力について、何ら表明、条件付けまたは保証するものではありません。S&Pの大和証券投資信託委託株式会社に対する唯一の関係は、S&PおよびS&P先進国REIT指数（除く日本）の登録商標についての利用許諾を与えることです。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）に関する決定、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

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

## 6

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

## 運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

## NOMURA－BPI総合指数とは

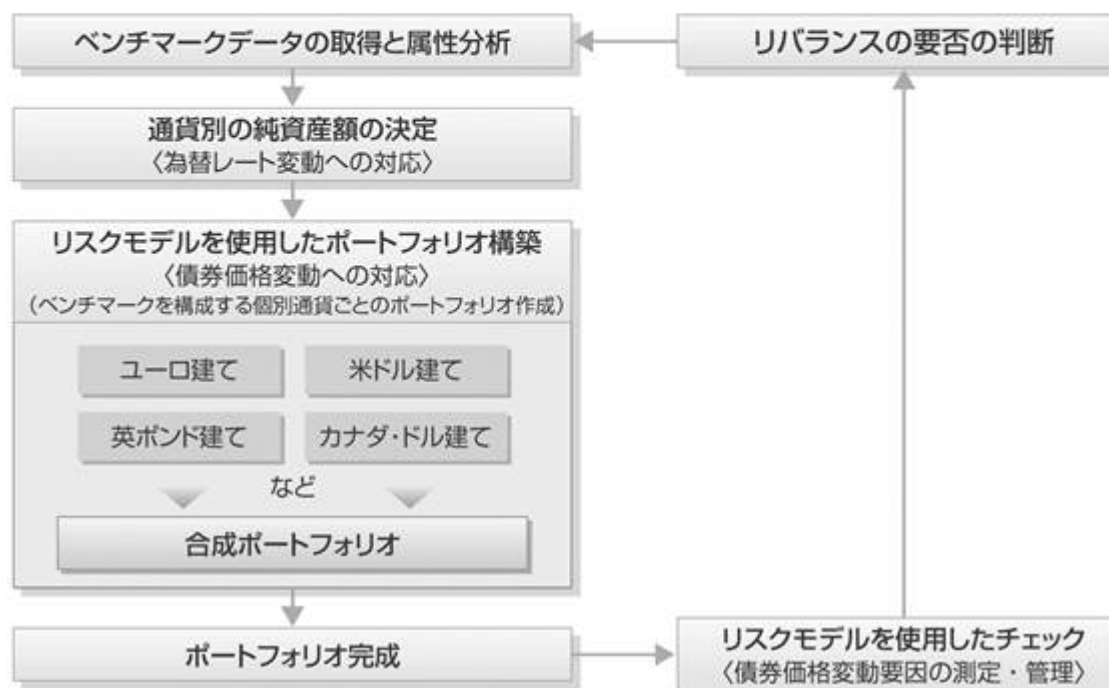
NOMURA－BPIは、野村証券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

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

## 7

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

## 運用プロセス



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

## ①為替レート変動への対応

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

## ②債券価格変動への対応

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

## ③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

## シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

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

## 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。

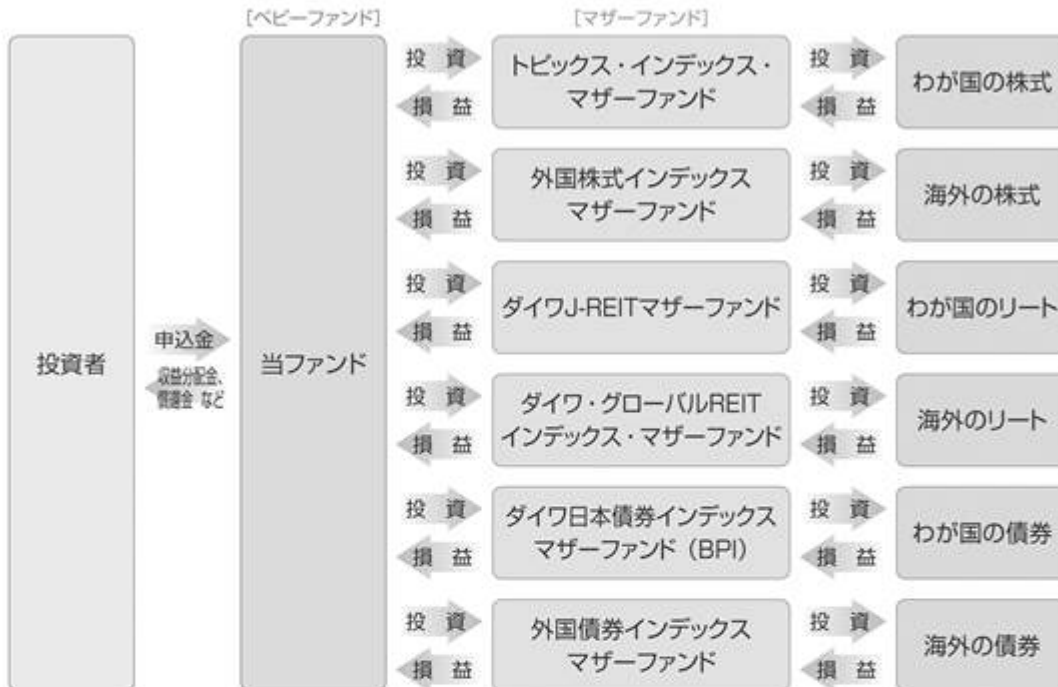
NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

