【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29年2月21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　岩本　信之
【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】	山村　政 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】	ダイワライフスタイル７５
【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29年2月22日から平成30年2月21日まで） 5,000億円を上限とします。
【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】

ダイワライフスタイル７５

(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】

5,000億円を上限とします。

(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】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問合わせる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）

② 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。

③ 「分配金再投資コース」の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】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・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）

(7) 【申込期間】

平成29年2月22日から平成30年2月21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】

① 受益権の取得申込者は、申込取扱場所において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。

② 委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

③ 当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

④ 「分配金再投資コース」を利用する場合、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を締結します。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。）。

⑤ 取得申込金額に利息は付きません。

⑥ 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。

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、信託財産の中長期的な成長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
	補足分類	インデックス型
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　資産配分固定型（株式、債券）））
	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
	対象インデックス	その他の指数（合成インデックス）

※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
- 「インデックス型」…目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす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　資産配分固定型」…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固定的とする旨の記載があるもの
- 「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- 「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの

・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
・「その他の指数」…日経225、ＴＯＰＩＸにあてはまらないすべてのもの

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）	補足分類
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	インデックス型 特殊型

（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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 資産複合　資産配分固定型（株式、債券）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （含む日本） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　　） なし	日経225 TOPIX その他 （合成インデックス）

（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。

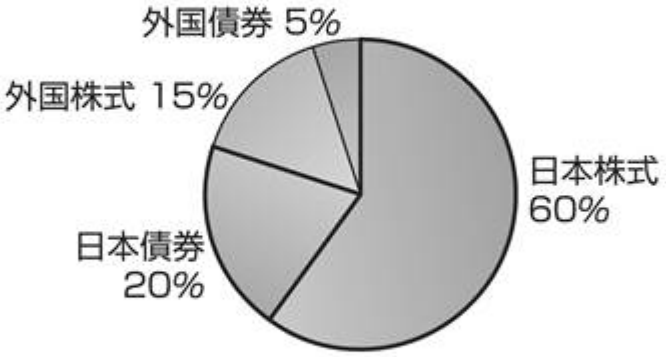
＜信託金の限度額＞
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国　内	海　外	合　計
株　式	60%	15%	75%
債　券	20%	5%	25%
合　計	80%	20%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

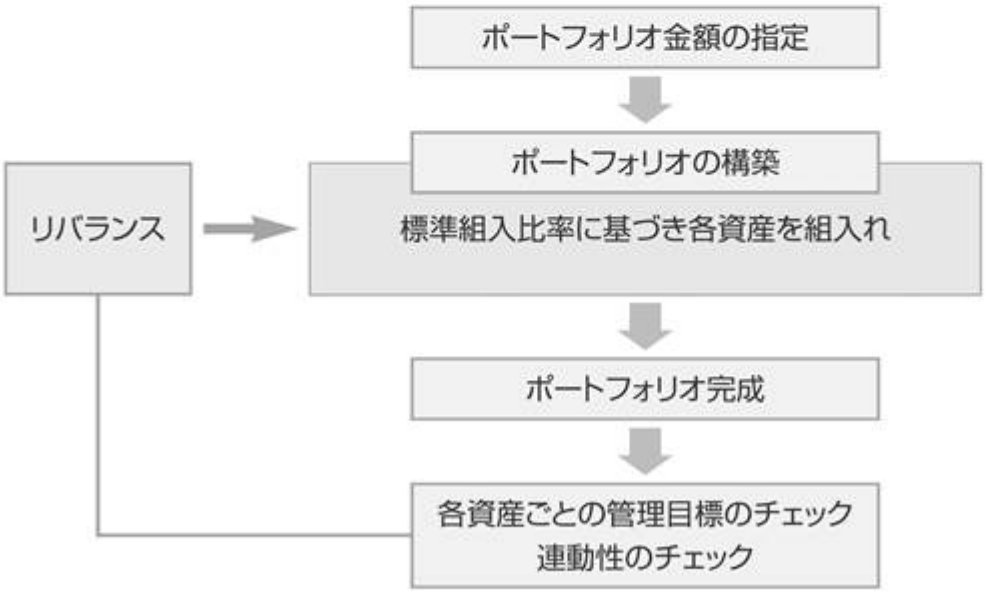
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

●合成ベンチマークとは、各資産ごとのベンチマークの騰落率を標準組入比率に乗じて指数化したものです。

各資産ごとのベンチマーク

日本株式	東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）
日本債券	ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数
外国株式	ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）
外国債券	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）

運用プロセス



- 標準組入比率にしたがって、各資産へ投資し、ポートフォリオを構築します。
- 合成ベンチマークに連動する投資成果をめざすため、各資産ごとのウェイトが標準組入比率から乖離しないよう管理目標を設定し、各資産の比率をその範囲内に維持するように運用を行ないます。
- 各資産の価格変動により、各資産の組入比率が管理目標を超えた場合は、標準組入比率に近づける方向へリバランスを行ないます。

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。

・市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。
・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.および2.の運用が行なわれないことがあります。

3 毎年11月30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。

〈分配方針〉
①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
②原則として、配当等収益等を中心に分配します。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。

各マザーファンドの運用プロセス

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル(注)を用いてポートフォリオを構築します。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。

2．日本債券インデックスマザーファンド

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデル(注)の使用により効率的なＤＢＩ総合指数の複製を行ない同指数と連動するポートフォリオを構築します。またＤＢＩ総合指数の構成銘柄変更等に対しては、マルチファクターモデルを使用しポートフォリオのリバランスを行ないます。

（注）マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。このモデルを用いることにより、イールドカーブファクター、スプレッドファクター、スペシフィックファクターなどについてリスクの計測、分析、推定を行ないポートフォリオを効率的に構築および管理することができます。

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数とは

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスであり、下記の債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

対　象：日本で発行されている確定利付公募債券
残存額：50億円以上
期　間：残存期間1年以上
種　類：国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債

3. 外国株式インデックスマザーファンド

ＭＳＣＩコクサイ指数に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル(注)を用いてポートフォリオを構築します。ＭＳＣＩコクサイ指数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. 外国債券インデックスマザーファンド

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）に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、各通貨別にリスクモデル(注)を用いて、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とマザー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ポートフォリオを構築します。また、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、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とマザー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することで、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の測定・管理やポートフォリオの効率的な複製を行なうことなどができます。

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。

(2) 【ファンドの沿革】

平成12年 4月28日　　信託契約締結、当初設定、運用開始
平成12年12月 1日　　ファンドの名称の変更（従来は「ライフスタイル７５」）

(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。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）

委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

受託会社	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充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）、 わが国の公社債、外国の株式（預託証書を含みます。）、 外国の公社債　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

＜委託会社の概況（平成28年12月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

名　称	住　所	所有株式数	比率
		株	%
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	2,608,525	100.00

2　【投資方針】

(1)　【投資方針】

①　主要投資対象

トピックス・インデックス・マザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンドおよび外国債券インデックスマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

②　投資態度

イ．主として、上記に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の60%

日本債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%
外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の5%

ハ．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。

ニ．保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。

ホ．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

ヘ．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。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(2) 【投資対象】

① 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次の1．から4．までに掲げる親投資信託（以下、総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の5．から25．までに掲げる有価証券（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．トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券
2．日本債券インデックスマザーファンド受益証券
3．外国株式インデックスマザーファンド受益証券
4．外国債券インデックスマザーファンド受益証券
5．株券または新株引受権証書
6．国債証券
7．地方債証券
8．特別の法律により法人の発行する債券
9．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。）
10．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。）
11．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。）
12．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。）
13．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。）
14．コマーシャル・ペーパー

15．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
16．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前5.から前15.までの証券または証書の性質を有するもの
17．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。）
18．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。）
19．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。）
20．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。）
21．外国法人が発行する譲渡性預金証書
22．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。）
23．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。）
24．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
25．外国の者に対する権利で前24.の有価証券の性質を有するもの

なお、前5.の証券または証書ならびに前16.および前20.の証券または証書のうち前5.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6.から前10.までの証券ならびに前18.の証券のうち投資法人債券ならびに前16.および前20.の証券または証書のうち前6.から前10.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前17.の証券および前18.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