## 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ないます。

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

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

(注) 収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

&lt; 委託会社の概況(平成25年12月末日現在) &gt;

- ・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

- ・ 沿革

昭和34年12月12日	設立登記
昭和35年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
昭和35年 4月 1日	営業開始
昭和60年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
平成 7年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
平成 7年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
平成19年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (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せん。
- ロ. マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、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せん。

#### 当初設定時の基本配分比率

トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	.....	信託財産の純資産総額の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。）

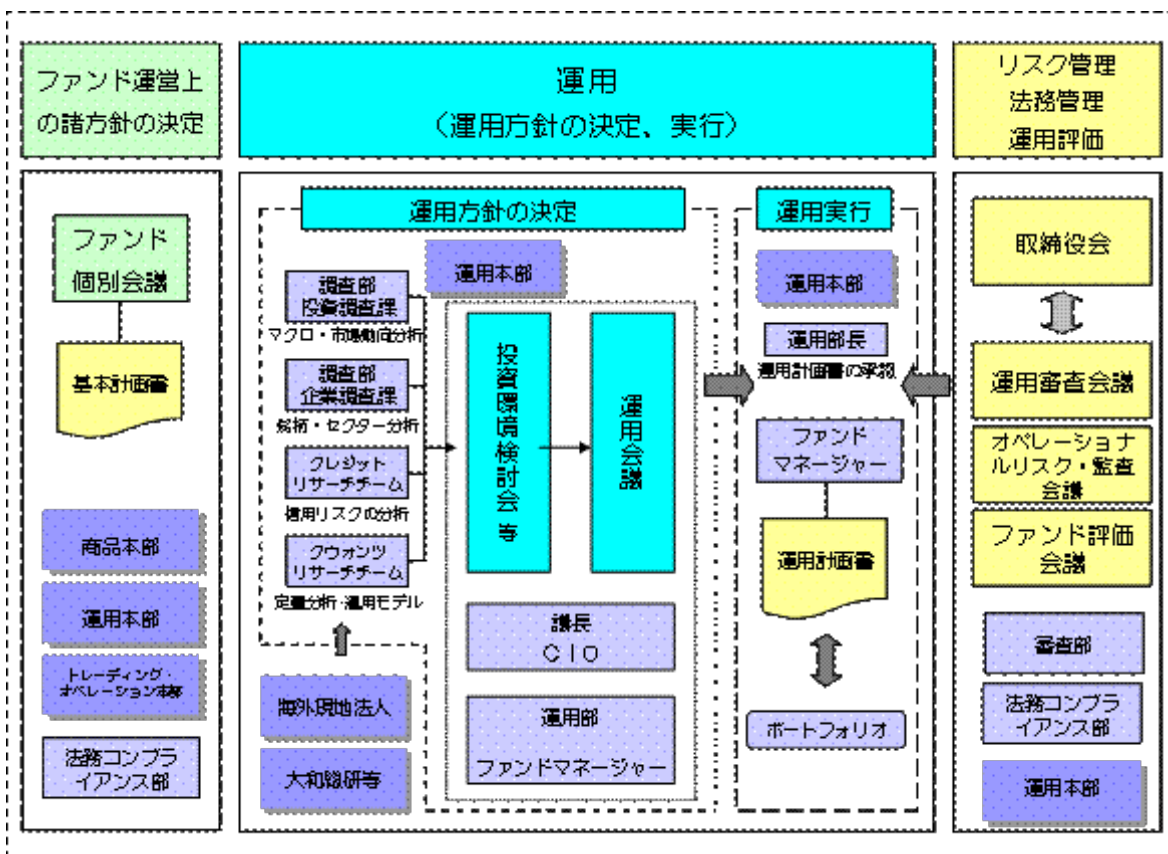
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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．Deputy-CIO（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

### ハ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

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

### ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

### ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

#### 受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成25年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5) 【投資制限】

##### 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

##### 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

##### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

##### 外国為替予約取引（信託約款）

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

##### 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## <参考> 各マザーファンドの概要

### 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

##### 投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

#### (2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

## (3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

(注) 東証株価指数(TOPIX)とは

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

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

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

## 2. 外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資方針

## 主要投資対象

外国の株式(預託証券を含みます。)を主要投資対象とします。

## 投資態度

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

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

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

## (2) 投資対象

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)



8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注)MSCIコクサイ指数とは

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

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

### 3. ダイワJ-REITマザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

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

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

##### 投資態度

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

#### (2) 投資対象

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

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

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3. 投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

(注) 東証REIT指数とは

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

[算出方法の概要]

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

##### (1) 投資方針

###### 主要投資対象

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

###### 投資態度

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

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

ハ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

4．外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

## (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注) S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

[特徴]

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

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

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

## 5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA - BPI総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

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、）の行使等により取得したものに限り、

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 先物取引等

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引

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



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

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

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

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

（注）NOMURA - B P I 総合指数とは

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

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

## 6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

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

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

### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

## イ．為替手形

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

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

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

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

## (3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 先物取引等

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

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

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

た場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

#### 金利先渡取引

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

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

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

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

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

#### (注) NOMURA - B P I 総合短期指数とは

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

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

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

## 7. 外国債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

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

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

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

## (2) 投資対象

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは  
シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、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）



※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．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