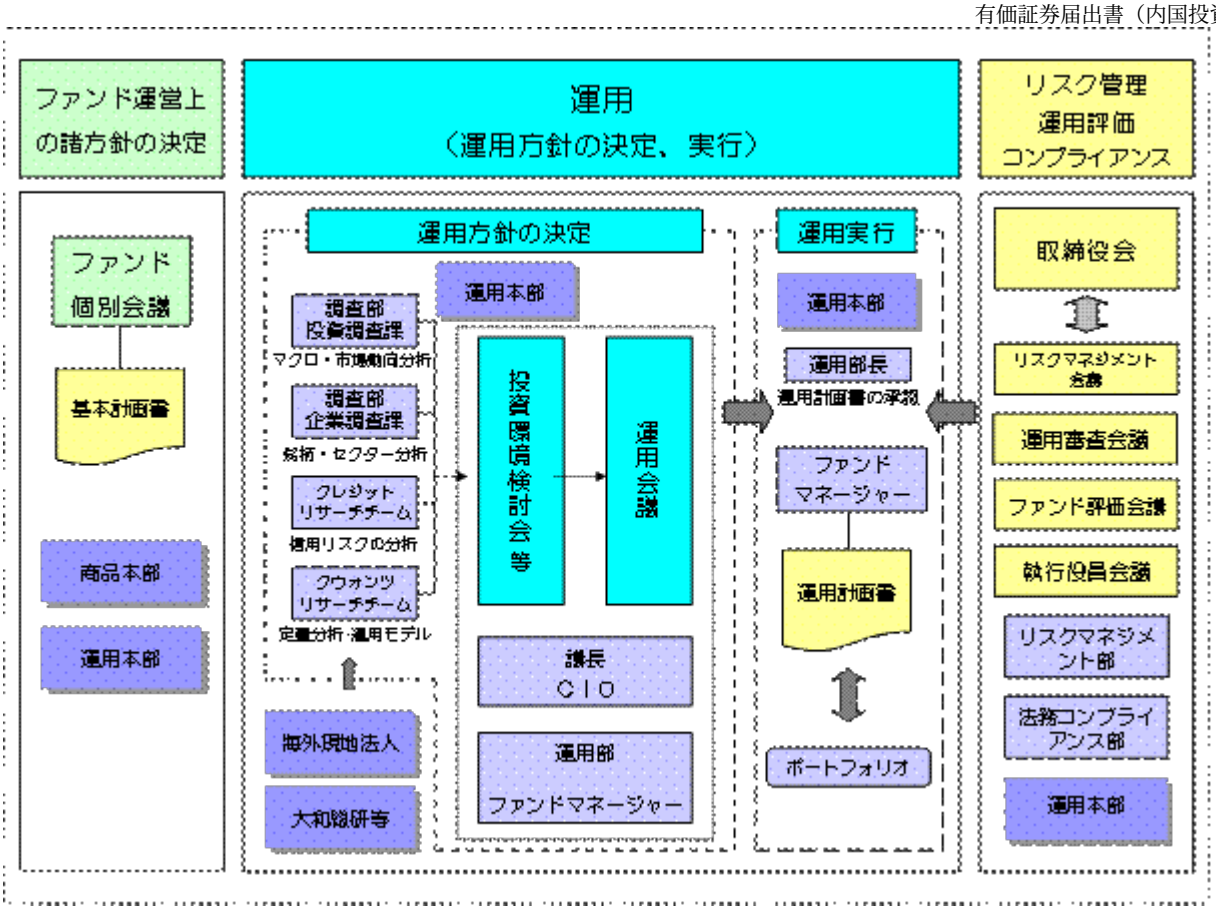
③ 前①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前② 1.から4.の金融商品により運用することの指図ができます。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者である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。

③ 職務権限

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

イ．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の的確な状況報告
・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5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（0～5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。

④　ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議
次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。

イ．ファンド評価会議
運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

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

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

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

⑤　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28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】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
②　原則として、配当等収益等を中心に分配します。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。
③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

① 株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

② 新株引受権証券等（信託約款）

イ．委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、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新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③ 投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所（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。以下同じ。）に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、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投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．前イ.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、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当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑥ 信用取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

ロ．信用取引の指図は、次の1.から6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

5．信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（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。）の行使により取得可能な株券

6．信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑦　先物取引等（信託約款）

イ．委託会社は、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て取扱うものとします（以下同じ。）。

1．先物取引の売建およびコール・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、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券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)②の1.から4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション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、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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外貨建資産の時価総額の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。

ハ．委託会社は、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)②の1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建およびプット・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前(2)②の1.から4.に掲げる金融商品で運用している額（以下本2.において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建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が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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。

⑧　スワップ取引（信託約款）

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、異なった通貨、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とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）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合計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．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

⑨　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引および為替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とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）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の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計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．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品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の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）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、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ヘ．前ホ.においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産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の割合を乗じて得た額をいいます。

ト．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

チ．委託会社は、金利先渡取引および為替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。

⑩　デリバティブ取引等（信託約款）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

⑪　同一銘柄の転換社債等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑫　有価証券の貸付け（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.および2.の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ．前イ.の1.および2.に定める限度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契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

⑬　外貨建資産（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、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。

⑭　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。

⑮　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。

⑯　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より支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　基本的な投資態度

わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

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は、行ないません。

信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、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。

信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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わが国の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。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り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。

（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．日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数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．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦通貨表示のものに限ります。）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（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．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．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 外貨建資産への投資は、行ないません。

（注）ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数とは

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスであり、下記の債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

対　象：日本で発行されている確定利付公募債券
残存額：50億円以上
期　間：残存期間1年以上
種　類：国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

（注）ＭＳＣＩコクサイ指数とは

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

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

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象
外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

(2) 投資対象

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

1．転換社債の転換、新株予約権（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外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債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。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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。組入実質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。

なお、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行ないません。このため、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カントリー・リスク

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

④　その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3) その他の留意点

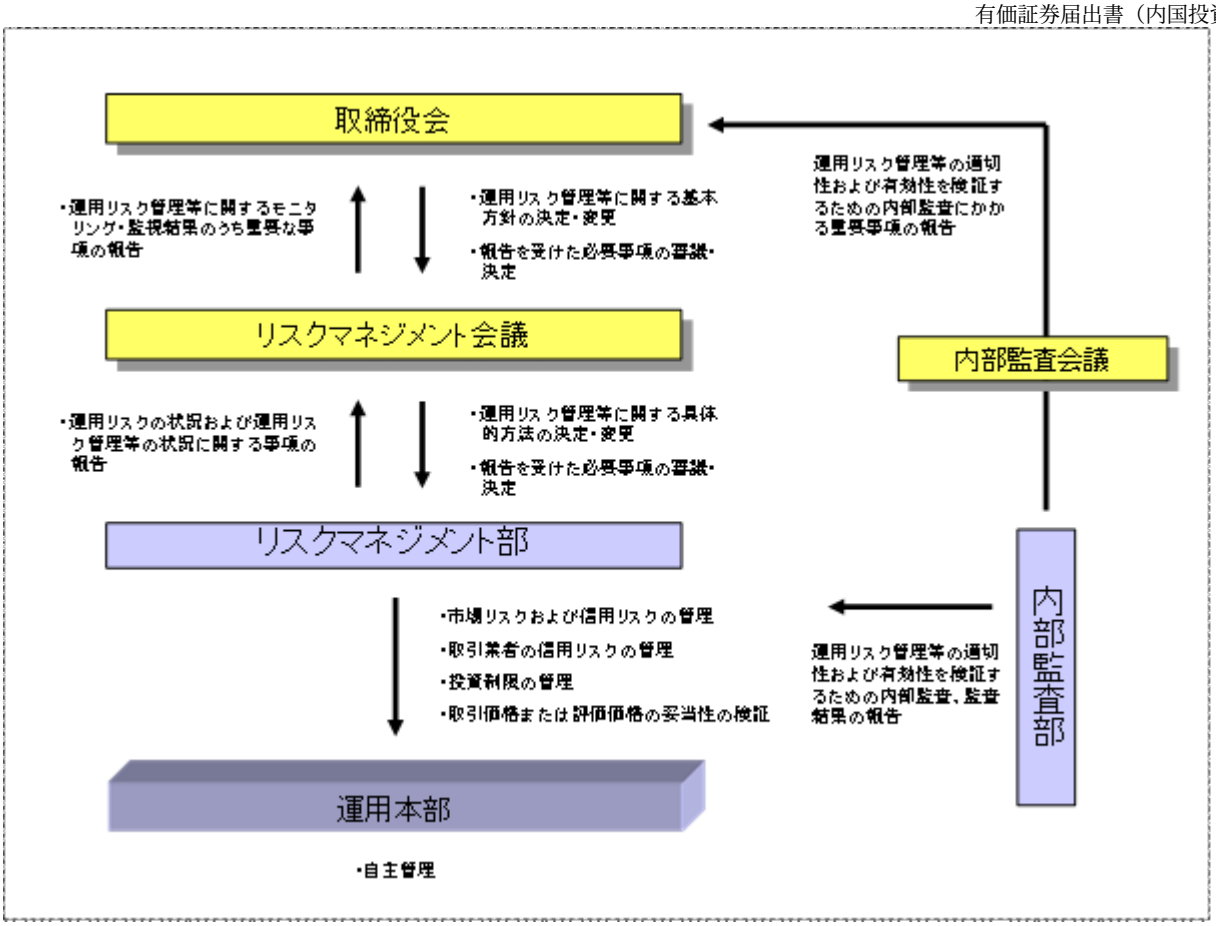
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドは、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが合成ベンチマークと完全に一致するものではありません。

・各資産の価格変動により、各資産の組入比率が標準組入比率と一致するとは限らないこと
・各資産の騰落率が各資産ごとのベンチマークの騰落率と一致するものではないこと
・信託報酬、売買委託手数料等の費用負担