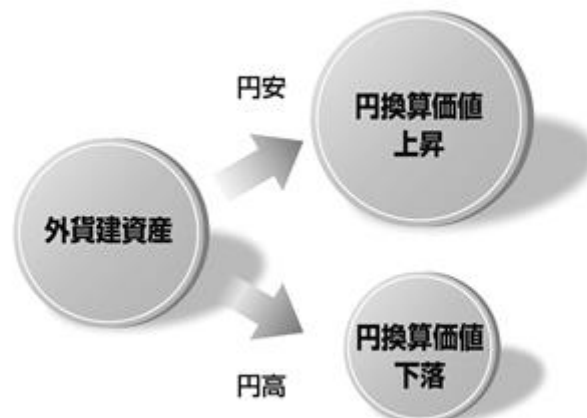
- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。



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

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

#### ロ．カンントリー・リスク

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

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し下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

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

### (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

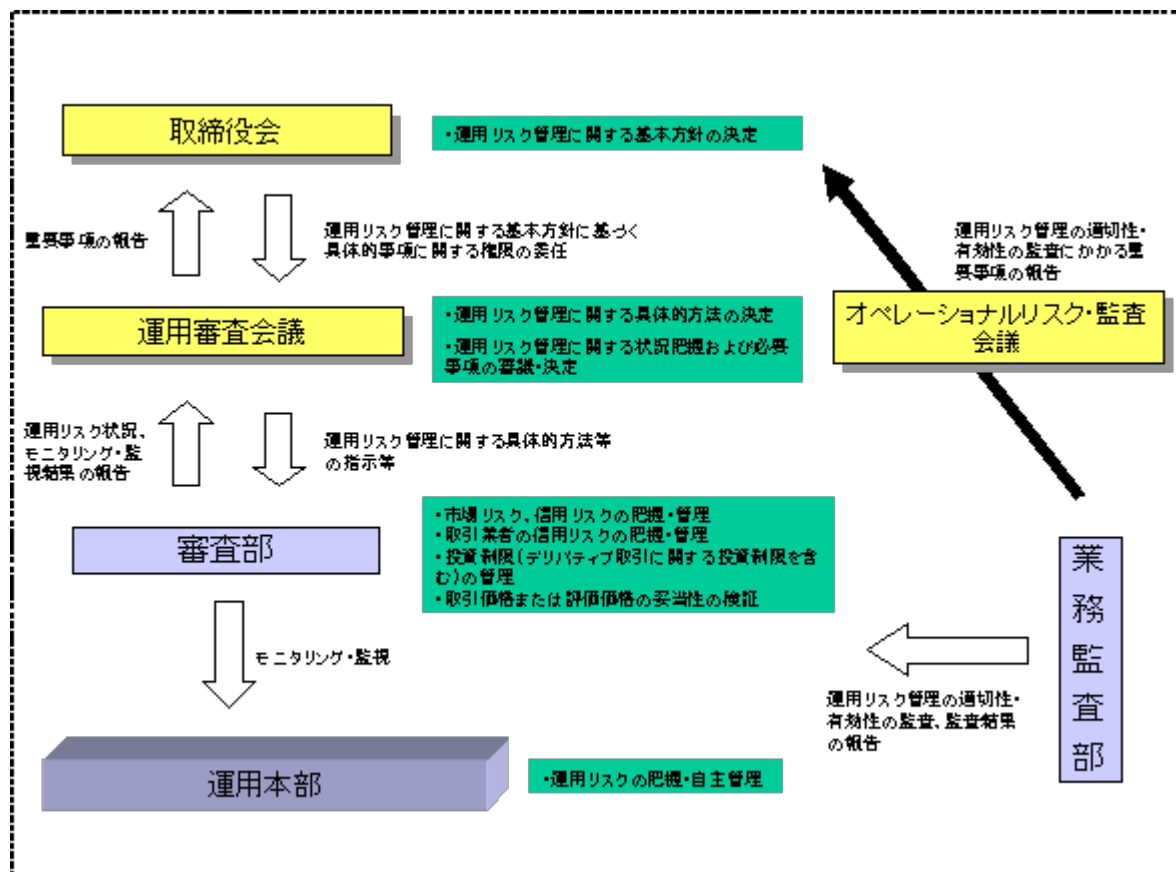
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付けの申込みの受け付けを中止することがあります。

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

### (3) その他の留意点

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

### (4) リスク管理体制



#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

##### (2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

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

	信託報酬率
第1計算期間から第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%）

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

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

< 第1計算期間から第33計算期間まで >

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

< 第34計算期間以降 >

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

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

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

< 注1 > 個別元本について

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

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

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

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

< 注2 > 収益分配金の課税について

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

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

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

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成25年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	10,104,127	99.85
内 日本	10,104,127	99.85
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14,689	0.15
純資産総額	10,118,816	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（平成25年12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 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	5,988,897	0.7160 4,288,050	0.7462 4,468,914	44.16
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,781,830	1.5463 2,755,244	1.6458 2,932,535	28.98
3	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	381,725	1.7696 675,500	1.8742 715,428	7.07
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	279,427	2.4739 691,302	2.5201 704,183	6.96
5	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	585,428	1.1734 686,988	1.1687 684,189	6.76
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	395,195	1.4542 574,692	1.5154 598,878	5.92