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。

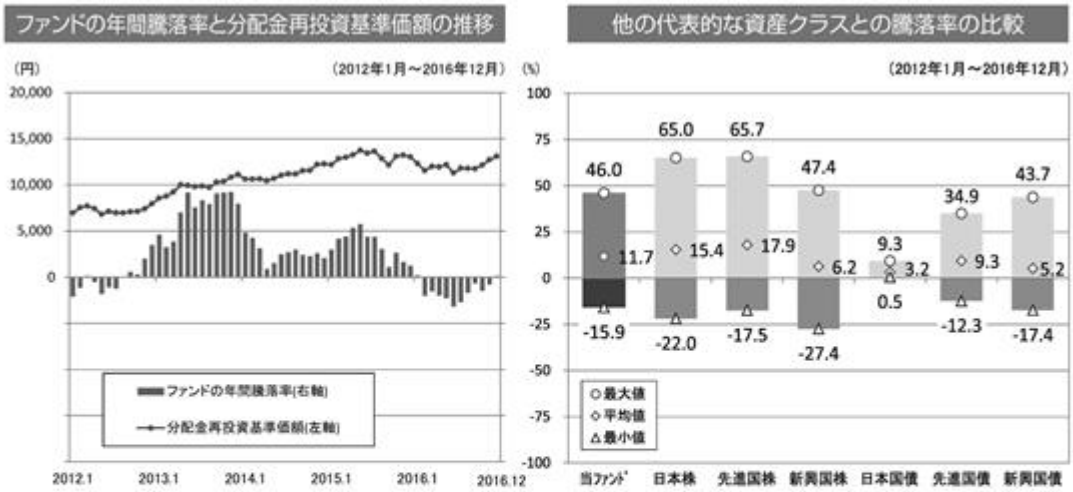


※　流動性リスクに対する管理体制

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

参考情報

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



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

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

※指数について
●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。
Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4　【手数料等及び税金】

(1)　【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問合わせる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）

②　申込手数料には、消費税等が課されます。

③　「分配金再投資コース」の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】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.972%（税抜0.90%）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信託財産中から支弁するものとします。

② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.35% （税抜）	年率0.47% （税抜）	年率0.08% （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。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、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。

＜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。

① 個人の投資者に対する課税

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（配当控除の適用があります。）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（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差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および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。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および償還差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。

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたＮＩＳＡをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

② 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収※され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。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15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

③ 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、前②にかかわらず所得税がかかりません。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。

＜注1＞個別元本について

① 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。

② 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。

③ 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

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

② 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28年12月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成28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	783,198,603	99.70
内 日本	783,198,603	99.70
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,334,420	0.30
純資産総額	785,533,023	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28年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	507,905,354	0.8937 453,915,037	0.9248 469,710,871	59.80
2	日本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	110,870,251	1.4003 155,257,075	1.3930 154,442,259	19.66
3	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	57,808,321	1.9489 112,662,643	2.0719 119,773,060	15.25
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	14,499,691	2.6275 38,099,270	2.7085 39,272,413	5.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.70%
合計	99.70%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第8計算期間末 (平成19年11月30日)	283,009,107	283,009,107	1.0876	1.0876
第9計算期間末 (平成20年12月1日)	219,693,052	219,693,052	0.6871	0.6871
第10計算期間末 (平成21年11月30日)	275,496,805	275,496,805	0.7254	0.7254
第11計算期間末 (平成22年11月30日)	317,352,187	317,352,187	0.7453	0.7453
第12計算期間末 (平成23年11月30日)	312,447,792	312,447,792	0.6722	0.6722
第13計算期間末 (平成24年11月30日)	362,100,467	362,100,467	0.7401	0.7401
第14計算期間末 (平成25年12月2日)	537,151,204	537,151,204	1.0806	1.0806
第15計算期間末 (平成26年12月1日)	647,563,978	647,563,978	1.2277	1.2277
第16計算期間末 (平成27年11月30日)	734,908,867	734,908,867	1.3210	1.3210
平成27年12月末日	733,997,912	－	1.3006	－
平成28年1月末日	696,698,668	－	1.2291	－

2月末日	660,309,431	―	1.1541	―
3月末日	693,379,273	―	1.1991	―
4月末日	692,462,579	―	1.1940	―
5月末日	711,497,473	―	1.2176	―
6月末日	664,067,865	―	1.1286	―
7月末日	697,424,496	―	1.1785	―
8月末日	696,131,963	―	1.1780	―
9月末日	696,654,317	―	1.1741	―
10月末日	725,770,674	―	1.2132	―
第17計算期間末 (平成28年11月30日)	760,338,807	760,338,807	1.2701	1.2701
12月末日	785,533,023	―	1.3085	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第8計算期間	△0.7
第9計算期間	△36.8
第10計算期間	5.6
第11計算期間	2.7
第12計算期間	△9.8
第13計算期間	10.1
第14計算期間	46.0

第15計算期間	13.6
第16計算期間	7.6
第17計算期間	△3.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第8計算期間	70,748,953	28,638,337
第9計算期間	79,284,787	19,753,272
第10計算期間	83,697,312	23,652,130
第11計算期間	81,429,409	35,405,267
第12計算期間	72,376,535	33,373,557
第13計算期間	68,276,957	43,805,781
第14計算期間	106,367,593	98,573,500
第15計算期間	88,503,723	58,126,096
第16計算期間	101,015,060	72,136,389
第17計算期間	85,325,672	42,999,115

（参考）マザーファンド
トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成28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		125,687,468,790	99.35
	内 日本	125,687,468,790	99.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		822,219,580	0.65
純資産総額		126,509,688,370	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)		728,640,000	0.58
	内 日本	728,640,000	0.58

(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28年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ﾄﾖﾀ自動車	日本	株式	輸送用機器	689,900	5,952.00 4,106,284,800	6,878.00 4,745,132,200	3.75
2	三菱UFJﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	4,246,500	515.40 2,188,646,100	720.20 3,058,329,300	2.42
3	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	449,400	4,615.81 2,074,345,603	4,912.00 2,207,452,800	1.74
4	三井住友ﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	448,500	3,438.06 1,541,971,484	4,460.00 2,000,310,000	1.58
5	ｿﾌﾄﾊﾞﾝｸｸﾞﾙｰﾌﾟ	日本	株式	情報･通信業	252,200	6,477.00 1,633,499,400	7,765.00 1,958,333,000	1.55
6	本田技研	日本	株式	輸送用機器	510,600	2,963.92 1,513,381,548	3,415.00 1,743,699,000	1.38
7	ＫＤＤＩ	日本	株式	情報･通信業	554,100	3,067.86 1,699,906,080	2,959.50 1,639,858,950	1.30
8	みずほﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	7,597,700	174.20 1,323,519,340	209.80 1,593,997,460	1.26
9	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	352,300	3,966.41 1,397,369,231	3,844.00 1,354,241,200	1.07
10	ソ ニ ー	日本	株式	電気機器	400,600	3,319.85 1,329,934,030	3,275.00 1,311,965,000	1.04
11	ﾌｧﾅｯｸ	日本	株式	電気機器	57,500	16,950.87 974,675,134	19,815.00 1,139,362,500	0.90
12	ＮＴＴﾄﾞｺﾓ	日本	株式	情報･通信業	418,500	2,559.68 1,071,227,864	2,663.00 1,114,465,500	0.88
13	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	109,800	9,004.05 988,645,030	10,100.00 1,108,980,000	0.88
14	東京海上ＨＤ	日本	株式	保険業	226,600	3,899.81 883,698,811	4,796.00 1,086,773,600	0.86
15	武田薬品	日本	株式	医薬品	222,600	4,644.00 1,033,754,400	4,835.00 1,076,271,000	0.85
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	421,000	2,125.91 895,011,534	2,490.00 1,048,290,000	0.83

17	セブン&アイ･HLDGS	日本	株式	小売業	234,400	4,545.31 1,065,421,837	4,453.00 1,043,783,200	0.83
18	キーエンス	日本	株式	電気機器	12,900	73,460.00 947,634,000	80,200.00 1,034,580,000	0.82
19	キヤノン	日本	株式	電気機器	304,500	2,904.21 884,331,947	3,295.00 1,003,327,500	0.79
20	三菱電機	日本	株式	電気機器	605,000	1,254.95 759,245,320	1,629.50 985,847,500	0.78
21	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	607,200	1,569.50 953,000,400	1,623.50 985,789,200	0.78
22	三菱地所	日本	株式	不動産業	417,000	1,875.65 782,146,550	2,327.50 970,567,500	0.77
23	信越化学	日本	株式	化学	106,700	7,037.67 750,920,156	9,067.00 967,448,900	0.76
24	村田製作所	日本	株式	電気機器	59,600	13,356.88 796,070,316	15,650.00 932,740,000	0.74
25	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	47,200	17,465.00 824,348,000	19,230.00 907,656,000	0.72
26	日 立	日本	株式	電気機器	1,360,000	473.40 643,824,000	632.00 859,520,000	0.68
27	任 天 堂	日本	株式	その他製品	35,000	27,305.70 955,699,500	24,540.00 858,900,000	0.68
28	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	200,500	3,631.85 728,186,515	4,214.00 844,907,000	0.67
29	富士重工業	日本	株式	輸送用機器	176,300	3,818.70 673,238,420	4,772.00 841,303,600	0.67
30	花 王	日本	株式	化学	151,300	5,658.51 856,133,705	5,541.00 838,353,300	0.66