(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	99.85%
合計	99.85%

(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
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
平成24年12月末日	3,512,268	-	0.7960	-
平成25年1月末日	3,941,311	-	0.8690	-
2月末日	3,923,230	-	0.8917	-
3月末日	6,395,460	-	0.9470	-
4月末日	7,021,056	-	1.0242	-
5月末日	8,110,681	-	1.0198	-
6月末日	7,928,477	-	0.9951	-
7月末日	8,316,399	-	1.0048	-
8月末日	8,311,222	-	0.9867	-
9月末日	8,844,157	-	1.0500	-
10月末日	9,288,151	-	1.0681	-
11月末日	9,668,502	-	1.1118	-
第6計算期間末 (平成25年12月18日)	9,736,661	9,736,661	1.1001	1.1001
12月末日	10,118,816	-	1.1492	-

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	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
第6計算期間	43.9

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第6計算期間	4,772,167	334,316

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	126,927,862,280	99.55
内 日本	126,927,862,280	99.55
新株予約権証券	5,593,000	0.00
内 日本	5,593,000	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	562,023,023	0.44
純資産総額	127,495,478,303	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	625,200,000	0.49
内 日本	625,200,000	0.49

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

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

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

## (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	数業種は	株数、口 また 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	957,600	6,398.50 6,127,211,900	6,420.00 6,147,792,000	4.82



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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.55%
新株予約権証券	0.00%
合計	99.56%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

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

サービス業	2.10%
合計	99.55%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 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 2014年3月	買建	48	609,871,565	625,200,000	0.49%

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

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

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

#### 投資状況

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

	内 ニュージーランド	35,864,599	0.05
投資証券		1,307,873,938	1.78
	内 香港	27,944,777	0.04
	内 シンガポール	21,343,928	0.03
	内 イギリス	99,338,140	0.13
	内 オランダ	9,507,627	0.01
	内 フランス	102,496,754	0.14
	内 アメリカ	891,028,561	1.21
	内 オーストラリア	156,214,151	0.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,090,825,224	1.48
純資産総額		73,591,255,008	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	967,743,675	1.32
内 アメリカ	967,743,675	1.32
為替予約取引(売建)	21,754,500	0.03
内 日本	21,754,500	0.03

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

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

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

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

## (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.74%
投資証券	1.78%
合計	98.52%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 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 2014年3月	買建	20	931,926,884	967,743,675	1.32%
為替予約取引	日本	ユーロ売/円買 2014年1月	売建	150,000	21,399,450	21,754,500	0.03%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

#### (参考) ダイワJ - R E I T マザーファンド

#### (1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

##### 投資状況

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

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

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

#### (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

##### 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	99.04%
合計	99.04%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

#### (1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

##### 投資状況

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



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

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

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

## (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.37%
合計	98.37%

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

#### 八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド( B P I )

(1) 投資状況 (平成25年12月30日現在)

## 投資状況

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

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

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

## (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	73.32%
地方債証券	8.27%
特殊債券	8.72%
社債券	8.96%
合計	99.28%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

## 投資状況

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

## その他の資産の投資状況

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

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

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

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

## (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 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	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,358,000	117.90 745,278,794	115.71 731,479,442	4.250000 2023/10/25	0.48

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.97%
合計	97.97%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

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

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

[次へ](#)



## （参考情報）

2013年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	11,492円
純資産総額	10百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	3.4%
3か月間	9.4%
6か月間	15.5%
1年間	44.4%
3年間	57.1%
5年間	87.3%
設定来	14.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円						設定来分配金合計額: 0円		
	第1期 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	第6期 13年12月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
国内株式・先物	1,302	44.2%	日本円	58.2%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	2.1%
外国株式・先物	1,176	28.4%	米ドル	23.8%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.2%
国内リート	43	7.0%	ユーロ	7.6%	修正デュレーション	ソフトバンク	日本	1.1%
外国債券	683	6.8%	英ポンド	3.9%	残存年数	三井住友フィナンシャルG	日本	1.0%
国内債券	291	6.7%	豪ドル	1.7%	債券格付別構成	本田技研	日本	0.9%
外国リート	276	6.3%	カナダ・ドル	1.6%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.8%
			スイス・フラン	1.2%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.6%
			香港ドル	0.5%	A	日本リテールファンド	日本	0.5%
			スウェーデン・クローネ	0.5%	BBB	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.4%
コール・ローン、その他	1.1%		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	3,771	-	合計	100.0%	合計	合計		8.9%

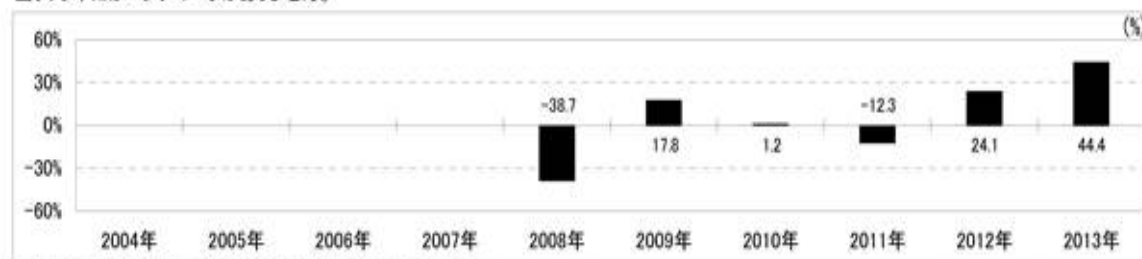
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.0%保有しております。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

### 2 【換金（解約）手続等】

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

#### < 一部解約 >

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・ お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

- ・ 委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

##### （注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

##### （注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・ お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

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

- ・ 委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

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

## (4) 【計算期間】

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

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

## (5) 【その他】

信託の終了

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

#### 信託約款の変更等

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

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

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

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

#### 運用報告書

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

#### 公告

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金にかかる請求権

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

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

#### 償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

#### 1 【財務諸表】

#### DCダイワ・ターゲットイヤー2040



DCダイワ・ターゲットイヤー2040  
(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 平成24年12月18日現在	第6期 平成25年12月18日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	14,919	43,547
親投資信託受益証券	3,368,612	9,722,316
未収入金	-	1,000
流動資産合計	3,383,531	9,766,863
資産合計	3,383,531	9,766,863
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	729	2,276
未払委託者報酬	9,129	27,705
その他未払費用	182	221
流動負債合計	10,040	30,202
負債合計	10,040	30,202
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 4,412,567	<sup>1</sup> 8,850,418
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 1,039,076	<sup>2</sup> 886,243
（分配準備積立金）	125,828	2,155,429
元本等合計	3,373,491	9,736,661
純資産合計	3,373,491	9,736,661
負債純資産合計	3,383,531	9,766,863

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	平成23年12月20日 至 平成24年12月18日	自	平成24年12月19日 至 平成25年12月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		319,905		2,128,704
営業収益合計		319,905		2,128,704
営業費用				
受託者報酬		1,307		3,740
委託者報酬		16,535		45,718
その他費用		365		403
営業費用合計		18,207		49,861
営業利益		301,698		2,078,843
経常利益		301,698		2,078,843
当期純利益		301,698		2,078,843
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		20,680		41,590
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		798,112		1,039,076
剰余金増加額又は欠損金減少額		704,861		67,397
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		704,861		67,397
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,226,843		179,331
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,226,843		179,331
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,039,076		886,243

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第6期	
	自 平成24年12月19日	至 平成25年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	平成24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
1. 1 期首元本額	2,153,020円	4,412,567円
期中追加設定元本額	4,521,213円	4,772,167円
期中一部解約元本額	2,261,666円	334,316円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,412,567口	8,850,418口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,039,076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5期	第6期
	自 平成23年12月20日 至 平成24年12月18日	自 平成24年12月19日 至 平成25年12月18日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(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。	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(2,037,253円)、投資信託約款に規定される収益調整金(134,201円)及び分配準備積立金(118,176円)より分配可能額は2,289,630円(1万口当たり2,587.03円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期	
	自 平成24年12月19日	至 平成25年12月18日

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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第5期 平成24年12月18日現在	第6期 平成25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	288,253	2,037,263
合計	288,253	2,037,263

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

第6期 自 平成24年12月19日 至 平成25年12月18日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期 平成24年12月18日現在	第6期 平成25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)	0.7645円 (7,645円)	1.1001円 (11,001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	5,988,897	4,288,050	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,816,460	2,808,792	
	外国債券インデックスマザーファンド	279,828	692,294	
	ダイワJ - R E I Tマザーファンド	381,725	675,500	
	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	395,195	574,692	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)	582,010	682,988	
親投資信託受益証券 合計			9,722,316	
合計			9,722,316	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

3. 収益及び費用の計上基準	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
----------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

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

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

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成24年12月19日 至 平成25年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 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25年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 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24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	5,830,993,362	3,419,546,418
新株予約権証券	-	4,926,600
合計	5,830,993,362	3,424,473,018

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

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

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	平成24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.4590円 (4,590円)	0.7160円 (7,160円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	41,000	263	10,783,000	
日本水産	115,700	228	26,379,600	
マルハニチロホールディングス	167,000	188	31,396,000	
サカタのタネ	13,400	1,320	17,688,000	
ホクト	9,400	1,911	17,963,400	
ショーボンドHD	6,900	4,530	31,257,000	
ミライト・ホールディングス	23,100	890	20,559,000	
住石ホールディングス	29,800	135	4,023,000	
日鉄鉱業	21,000	485	10,185,000	
三井松島	62,000	154	9,548,000	
国際石油開発帝石	375,400	1,262	473,754,800	
日本海洋掘削	2,000	6,130	12,260,000	
関東天然瓦斯	10,000	725	7,250,000	
石油資源開発	10,900	3,885	42,346,500	
安藤・間	51,100	326	16,658,600	
東急建設	28,800	454	13,075,200	
コムシスホールディングス	38,700	1,571	60,797,700	
ミサワホーム	8,800	1,572	13,833,600	
高松コンストラクションGP	6,600	1,749	11,543,400	
東建コーポレーション	3,150	4,950	15,592,500	
大成建設	392,000	445	174,440,000	
大林組	234,000	539	126,126,000	
清水建設	240,000	501	120,240,000	
飛鳥建設	51,200	153	7,833,600	
長谷工コーポレーション	103,200	747	77,090,400	
松井建設	13,000	405	5,265,000	
鹿島建設	343,000	367	125,881,000	
不動テトラ	58,400	168	9,811,200	
大末建設	35,000	116	4,060,000	
鉄建建設	49,000	281	13,769,000	
日鉄住金テックスエンジ	17,000	416	7,072,000	
西松建設	103,000	302	31,106,000	
三井住友建設	213,300	114	24,316,200	
大豊建設	23,000	315	7,245,000	
前田建設	49,000	639	31,311,000	
佐田建設	32,000	127	4,064,000	
奥村組	71,000	458	32,518,000	
東鉄工業	9,900	1,781	17,631,900	