(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	99.35%
合計	99.35%

(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	0.11%

鉱業	0.36%
建設業	3.03%
食料品	4.44%
繊維製品	0.71%
パルプ・紙	0.23%
化学	6.49%
医薬品	4.75%
石油・石炭製品	0.51%
ゴム製品	0.91%
ガラス・土石製品	0.95%
鉄鋼	1.27%
非鉄金属	0.90%
金属製品	0.69%
機械	4.96%
電気機器	12.25%
輸送用機器	9.71%
精密機器	1.55%
その他製品	1.79%
電気・ガス業	1.89%
陸運業	4.29%
海運業	0.22%
空運業	0.54%
倉庫・運輸関連業	0.21%
情報・通信業	7.66%
卸売業	4.34%
小売業	4.73%
銀行業	8.46%
証券、商品先物取引業	1.22%
保険業	2.60%
その他金融業	1.30%
不動産業	2.61%
サービス業	3.66%
合計	99.35%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2017年3月	買建	48	740,110,920	728,640,000	0.58%

(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。

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成28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		42,926,690,760	79.81
	内 日本	42,926,690,760	79.81
地方債証券		3,807,010,050	7.08
	内 日本	3,807,010,050	7.08
特殊債券		3,380,821,021	6.29
	内 日本	3,380,821,021	6.29
社債券		3,309,279,900	6.15
	内 日本	3,309,279,900	6.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		363,071,771	0.68
純資産総額		53,786,873,502	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28年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	368 2年国債	日本	国債証券	610,000,000	100.50 613,103,100	100.50 613,104,900	0.100000 2018/09/15	1.14
2	129 5年国債	日本	国債証券	600,000,000	100.98 605,903,700	101.01 606,102,000	0.100000 2021/09/20	1.13
3	344 10年国債	日本	国債証券	565,000,000	100.82 569,656,200	100.67 568,825,050	0.100000 2026/09/20	1.06
4	116 5年国債	日本	国債証券	558,000,000	100.77 562,303,580	100.77 562,324,500	0.200000 2018/12/20	1.05
5	342 10年国債	日本	国債証券	540,000,000	100.91 544,923,300	100.82 544,465,800	0.100000 2026/03/20	1.01
6	340 10年国債	日本	国債証券	520,000,000	103.61 538,779,400	103.48 538,106,400	0.400000 2025/09/20	1.00
7	343 10年国債	日本	国債証券	525,000,000	100.89 529,703,250	100.75 528,958,500	0.100000 2026/06/20	0.98
8	341 10年国債	日本	国債証券	500,000,000	102.73 513,685,700	102.64 513,200,000	0.300000 2025/12/20	0.95
9	127 5年国債	日本	国債証券	500,000,000	100.90 504,530,000	100.92 504,645,000	0.100000 2021/03/20	0.94
10	305 10年国債	日本	国債証券	470,000,000	104.40 490,722,300	104.33 490,379,200	1.300000 2019/12/20	0.91
11	335 10年国債	日本	国債証券	470,000,000	104.18 489,664,800	104.05 489,049,100	0.500000 2024/09/20	0.91
12	339 10年国債	日本	国債証券	450,000,000	103.55 465,995,700	103.42 465,412,500	0.400000 2025/06/20	0.87
13	128 5年国債	日本	国債証券	460,000,000	100.92 464,257,200	100.96 464,425,200	0.100000 2021/06/20	0.86
14	122 5年国債	日本	国債証券	450,000,000	100.74 453,361,800	100.75 453,406,500	0.100000 2019/12/20	0.84
15	119 5年国債	日本	国債証券	450,000,000	100.67 453,050,140	100.70 453,159,000	0.100000 2019/06/20	0.84
16	366 2年国債	日本	国債証券	440,000,000	100.45 441,993,200	100.48 442,116,400	0.100000 2018/07/15	0.82
17	126 5年国債	日本	国債証券	430,000,000	100.85 433,689,300	100.89 433,844,200	0.100000 2020/12/20	0.81
18	124 5年国債	日本	国債証券	430,000,000	100.79 433,407,600	100.81 433,504,500	0.100000 2020/06/20	0.81

19	117 5年国債	日本	国債証券	420,000,000	100.85 423,576,800	100.86 423,620,400	0.200000 2019/03/20	0.79
20	312 10年国債	日本	国債証券	395,000,000	105.32 416,045,600	105.26 415,804,650	1.200000 2020/12/20	0.77
21	125 5年国債	日本	国債証券	400,000,000	100.83 403,356,000	100.85 403,424,000	0.100000 2020/09/20	0.75
22	334 10年国債	日本	国債証券	370,000,000	104.79 387,734,000	104.74 387,560,200	0.600000 2024/06/20	0.72
23	123 5年国債	日本	国債証券	350,000,000	100.77 352,716,000	100.78 352,758,000	0.100000 2020/03/20	0.66
24	333 10年国債	日本	国債証券	335,000,000	104.71 350,785,700	104.66 350,611,000	0.600000 2024/03/20	0.65
25	300 10年国債	日本	国債証券	286,000,000	103.82 296,939,500	103.72 296,656,360	1.500000 2019/03/20	0.55
26	150 20年国債	日本	国債証券	250,000,000	117.78 294,453,750	116.34 290,857,500	1.400000 2034/09/20	0.54
27	140 20年国債	日本	国債証券	240,000,000	122.52 294,071,200	121.18 290,834,400	1.700000 2032/09/20	0.54
28	153 20年国債	日本	国債証券	250,000,000	116.11 290,296,700	114.38 285,965,000	1.300000 2035/06/20	0.53
29	145 20年国債	日本	国債証券	235,000,000	122.75 288,466,050	121.28 285,024,450	1.700000 2033/06/20	0.53
30	330 10年国債	日本	国債証券	262,000,000	105.94 277,573,280	105.86 277,358,440	0.800000 2023/09/20	0.52

(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	79.81%
地方債証券	7.08%
特殊債券	6.29%
社債券	6.15%
合計	99.32%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成28年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		79,694,426,950	96.31
	内 香港	1,019,135,371	1.23
	内 シンガポール	382,674,021	0.46
	内 イスラエル	222,003,299	0.27
	内 ノルウェー	218,262,214	0.26
	内 スウェーデン	931,960,687	1.13
	内 デンマーク	540,187,892	0.65
	内 イギリス	5,894,856,122	7.12
	内 アイルランド	152,143,927	0.18
	内 オランダ	1,085,682,616	1.31
	内 ベルギー	384,921,453	0.47
	内 フランス	3,214,649,177	3.88
	内 ドイツ	3,048,314,830	3.68
	内 スイス	2,848,900,246	3.44
	内 ポルトガル	46,509,343	0.06
	内 スペイン	1,025,953,373	1.24
	内 イタリア	681,454,909	0.82
	内 フィンランド	315,642,657	0.38
	内 オーストリア	65,951,097	0.08
	内 カナダ	3,298,023,047	3.99
	内 アメリカ	52,007,237,041	62.85
	内 オーストラリア	2,251,683,205	2.72
	内 ニュージーランド	58,280,423	0.07
投資証券		2,065,603,483	2.50
	内 香港	38,895,792	0.05

	内 シンガポール	25,344,428	0.03
	内 イギリス	82,491,238	0.10
	内 フランス	114,644,254	0.14
	内 カナダ	17,522,934	0.02
	内 アメリカ	1,585,327,136	1.92
	内 オーストラリア	201,377,701	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		986,342,381	1.19
純資産総額		82,746,372,814	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）		784,595,097	0.95
	内 アメリカ	784,595,097	0.95

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

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

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

(2) 投資資産（平成28年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	122,100	12,983.97 1,585,343,396	13,597.87 1,660,300,867	2.01
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	167,750	7,116.37 1,193,771,755	7,327.22 1,229,141,323	1.49
3	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	93,805	10,006.49 938,658,888	10,524.87 987,285,571	1.19
4	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	61,900	13,102.79 811,063,023	13,453.43 832,767,323	1.01
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	81,770	9,193.39 751,743,566	10,005.32 818,135,515	0.99
6	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	9,120	88,825.95 810,092,708	89,132.32 812,886,790	0.98

7	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	203,300	3,617.01 735,339,048	3,693.89 750,969,443	0.91
8	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	52,550	14,080.14 739,911,688	13,553.61 712,242,284	0.86
9	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	108,372	6,041.17 654,693,827	6,388.31 692,314,105	0.84
10	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	138,991	4,599.02 639,223,112	4,969.46 690,710,687	0.83
11	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,017	89,795.15 630,092,579	91,187.20 639,860,632	0.77
12	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,690	91,961.86 615,224,881	93,527.49 625,698,916	0.76
13	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	72,100	7,800.54 562,419,150	8,365.88 603,180,128	0.73
14	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	230,601	2,363.58 545,044,396	2,562.78 590,979,631	0.71
15	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	42,768	12,737.01 544,736,726	13,724.85 586,984,462	0.71
16	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	92,404	5,936.33 548,540,674	6,260.17 578,464,989	0.70
17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	57,667	9,655.85 556,824,254	9,825.93 566,631,992	0.68
18	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	27,550	18,368.14 506,042,345	18,993.69 523,276,283	0.63
19	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	136,963	3,718.36 509,277,850	3,784.76 518,372,098	0.63
20	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,000	4,113.26 440,119,023	4,270.52 456,946,004	0.55
21	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	65,423	6,467.52 423,124,875	6,917.17 452,542,419	0.55
22	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	92,750	4,793.56 444,603,015	4,845.98 449,465,016	0.54
23	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	54,570	8,170.60 445,870,111	8,164.78 445,552,268	0.54
24	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	51,600	8,000.41 412,821,182	8,502.93 438,751,420	0.53