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

富士電機	195,000	472	92,040,000
東洋電機製造	17,000	305	5,185,000
安川電機	77,000	1,521	117,117,000
シンフォニア テクノロジー	52,000	163	8,476,000
明電舎	68,000	376	25,568,000
山洋電気	12,000	613	7,356,000
デンヨー	7,900	1,365	10,783,500
日立工機	20,600	739	15,223,400
三桜工業	14,500	717	10,396,500
マキタ	44,800	5,240	234,752,000
東芝テック	44,000	667	29,348,000
マブチモーター	9,800	6,190	60,662,000
日本電産	37,200	9,800	364,560,000
東光高岳HD	3,600	1,858	6,688,800
ダイヘン	43,000	468	20,124,000
JVCケンウッド	53,900	186	10,025,400
第一精工	3,700	1,215	4,495,500
日新電機	15,000	613	9,195,000
大崎電気	14,000	525	7,350,000
オムロン	77,700	4,335	336,829,500
日東工業	10,700	1,587	16,980,900
I D E C	11,100	856	9,501,600
ジーエス・ユアサ コーポ	133,000	589	78,337,000
メルコホールディングス	4,600	1,296	5,961,600
日本電気	957,000	226	216,282,000
富士通	668,000	497	331,996,000
沖電気	273,000	240	65,520,000
岩崎通信機	46,000	95	4,370,000
電気興業	22,000	697	15,334,000
サンケン電気	39,000	697	27,183,000
アイホン	3,900	1,708	6,661,200
ルネサスエレクトロニクス	35,700	669	23,883,300
セイコーエプソン	47,200	2,701	127,487,200
ワコム	55,400	671	37,173,400
アルバック	12,100	1,386	16,770,600
アクセル	4,900	1,716	8,408,400
E I Z O	6,800	2,557	17,387,600
日本信号	19,500	807	15,736,500
能美防災	10,000	1,002	10,020,000
日本無線	21,000	326	6,846,000
パナソニック	788,600	1,183	932,913,800
シャープ	499,000	330	164,670,000
アンリツ	40,200	1,139	45,787,800
富士通ゼネラル	17,000	1,074	18,258,000
日立国際電気	14,000	1,409	19,726,000
ソニー	378,800	1,780	674,264,000
T D K	41,700	4,810	200,577,000
ミツミ電機	27,900	876	24,440,400
タムラ製作所	33,000	282	9,306,000
アルプス電気	51,400	1,141	58,647,400
パイオニア	97,800	215	21,027,000
日本電波工業	8,400	865	7,266,000
日本トリム	1,600	7,820	12,512,000
ローランド ディー・ジー	3,400	3,270	11,118,000
フオスタ - 電機	7,600	1,910	14,516,000

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

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

新株予約権証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成24年12月19日 至 平成25年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。  (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

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

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

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成24年12月19日 至 平成25年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 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25年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 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24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	557,323,594	1,480,971,021
投資証券	12,091,864	27,681,707
合計	569,415,458	1,508,652,728

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

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

## （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

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

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

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

[次へ](#)

## (2) 株式以外の有価証券

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

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

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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



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

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成25年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 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24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	3,547,436,380	898,472,941

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

(1口当たり情報)

	平成24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2809円 (12,809円)	1.7696円 (17,696円)

附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

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

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

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

## 「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## （貸借対照表に関する注記）

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

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成24年12月19日 至 平成25年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 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25年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 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24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	7,513,745	17,333,763
合計	7,513,745	17,333,763

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

## (1口当たり情報)

	平成24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1776円 (11,776円)	1.4542円 (14,542円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	700	20,762.000	
		EXCEL TRUST INC	500	5,780.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,300	153,309.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,247	495,492.200	
		GRAMERCY PROPERTY TRUST	400	2,168.000	

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

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



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

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

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

投資証券 合計		803,893,209 [803,893,209]	
合計		803,893,209 [803,893,209]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

## 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成24年12月19日 至 平成25年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券  個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

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

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

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 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	平成24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	28,101,780	10,328,440
地方債証券	1,428,252	1,855,998
特殊債券	1,106,887	1,712,800
社債券	848,052	1,188,333
合計	31,484,971	15,085,571

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

## （1口当たり情報）

	平成24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1479円 (11,479円)	1.1735円 (11,735円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	3 2 6 2年国債	50,000,000	50,012,000	
	3 2 7 2年国債	120,000,000	120,031,200	
	3 2 9 2年国債	45,000,000	45,076,500	
	3 3 0 2年国債	30,000,000	30,051,600	
	3 3 1 2年国債	100,000,000	100,016,000	
	3 3 2 2年国債	58,000,000	58,009,860	
	3 3 3 2年国債	20,000,000	20,001,800	
	3 3 4 2年国債	45,000,000	45,004,050	
	8 8 5年国債	118,000,000	118,617,140	
	8 9 5年国債	115,000,000	115,541,650	
	9 0 5年国債	10,000,000	10,032,100	
	9 1 5年国債	63,000,000	63,340,830	
	9 2 5年国債	140,000,000	140,513,800	