25	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	27,850	15,099.43 420,519,231	15,737.79 438,297,702	0.53
26	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	16,220	25,857.14 419,402,876	26,725.14 433,481,771	0.52
27	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	62,471	7,244.51 452,571,978	6,877.56 429,648,650	0.52
28	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	459,300	903.47 414,965,608	929.78 427,050,710	0.52
29	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	34,700	11,610.55 402,886,373	12,180.19 422,652,746	0.51
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	114,400	3,474.89 397,528,182	3,548.28 405,923,850	0.49

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.31%
投資証券	2.50%
合計	98.81%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	7.77%
素材	4.92%
資本財・サービス	10.25%
一般消費財・サービス	11.41%
生活必需品	9.86%
ヘルスケア	12.27%
金融	18.10%
情報技術	14.85%
電気通信サービス	3.09%
公益事業	3.26%
不動産	0.53%
その他	0.00%
合計	96.31%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 2017年3月	買建	12	787,940,224	784,595,097	0.95%

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

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

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成28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		157,495,174,038	98.61
	内 ユーロ	63,233,295,546	39.59
	内 シンガポール	596,576,938	0.37
	内 マレーシア	683,739,709	0.43
	内 ノルウェー	408,375,704	0.26
	内 スウェーデン	706,356,892	0.44
	内 デンマーク	1,011,250,258	0.63
	内 イギリス	11,463,149,639	7.18
	内 スイス	376,356,607	0.24
	内 ポーランド	925,144,374	0.58
	内 カナダ	3,255,206,951	2.04
	内 アメリカ	69,663,880,491	43.62
	内 メキシコ	1,197,742,759	0.75
	内 南アフリカ	830,272,381	0.52
	内 オーストラリア	3,143,825,789	1.97
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,219,137,149	1.39
純資産総額		159,714,311,187	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）		177,546,400	0.11
	内　日本	177,546,400	0.11
為替予約取引（売建）		172,568,280	△0.11
	内　日本	172,568,280	△0.11

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

(注2)　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28年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,143,000	97.75 699,547,205	96.53 690,773,972	2.000000 2025/08/15	0.43
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	100.18 691,027,098	99.07 683,322,733	2.250000 2024/11/15	0.43
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	99.66 678,015,786	98.35 669,137,850	2.250000 2025/11/15	0.42
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,662,000	101.27 667,962,660	100.15 660,595,303	2.375000 2024/08/15	0.41
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	98.89 666,760,010	97.69 658,702,793	2.125000 2025/05/15	0.41
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	98.12 656,458,281	97.02 649,085,878	2.000000 2025/02/15	0.41
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,412,000	102.30 644,969,306	101.21 638,072,250	2.500000 2024/05/15	0.40
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	104.10 634,155,205	103.02 627,540,095	2.750000 2024/02/15	0.39
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	104.13 609,064,204	103.04 602,712,230	2.750000 2023/11/15	0.38

10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,529,000	94.17 606,581,708	92.87 598,182,993	1.625000 2026/05/15	0.37
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	92.91 606,118,904	91.59 597,501,439	1.500000 2026/08/15	0.37
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,697,000	128.60 583,375,908	128.68 583,752,414	4.250000 2023/10/25	0.37
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	94.33 589,674,255	93.07 581,816,932	1.625000 2026/02/15	0.36
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	103.77 545,071,221	103.24 542,282,125	2.625000 2020/11/15	0.34
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,280,000	106.86 532,814,496	106.37 530,361,496	3.625000 2020/02/15	0.33
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,709,000	158.93 528,287,556	159.51 530,222,091	4.750000 2035/04/25	0.33
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	98.00 534,840,537	97.14 530,190,698	1.750000 2023/05/15	0.33
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,507,000	168.62 518,711,659	169.13 520,262,008	5.750000 2032/10/25	0.33
19	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	2,849,000	144.88 506,463,843	147.30 514,933,980	6.000000 2031/05/01	0.32
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,550,000	117.13 510,200,710	117.15 510,300,895	3.250000 2021/10/25	0.32
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,076,000	107.89 512,276,004	107.22 509,123,244	3.625000 2021/02/15	0.32
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,325,000	100.39 505,804,297	100.12 504,428,871	1.500000 2019/11/30	0.32
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,480,000	117.16 500,289,863	117.08 499,926,916	3.000000 2022/04/25	0.31
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	155.02 498,945,370	155.22 499,572,962	5.500000 2029/04/25	0.31
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,484,000	164.09 500,152,090	163.83 499,356,597	4.500000 2041/04/25	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,300,000	99.67 499,279,052	99.65 499,163,843	0.750000 2018/04/30	0.31
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,020,000	105.87 495,783,094	105.43 493,731,984	3.375000 2019/11/15	0.31
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	126.56 488,562,732	127.06 490,485,083	3.500000 2026/04/25	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,218,000	99.49 488,858,737	99.48 488,819,429	0.625000 2018/04/30	0.31

30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,380,000	113.54 470,917,225	113.46 470,581,297	3.500000 2020/04/25	0.29

(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	98.61%
合計	98.61%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2017年1月	買建	24,000	2,009,556	2,072,640	0.00%
		スイス・フラン買/円売 2017年1月	買建	15,000	1,669,693	1,712,850	0.00%
		南アフリカ・ランド買/円売 2017年1月	買建	447,000	3,578,950	3,821,850	0.00%
		米ドル買/円売 2017年1月	買建	1,258,000	141,744,525	146,355,720	0.09%
		シンガポール・ドル買/円売 2017年1月	買建	35,000	2,763,722	2,818,200	0.00%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2017年1月	買建	263,000	3,224,261	3,369,030	0.00%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2017年1月	買建	148,000	3,985,788	4,120,320	0.00%
		デンマーク・クローネ買/円売 2017年1月	買建	309,000	4,979,808	5,098,500	0.00%

		メキシコ・ペソ買/円売 2017年1月	買建	1,113,000	6,030,456	6,243,930	0.00%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2017年1月	買建	143,000	1,884,240	1,933,360	0.00%
		カナダ・ドル売/円買 2017年1月	売建	42,000	3,624,028	3,629,220	△0.00%
		豪ドル売/円買 2017年1月	売建	41,000	3,450,547	3,456,300	△0.00%
		米ドル売/円買 2017年1月	売建	653,000	75,903,414	76,022,260	△0.05%
		英ポンド売/円買 2017年1月	売建	87,000	12,426,349	12,436,650	△0.01%
		ユーロ売/円買 2017年1月	売建	565,000	69,291,035	69,319,850	△0.04%
		南アフリカ・ランド売/円買 2017年1月	売建	900,000	7,694,640	7,704,000	△0.00%

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

2016年12月30日現在　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	13,085円
純資産総額	7.8億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	3.0%
3カ月間	11.4%
6カ月間	15.9%
1年間	0.6%
3年間	17.8%
5年間	93.3%
設定来	30.9%

※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運用管理費用（信託報酬）は控除しています。

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額： 0円　　設定来分配金合計額： 0円

決算期	第6期 05年11月	第7期 06年11月	第8期 07年11月	第9期 08年12月	第10期 09年11月	第11期 10年11月	第12期 11年11月	第13期 12年11月	第14期 13年12月	第15期 14年12月	第16期 15年11月	第17期 16年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

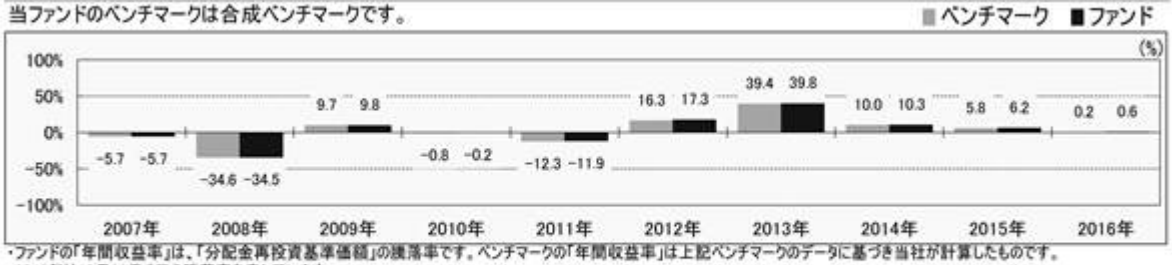
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値		組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
国内株式・先物	1,501	59.8%	日本円	79.8%	直接利回り(%)	1.3	トヨタ自動車	日本	2.2%
国内債券	360	19.5%	米ドル	12.3%	最終利回り(%)	0.4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.4%
外国株式・先物	1,253	14.8%	ユーロ	3.9%	修正デュレーション	8.4	日本電信電話	日本	1.0%
外国債券	745	4.9%	英ポンド	1.5%	残存年数	9.7	三井住友フィナンシャルG	日本	0.9%
外国リート	61	0.4%	カナダ・ドル	0.7%	債券格付別構成	比率	ソフトバンクグループ	日本	0.9%
			豪ドル	0.6%	AAA	84.3%	本田技研	日本	0.8%
			スイス・フラン	0.5%	AA	7.0%	KDDI	日本	0.8%
			スウェーデン・クローネ	0.2%	A	5.4%	みずほフィナンシャルG	日本	0.8%
			香港ドル	0.2%	BBB	0.3%	日本たばこ産業	日本	0.6%
コール・ローン、その他		1.1%	その他	0.4%	BB以下・無格付	3.1%	ソニー	日本	0.6%
合計	3,920	－	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		10.2%

※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3.1%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、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欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・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。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

第２　【管理及び運営】

１　【申込(販売)手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において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。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、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。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の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。

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、販売会社が定める単位（別に定める契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

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

委託会社は、金融商品取引所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できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記に準じて計算される価額とします。

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（受入担保金代用有価証券を除きます。）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：海外取引所に上場されている株式は原則として海外取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場、海外の店頭市場に登録されている株式は原則として当該海外店頭市場における計算時に知り得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。

・公社債等：原則として、次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ます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　http://www.daiwa-am.co.jp/

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30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、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。

5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 前3.から前5.までの規定は、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3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

7. 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。

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、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。

9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

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ができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 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5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、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るべき旨を請求することができます。

④　運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
   ・委託会社のホームページ
   　アドレス　http://www.daiwa-am.co.jp/
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤　公告

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

⑥　関係法人との契約の更改

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

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。

①　収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算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(当該収益分配金にかかる決算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、当該収益分配金にかかる計算期間の末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、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。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。

収益分配金および償還金の支払いは、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、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに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。

② 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17期計算期間（平成27年12月1日から平成28年11月30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】

ダイワライフスタイル７５

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 平成27年11月30日現在	第17期 平成28年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,947,049	5,783,354
親投資信託受益証券	732,790,103	758,192,614
未収入金	－	1,165,000
流動資産合計	738,737,152	765,140,968
資産合計	738,737,152	765,140,968
負債の部		
流動負債		
未払解約金	323,398	1,382,270
未払受託者報酬	308,943	301,443
未払委託者報酬	3,167,067	3,090,274
その他未払費用	28,877	28,174
流動負債合計	3,828,285	4,802,161
負債合計	3,828,285	4,802,161
純資産の部		
元本等		
元本	※1 556,327,779	※1 598,654,336
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	178,581,088	161,684,471
（分配準備積立金）	195,136,824	181,305,000
元本等合計	734,908,867	760,338,807
純資産合計	734,908,867	760,338,807
負債純資産合計	738,737,152	765,140,968

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 自　平成26年12月2日 至　平成27年11月30日	第17期 自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30日
営業収益		
受取利息	2,186	367
有価証券売買等損益	56,992,257	△ 19,217,489
営業収益合計	56,994,443	△ 19,217,122
営業費用		
支払利息	―	1,122
受託者報酬	602,737	599,610
委託者報酬	6,179,018	6,146,995
その他費用	56,334	56,056
営業費用合計	6,838,089	6,803,783
営業利益又は営業損失（△）	50,156,354	△ 26,020,905
経常利益又は経常損失（△）	50,156,354	△ 26,020,905
当期純利益又は当期純損失（△）	50,156,354	△ 26,020,905
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	5,283,369	△ 5,385,025
期首剰余金又は期首欠損金（△）	120,114,870	178,581,088
剰余金増加額又は欠損金減少額	30,373,579	17,135,311
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	30,373,579	17,135,311
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,780,346	13,396,048
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,780,346	13,396,048
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	178,581,088	161,684,471

(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17期 自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30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16期 平成27年11月30日現在	第17期 平成28年11月30日現在
1.　※1　期首元本額	527,449,108円	556,327,779円
期中追加設定元本額	101,015,060円	85,325,672円
期中一部解約元本額	72,136,389円	42,999,115円
2.　計算期間末日における受益権の総数	556,327,779口	598,654,336口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第16期 自　平成26年12月2日 至　平成27年11月30日	第17期 自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30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（2,186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（44,870,799円）、投資信託約款に規定される収益調整金（167,103,729円）及び分配準備積立金（150,263,839円）より分配対象額は362,240,553円（1万口当たり6,511.28円）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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（208,495,672円）及び分配準備積立金（181,305,000円）より分配対象額は389,800,672円（1万口当たり6,511.28円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第17期 自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30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等であり、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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第17期 平成28年11月30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等 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16期 平成27年11月30日現在	第17期 平成28年11月30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	52,340,891	△17,476,975
合計	52,340,891	△17,476,975

（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16期 平成27年11月30日現在	第17期 平成28年11月30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17期 自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30日

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

（1口当たり情報）

	第16期 平成27年11月30日現在	第17期 平成28年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3210円 (13,210円)	1.2701円 (12,701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	513,159,508	458,610,652	
	日本債券インデックスマザーファンド	104,139,831	145,879,075	
	外国株式インデックスマザーファンド	59,617,537	116,188,617	
	外国債券インデックスマザーファンド	14,282,989	37,514,270	
親投資信託受益証券　合計			758,192,614	
合計			758,192,614	

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、「日本債券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」受益証券及び「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		平成27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
		金　額（円）	金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,147,726,099	3,916,751,366
株式	※3※4	131,197,269,060	124,953,943,460
派生商品評価勘定		81,594,183	97,126,795
未収入金		300,304,490	167,906,640
未収配当金		660,850,866	712,518,080
未収利息		―	331,370
その他未収収益	※5	14,767,385	14,507,257
流動資産合計		135,402,512,083	129,863,084,968
資産合計		135,402,512,083	129,863,084,968
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,715,396	―
前受金		85,705,000	90,505,000
未払金		―	129,912,360
未払解約金		180,292,000	254,683,100
未払利息		61,555	―
受入担保金		2,739,805,530	3,158,133,625
流動負債合計		3,009,579,481	3,633,234,085
負債合計		3,009,579,481	3,633,234,085
純資産の部			
元本等			
元本	※1	140,709,507,157	141,237,185,956
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△8,316,574,555	△15,007,335,073
元本等合計		132,392,932,602	126,229,850,883
純資産合計		132,392,932,602	126,229,850,883
負債純資産合計		135,402,512,083	129,863,084,968

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27年12月1日 至　平成28年11月30日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額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	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	平成27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
1．※1　期首	平成26年12月2日	平成27年12月1日
期首元本額	156,429,196,684円	140,709,507,157円
期中追加設定元本額	11,811,404,364円	15,352,397,205円
期中一部解約元本額	27,531,093,891円	14,824,718,406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	1,617,325,422円	1,610,341,359円
トピックス・インデックスファンド	5,759,733,101円	5,648,730,568円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	16,707,119,660円	13,687,983,821円

適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	168,688,902円	126,646,485円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	194,943,748円	141,686,038円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	3,001,554,339円	2,353,118,777円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	130,280,454円	109,845,953円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	4,148,883,429円	3,368,030,339円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	33,524,767円	33,491,212円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	－円	27,594,657円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	－円	593,766円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	－円	111,764,976円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	－円	68,977,995円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	61,010,045,853円	63,783,051,530円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,858,797,670円	2,368,199,277円
ダイワ・ライフ・バランス５０	2,014,704,231円	2,389,384,337円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,915,630,247円	2,140,568,498円
年金ダイワ日本株式インデックス	3,490,362,889円	3,836,869,470円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	22,797,202円	23,808,674円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	50,793,788円	61,017,840円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	10,007,790円	12,636,946円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	1,441,372円	448,097円

	ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	3,254,423円	440,730円
	ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	5,937,998円	941,908円
	ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	65,615,632円	63,672,333円
	ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	361,268,786円	353,729,673円
	ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	181,226,317円	196,965,786円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	1,558,534,214円	1,442,476,447円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	229,342,532円	229,813,057円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	15,530,969,176円	14,465,411,230円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	409,871,701円	384,828,380円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	703,533,678円	659,950,624円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,239,069,922円	1,178,011,578円
	ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	197,613,241円	182,365,011円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	308,115,317円	313,206,367円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	－円	45,419,513円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	－円	1,350,529,038円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	687,128,241円	1,024,916,082円
	ダイワライフスタイル２５	190,099,286円	206,988,834円
	ダイワライフスタイル５０	597,223,153円	678,795,303円
	ダイワライフスタイル７５	465,107,454円	513,159,508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）	15,838,961,222円	16,040,773,939円
計		140,709,507,157円	141,237,185,956円

2.　期末日における受益権の総数	140,709,507,157口	141,237,185,956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8,316,574,555円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は15,007,335,073円であります。
4.　※3　貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　2,594,940,450円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　3,009,650,890円
5.　※4　差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　765,700,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　664,900,000円
6.　※5　その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分14,105,650円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分13,416,400円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30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等であり、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（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。

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。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成28年11月30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等 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27年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成28年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	12,572,725,549	12,782,821,308
合計	12,572,725,549	12,782,821,308