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



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

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

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

1 2 1	20年国債	61,000,000	67,048,760	
1 2 2	20年国債	14,000,000	15,182,020	
1 2 3	20年国債	47,000,000	52,972,290	
1 2 4	20年国債	33,000,000	36,701,610	
1 2 5	20年国債	28,000,000	31,932,320	
1 2 6	20年国債	21,000,000	23,300,550	
1 2 7	20年国債	23,000,000	25,174,650	
1 2 8	20年国債	35,000,000	38,183,950	
1 2 9	20年国債	34,000,000	36,579,580	
1 3 0	20年国債	32,000,000	34,332,160	
1 3 1	20年国債	40,000,000	42,276,800	
1 3 2	20年国債	25,000,000	26,343,250	
1 3 3	20年国債	46,000,000	49,211,260	
1 3 4	20年国債	25,000,000	26,666,500	
1 3 5	20年国債	24,000,000	25,211,280	
1 3 6	20年国債	25,000,000	25,858,000	
1 3 7	20年国債	18,000,000	18,848,700	
1 3 8	20年国債	25,000,000	25,367,250	
1 3 9	20年国債	35,000,000	36,081,500	
1 4 0	20年国債	77,000,000	80,371,060	
1 4 1	20年国債	46,000,000	47,891,060	
1 4 2	20年国債	35,000,000	37,017,750	
1 4 3	20年国債	48,000,000	49,009,440	
1 4 4	20年国債	25,000,000	25,112,500	
1 4 5	20年国債	77,000,000	79,683,450	
1 4 6	20年国債	87,000,000	89,787,480	
国債証券 合計			10,903,951,230	
地方債証券	6 2 4 東京都公債	100,000,000	102,049,900	
	6 5 3 東京都公債	100,000,000	105,328,800	
	2 0 - 6 北海道公債	100,000,000	106,606,100	
	2 9 3 大阪府公債	100,000,000	105,103,500	
	2 4 - 1 6 愛知県公債	100,000,000	100,859,600	
	2 1 - 2 埼玉県公債	100,000,000	106,931,400	
	2 7 共同発行地方	34,000,000	34,594,864	
	3 0 共同発行地方	50,000,000	51,023,950	
	7 6 共同発行地方	100,000,000	106,151,100	
	1 1 7 共同発行地方	100,000,000	100,599,200	
	2 1 - 6 大阪市公債	100,000,000	107,228,500	
	1 8 - 4 札幌市公債	100,000,000	104,497,300	
	1 8 - 2 北九州市債	100,000,000	104,781,400	
地方債証券 合計			1,235,755,614	
特殊債券	1 6 政保政策投資 B	100,000,000	105,253,300	
	5 日本政策投資 C O	100,000,000	107,432,600	
	2 7 政保道路機構	50,000,000	52,626,650	
	5 6 政保道路機構	100,000,000	105,146,000	
	1 2 2 政保道路機構	100,000,000	103,262,600	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	99,549,700	
	2 政保地方公営機	100,000,000	106,649,500	
	2 6 公営企業	100,000,000	105,118,700	
	1 3 首都高速道路	100,000,000	101,577,000	
	2 7 国際協力銀行	100,000,000	105,056,200	
	3 0 国際協力銀行	100,000,000	106,824,800	
	2 成田国際空港	100,000,000	102,808,000	

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

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成24年12月19日 至 平成25年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券  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、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

## (貸借対照表に関する注記)

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

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

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成24年12月19日 至 平成25年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 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25年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 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24年12月18日現在	平成25年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	371,009,306	554,438,294
合計	371,009,306	554,438,294

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

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

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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



## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成25年12月30日

資産総額	10,121,059円
負債総額	2,243円
純資産総額（ - ）	10,118,816円
発行済数量	8,805,382口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1492円

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

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

## (参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

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

## (参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

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

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

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

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

## (参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド( B P I )

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

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

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

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

#### 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成25年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

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

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,745,233	14,380,327
有価証券	19,655,070	9,427,636
前払金	314	207
前払費用	90,562	142,919
未収入金	11,931	521,825
未収委託者報酬	6,516,540	7,183,011
未収収益	55,102	106,914
貯蔵品	11,888	9,551
繰延税金資産	630,508	491,727
その他	190,450	8,445
流動資産計	30,907,602	32,272,567
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	1,003,450	254,258
器具備品（純額）	513,162	26,257
リース資産（純額）	484,571	222,274
リース資産（純額）	-	5,726
建設仮勘定	5,715	-
無形固定資産	2,870,849	3,194,512
ソフトウェア	2,173,517	3,132,238
ソフトウェア仮勘定	684,878	50,423
電話加入権	11,850	11,850

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

(単位:千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
リース債務	-	1,227
預り金	55,551	56,491
未払金	7,194,946	6,795,899
未払収益分配金	17,954	10,333
未払償還金	88,334	113,002
未払手数料	3,386,380	3,764,501
その他未払金	2	2,908,061
未払費用	3,313,011	3,383,551
未払法人税等	963,539	588,040
未払消費税等	229,365	189,139
賞与引当金	307,000	841,300
本社移転関連費用引当金	346,425	-
資産除去債務	292,000	-
その他	87,535	-
流動負債計	12,789,375	11,855,648
<b>固定負債</b>		
リース債務	-	4,494
退職給付引当金	1,670,344	1,935,442
役員退職慰労引当金	68,068	67,410
繰延税金負債	1,782,558	1,740,407
固定負債計	3,520,970	3,747,753
負債合計	16,310,345	15,603,402
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727