（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27年9月25日から平成27年11月30日まで、及び平成28年9月21日から平成28年11月30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27年11月30日 現在				平成28年11月30日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買　建	1,187,395,000	－	1,265,600,000	78,205,000	1,082,030,000	－	1,179,200,000	97,170,000
合計	1,187,395,000	－	1,265,600,000	78,205,000	1,082,030,000	－	1,179,200,000	97,170,000

（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27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9409円 (9,409円)	0.8937円 (8,937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	3,200	2,703.00	8,649,600	
日本水産	85,500	514.00	43,947,000	
マルハニチロ	12,400	2,910.00	36,084,000	
カネコ種苗	3,900	1,464.00	5,709,600	

サカタのタネ	9,700	2,994.00	29,041,800	貸付株式数	2,700株
ホクト	6,600	2,009.00	13,259,400		
ショーボンドＨＤ	6,800	5,130.00	34,884,000	貸付株式数	1,900株 (1,900株)
ミライト・ホールディングス	20,300	1,095.00	22,228,500		
タマホーム	10,100	548.00	5,534,800		
日鉄鉱業	2,000	5,230.00	10,460,000		
三井松島	6,200	1,324.00	8,208,800		
国際石油開発帝石	344,700	1,085.00	373,999,500		
日本海洋掘削	2,600	2,375.00	6,175,000	貸付株式数	700株 (700株)
石油資源開発	10,000	2,327.00	23,270,000		
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,700	1,701.00	7,994,700		
安藤・間	47,400	803.00	38,062,200		
東急建設	23,700	938.00	22,230,600		
コムシスホールディングス	25,200	1,955.00	49,266,000		
ミサワホーム	8,900	1,009.00	8,980,100		
高松コンストラクションＧＰ	4,900	2,539.00	12,441,100		
東建コーポレーション	2,700	7,920.00	21,384,000	貸付株式数	700株
大成建設	333,000	828.00	275,724,000		
大　林　組	196,300	1,088.00	213,574,400		
清水建設	201,000	1,054.00	211,854,000	貸付株式数	56,000株 (56,000株)
飛島建設	68,900	194.00	13,366,600	貸付株式数	15,900株 (15,900株)
長谷工コーポレーシヨン	76,200	1,184.00	90,220,800		
松井建設	8,200	1,104.00	9,052,800		
鹿島建設	288,000	802.00	230,976,000		
不動テトラ	57,600	213.00	12,268,800	貸付株式数	14,700株
鉄建建設	43,000	351.00	15,093,000	貸付株式数	12,000株 (12,000株)
西松建設	76,000	562.00	42,712,000		
三井住友建設	253,000	127.00	32,131,000		
大豊建設	25,000	574.00	14,350,000	貸付株式数	7,000株 (7,000株)
前田建設	40,000	1,065.00	42,600,000		
奥　村　組	52,000	666.00	34,632,000		
東鉄工業	8,000	3,040.00	24,320,000		
淺沼組	25,000	341.00	8,525,000		
戸田建設	76,000	641.00	48,716,000		

熊　谷　組	104,000	294.00	30,576,000	
北野建設	27,000	312.00	8,424,000	
三井ホーム	12,000	466.00	5,592,000	
矢作建設	9,700	990.00	9,603,000	
ピーエス三菱	16,100	369.00	5,940,900	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
日本ハウスＨＬＤＧＳ	18,400	415.00	7,636,000	貸付株式数 3,100株
大東建託	24,000	17,775.00	426,600,000	
新日本建設	8,200	967.00	7,929,400	
ＮＩＰＰＯ	14,000	2,189.00	30,646,000	
東亜道路	25,000	317.00	7,925,000	
前田道路	20,000	1,968.00	39,360,000	
日本道路	21,000	441.00	9,261,000	
東亜建設	5,500	1,906.00	10,483,000	
若築建設	57,000	163.00	9,291,000	
東洋建設	21,100	413.00	8,714,300	
五洋建設	72,400	561.00	40,616,400	
大林道路	8,100	706.00	5,718,600	
世紀東急	14,300	510.00	7,293,000	
福　田　組	11,000	1,156.00	12,716,000	
住友林業	44,700	1,565.00	69,955,500	
日本基礎技術	13,700	336.00	4,603,200	
日成ビルド工業	21,000	538.00	11,298,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
パナホーム	24,000	812.00	19,488,000	
大和ハウス	193,100	3,252.00	627,961,200	
ライト工業	12,800	1,270.00	16,256,000	
積水ハウス	204,800	1,870.00	382,976,000	
ユアテック	11,000	776.00	8,536,000	
西部電気工業	3,200	2,066.00	6,611,200	
中電工	7,800	2,305.00	17,979,000	
関　電　工	26,000	1,065.00	27,690,000	
きんでん	43,000	1,443.00	62,049,000	
東京エネシス	7,000	953.00	6,671,000	
トーエネック	10,000	533.00	5,330,000	
住友電設	4,800	1,221.00	5,860,800	
日本電設工業	10,600	1,849.00	19,599,400	
協和エクシオ	25,400	1,618.00	41,097,200	
日本工営	22,000	498.00	10,956,000	

九電工	12,800	3,210.00	41,088,000	貸付株式数	3,400株 (3,400株)
三機工業	14,700	959.00	14,097,300		
日　揮	60,600	1,888.00	114,412,800		
中外炉工業	30,000	208.00	6,240,000		
太平電業	9,000	1,109.00	9,981,000		
高砂熱学	17,900	1,525.00	27,297,500		
ＮＥＣネッツエスアイ	6,100	2,069.00	12,620,900		
明星工業	13,500	549.00	7,411,500		
大　氣　社	8,500	2,822.00	23,987,000		
ダイダン	10,000	940.00	9,400,000		
日比谷総合設備	7,600	1,642.00	12,479,200		
東芝プラントシステム	10,400	1,714.00	17,825,600	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
日本製粉	19,100	1,546.00	29,528,600		
日清製粉Ｇ本社	71,300	1,603.00	114,293,900		
昭和産業	26,000	588.00	15,288,000		
中部飼料	8,400	1,034.00	8,685,600		
フィード・ワン	48,300	152.00	7,341,600		
日本甜菜糖	4,100	2,225.00	9,122,500		
三井製糖	4,500	2,375.00	10,687,500		
塩水港精糖	22,700	242.00	5,493,400		
日新製糖	3,400	1,601.00	5,443,400		
ネクスト	15,900	801.00	12,735,900	貸付株式数	5,200株 (5,200株)
ジェイエイシーリクルートメント	4,300	1,315.00	5,654,500		
日本Ｍ＆Ａセンター	17,700	3,120.00	55,224,000		
アコーディア・ゴルフ	18,900	1,199.00	22,661,100		
タケエイ	6,800	897.00	6,099,600	貸付株式数	1,900株
トラスト・テック	3,300	1,505.00	4,966,500		
パソナグループ	6,100	772.00	4,709,200	貸付株式数	1,800株 (1,300株)
ＣＤＳ	8,000	1,011.00	8,088,000		
リンクアンドモチベーション	17,300	393.00	6,798,900		
ＧＣＡ	6,400	919.00	5,881,600	貸付株式数	1,800株
エス・エム・エス	8,500	2,858.00	24,293,000		
テンプホールディングス	47,400	1,762.00	83,518,800		
リニカル	4,100	1,309.00	5,366,900		

クックパッド	14,200	1,026.00	14,569,200	貸付株式数	4,000株 (4,000株)
森永製菓	12,900	4,525.00	58,372,500	貸付株式数	3,400株 (3,400株)
中　村　屋	2,100	4,770.00	10,017,000		
江崎グリコ	16,400	5,350.00	87,740,000		
不　二　家	39,000	215.00	8,385,000		
山崎製パン	48,000	2,269.00	108,912,000	貸付株式数	13,500株 (8,200株)
モロゾフ	19,000	456.00	8,664,000		
亀田製菓	3,800	5,250.00	19,950,000		
寿スピリッツ	5,000	2,632.00	13,160,000	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
カルビー	26,700	3,565.00	95,185,500	貸付株式数	6,600株
森永乳業	59,000	784.00	46,256,000		
六甲バター	3,200	2,532.00	8,102,400	貸付株式数	800株
ヤクルト	35,100	5,020.00	176,202,000	貸付株式数	9,600株
明治ホールディングス	38,800	9,120.00	353,856,000		
雪印メグミルク	14,200	3,200.00	45,440,000		
プリマハム	42,000	398.00	16,716,000		
日本ハム	44,000	2,946.00	129,624,000		
丸大食品	32,000	472.00	15,104,000		
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	3,700	2,703.00	10,001,100	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	38,300	998.00	38,223,400		
スタジオアリス	2,900	2,302.00	6,675,800		
シミックホールディングス	4,000	1,501.00	6,004,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
システナ	5,100	1,620.00	8,262,000		
デジタルアーツ	2,900	2,443.00	7,084,700		
新日鉄住金ＳＯＬ	9,700	2,173.00	21,078,100		
綜合警備保障	22,200	4,655.00	103,341,000		
いちご	55,000	437.00	24,035,000	貸付株式数	17,000株 (17,000株)
日本駐車場開発	74,100	164.00	12,152,400	貸付株式数	21,800株 (21,700株)
カカクコム	44,100	1,795.00	79,159,500	貸付株式数	12,300株 (12,300株)
ルネサンス	4,700	1,430.00	6,721,000		