利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	7,715,116	7,722,723
利益剰余金合計	8,089,414	8,097,020
株主資本合計	34,759,414	34,767,020
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	33,879	464,350
繰延ヘッジ損益	53,783	-
評価・換算差額等合計	87,663	464,350
純資産合計	34,847,077	35,231,371
負債・純資産合計	51,157,423	50,834,773



## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

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

（単位：千円）

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

当期末残高

34,847,077

35,231,371

## 注記事項

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法により計上しております。

## 3. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産

## (リース資産を除く)

定率法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 6～47年

器具備品 3～20年

## (会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

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

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

## (2) 無形固定資産(リース資産を除く)

定額法によっております。

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

## (3) 長期前払費用

定額法によっております。

(4)リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

4.引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

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

(4)役員退職慰労引当金

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

(5)本社移転関連費用引当金

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

5.ヘッジ会計の方法

(1)ヘッジ会計の方法

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

(2)ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段・・・株価指数先物

ヘッジ対象・・・投資有価証券

(3)ヘッジ方針

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

(4)ヘッジ有効性評価の方法

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

## 6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

### (表示方法の変更)

#### (損益計算書)

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

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

### (貸借対照表関係)

#### 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

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

#### 2 関係会社項目

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

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

#### 3 保証債務

前事業年度（平成24年3月31日現在）

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

当事業年度（平成25年3月31日現在）

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

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

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

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

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

3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

場所 千葉県浦安市

用途 賃貸等不動産（浦安寮）

種類 建物及び土地

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

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

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。



## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 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とおり提案しております。

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2．配当に関する事項

## （1）配当金支払額

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

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

## （ ）為替変動リスクの管理

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

## （ ）価格変動リスクの管理

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

## （ ）デリバティブ取引

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

## 信用リスクの管理

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

## （４）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## ２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成24年３月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 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。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

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

## 資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収入金

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

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

## 負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

## デリバティブ取引

注記事項（デリバティブ取引関係）をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

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

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

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 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	-

当事業年度(平成25年3月31日現在)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成24年3月31日現在)

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

当事業年度(平成25年3月31日現在)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成24年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (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。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	売却額 (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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

#### 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

#### (デリバティブ取引関係)

##### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

前事業年度(平成24年3月31日現在)

株式関連

(単位:千円)

区分	デリバティブ 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。

当事業年度(平成25年3月31日現在)

該当事項はありません。

##### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

#### (退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

##### 2. 退職給付債務に関する事項

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

## 3. 退職給付費用に関する事項

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

(注) 「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：千円)

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



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

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

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

## （資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

### 1．当該資産除去債務の概要

旧日本の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

### 2．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

### 3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

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

### 4．当該資産除去債務の金額の見積りの変更

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

## （セグメント情報等）

### [ セグメント情報 ]

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

### [ 関連情報 ]

#### 1．サービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

### (1) 営業収益

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

### (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	76,217	76,217

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

### 1. 関連当事者との取引

#### (ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (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。

## 当事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

## 前事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 または 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	20,510,864	未払手数料	2,758,584
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,205,721	未払費用	82,519
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料	1,194,567	長期差入保証金 未収入金	971,157 511,559

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

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

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

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

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

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

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

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

法人税等調整額	119,063
中間純利益	5,117,251

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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



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

## 注記事項

(重要な会計方針)

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

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。</p> <p>(2) その他有価証券 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。</p> <p>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. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く） 定額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。</p> <table data-bbox="598 616 1141 683"> <tr> <td>建物</td> <td>6～47年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3～20年</td> </tr> </table> <p>（会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更） 当社は、当中間会計期間より有形固定資産（投資不動産を含む）の減価償却方法を定率法から定額法に変更いたしました。 この変更は、本社移転を契機に当社の有形固定資産の使用実態を見直した結果、当社において使用する有形固定資産は安定的に使用されており、その投資効果は、耐用年数の期間中に平均的・安定的に発現するものであるため、定額法が当社の企業活動をより適切に反映した減価償却方法であると判断したためであります。 この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微です。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 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> <p>(4) リース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>	建物	6～47年	器具備品	3～20年
建物	6～47年				
器具備品	3～20年				
<p>3. 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 貸倒引当金 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 役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>				

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。 (2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。
------------------------------	---

## (中間貸借対照表関係)

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

## (中間損益計算書関係)

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

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 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25年6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

(金融商品関係)

当中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：千円)

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

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

## &lt;注1&gt;金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払金及び(2) 未払費用

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

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

(有価証券関係)

当中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

#### 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

#### 2. その他有価証券

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

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

## [ 関連情報 ]

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

## 1. サービスごとの情報

当社のサービスは、単一であるため記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## ( 1 ) 営業収益

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

## ( 2 ) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

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

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

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

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

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

該当事項はありません。

## ( 1 株当たり情報 )

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

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

2 . 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

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

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

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

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



## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成25年3月末日現在）

事業の内容

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

#### (2) 販売会社

名称 大和証券株式会社

資本金の額 100,000百万円（平成25年3月末日現在）

事業の内容 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 2 【関係業務の概要】

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

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

### 3 【資本関係】

該当ありません。

#### < 再信託受託会社の概要 >

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成25年3月末日現在）

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

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

### 第3 【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

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

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

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

## 独立監査人の監査報告書

平成26年1月31日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成24年12月19日から平成25年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成25年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

（注2）財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年 5月29日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 利害関係

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

以 上

---

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年11月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

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

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

### 中間監査意見

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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