ディップ	8,100	2,403.00	19,464,300	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
ＳＢＳホールディングス	6,600	899.00	5,933,400		
オプトホールディング	7,700	713.00	5,490,100		
新日本科学	7,700	586.00	4,512,200		
ツクイ	16,000	717.00	11,472,000	貸付株式数	4,500株 (4,500株)
エムスリー	53,300	2,953.00	157,394,900		
アウトソーシング	3,300	3,625.00	11,962,500	貸付株式数	900株 (100株)
ウェルネット	5,400	1,301.00	7,025,400	貸付株式数	1,600株
ディー・エヌ・エー	27,500	3,485.00	95,837,500		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	84,500	1,328.00	112,216,000		
ぐるなび	9,000	2,426.00	21,834,000		
エスアールジータカミヤ	8,500	656.00	5,576,000		
ジャパンベストレスキューＳ	20,300	258.00	5,237,400		
ファンコミュニケーションズ	15,800	751.00	11,865,800	貸付株式数	4,400株 (300株)
ティア	9,900	618.00	6,118,200		
インフォマート	13,500	1,164.00	15,714,000	貸付株式数	3,600株 (3,600株)
サッポロホールディングス	21,100	3,010.00	63,511,000		
アサヒグループホールディン	122,600	3,722.00	456,317,200		
キリンＨＤ	281,700	1,863.50	524,947,950		
宝ホールディングス	46,900	1,041.00	48,822,900		
オエノンホールディングス	29,000	257.00	7,453,000		
コカ・コーラウエスト	22,100	3,240.00	71,604,000		
コカ・コーライーストジャパン	25,500	2,417.00	61,633,500		
サントリー食品インター	44,900	4,895.00	219,785,500		
ダイドードリンコ	2,900	5,650.00	16,385,000		
伊　藤　園	19,400	3,780.00	73,332,000		
キーコーヒー	6,300	2,088.00	13,154,400		
日清オイリオグループ	37,000	487.00	18,019,000		
不二製油グループ	17,400	2,158.00	37,549,200	貸付株式数	4,800株
Ｊ－オイルミルズ	3,100	3,730.00	11,563,000		
ローソン	20,000	7,920.00	158,400,000	貸付株式数	6,100株 (6,100株)
サンエー	4,400	5,510.00	24,244,000		
カワチ薬品	4,700	2,693.00	12,657,100		

エービーシー・マート	10,500	6,710.00	70,455,000	貸付株式数	2,100株
ハードオフコーポレーション	4,400	1,153.00	5,073,200		
アスクル	7,100	4,115.00	29,216,500	貸付株式数	400株 (400株)
ゲオホールディングス	9,400	1,238.00	11,637,200	貸付株式数	2,700株
アダストリア	8,900	3,230.00	28,747,000		
くらコーポレーション	3,800	4,900.00	18,620,000		
キャンドゥ	4,300	1,779.00	7,649,700	貸付株式数	1,300株
エレマテック	2,600	1,847.00	4,802,200		
パルグループＨＬＤＧＳ	3,200	2,968.00	9,497,600	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
エディオン	21,300	1,099.00	23,408,700	貸付株式数	8,800株
あらた	2,900	2,414.00	7,000,600		
サーラコーポレーション	8,800	630.00	5,544,000		
ワッツ	6,900	1,046.00	7,217,400		
ハローズ	2,100	2,364.00	4,964,400		
ＪＰホールディングス	21,800	264.00	5,755,200	貸付株式数	6,100株 (2,000株)
あみやき亭	1,600	3,965.00	6,344,000		
ひらまつ	10,700	620.00	6,634,000	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
フィールズ	4,700	1,350.00	6,345,000		
双日	335,700	290.00	97,353,000		
ゲンキー	1,200	5,630.00	6,756,000	貸付株式数	300株 (100株)
アルフレッサホールディングス	67,800	1,823.00	123,599,400		
大黒天物産	1,500	4,910.00	7,365,000		
ハニーズ	6,000	1,188.00	7,128,000	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
キッコーマン	46,000	3,500.00	161,000,000	貸付株式数	12,000株
味　の　素	134,600	2,212.50	297,802,500		
キユーピー	33,500	2,703.00	90,550,500		
ハウス食品Ｇ本社	23,900	2,294.00	54,826,600		
カ　ゴ　メ	23,400	2,687.00	62,875,800	貸付株式数	6,400株 (6,400株)
アリアケジャパン	5,400	5,720.00	30,888,000		
ニチレイ	32,300	2,315.00	74,774,500		
横浜冷凍	14,700	1,040.00	15,288,000	貸付株式数	200株 (200株)

東洋水産	31,900	4,050.00	129,195,000	
日清食品ＨＤ	25,500	5,960.00	151,980,000	
永谷園ホールディングス	7,000	1,340.00	9,380,000	
フジッコ	6,600	2,342.00	15,457,200	
ロックフィールド	7,600	1,438.00	10,928,800	
日本たばこ産業	361,900	3,946.00	1,428,057,400	
ケンコーマヨネーズ	2,600	3,220.00	8,372,000	
わらべや日洋ＨＤ	4,100	2,404.00	9,856,400	
ユーグレナ	21,300	1,284.00	27,349,200	貸付株式数 5,900株 (5,800株)
片倉工業	8,100	1,279.00	10,359,900	
グ　ン　ゼ	44,000	378.00	16,632,000	
ヒューリック	120,100	1,074.00	128,987,400	
山下医科器械	3,300	1,705.00	5,626,500	
アルペン	4,800	2,211.00	10,612,800	
クオール	6,900	1,464.00	10,101,600	
アルコニックス	5,200	1,594.00	8,288,800	
神戸物産	3,200	3,025.00	9,680,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
ジェイアイエヌ	4,000	4,795.00	19,180,000	貸付株式数 1,100株 (1,000株)
ビックカメラ	32,700	1,014.00	33,157,800	
ＤＣＭホールディングス	32,800	1,033.00	33,882,400	貸付株式数 7,800株 (7,800株)
ＭｏｎｏｔａＲＯ	20,500	2,443.00	50,081,500	貸付株式数 5,700株
あい　ホールディングス	10,500	2,513.00	26,386,500	貸付株式数 2,900株
ディーブイエックス	3,700	1,380.00	5,106,000	
アークランドサービスＨＤ	2,100	2,903.00	6,096,300	貸付株式数 600株
Ｊ．　フロント　リテイリング	72,700	1,612.00	117,192,400	
ドトール・日レスＨＤ	9,900	2,127.00	21,057,300	
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	10,800	5,460.00	58,968,000	
ブロンコビリー	3,300	3,045.00	10,048,500	貸付株式数 900株 (900株)
スタートトゥデイ	52,900	1,757.00	92,945,300	
物語コーポレーション	1,800	4,410.00	7,938,000	
ココカラファイン	6,100	4,190.00	25,559,000	
三越伊勢丹ＨＤ	114,300	1,261.00	144,132,300	
東洋紡	240,000	172.00	41,280,000	
ユニチカ	173,000	86.00	14,878,000	

富士紡ホールディングス	3,200	3,565.00	11,408,000	
日清紡ホールディングス	31,500	1,108.00	34,902,000	
倉敷紡績	61,000	231.00	14,091,000	
ダイワボウＨＤ	49,000	301.00	14,749,000	
シキボウ	66,000	139.00	9,174,000	
日東紡績	50,000	445.00	22,250,000	
トヨタ紡織	20,500	2,601.00	53,320,500	
マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	10,500	1,360.00	14,280,000	
ウエルシアＨＤ	5,800	7,130.00	41,354,000	
クリエイトＳＤＨ	8,700	2,427.00	21,114,900	
バイタルＫＳＫＨＤ	10,600	963.00	10,207,800	
ＵＫＣホールディングス	4,200	2,094.00	8,794,800	
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	13,100	371.00	4,860,100	
ＴＯＫＡＩホールディングス	25,200	754.00	19,000,800	貸付株式数　7,400株
三洋貿易	5,000	1,535.00	7,675,000	
チムニー	2,000	2,881.00	5,762,000	
ウイン・パートナーズ	3,000	1,851.00	5,553,000	
ジョイフル本田	9,200	3,215.00	29,578,000	貸付株式数　1,800株
鳥貴族	1,600	2,497.00	3,995,200	
すかいらーく	24,600	1,600.00	39,360,000	
綿半ホールディングス	3,300	1,578.00	5,207,400	
日本毛織	16,800	800.00	13,440,000	
ダイドーリミテツド	18,800	404.00	7,595,200	
ユナイテッド・スーパーマーケ	18,800	938.00	17,634,400	
野村不動産ＨＬＤＧＳ	37,600	1,852.00	69,635,200	
三重交通グループＨＤ	12,000	393.00	4,716,000	
サムティ	5,600	1,065.00	5,964,000	
日本商業開発	3,600	1,925.00	6,930,000	貸付株式数　1,000株 (1,000株)
プレサンスコーポレーション	9,500	1,427.00	13,556,500	
ユニゾホールディングス	4,900	3,265.00	15,998,500	
日本管理センター	4,700	1,379.00	6,481,300	貸付株式数　1,200株 (1,200株)
フージャースＨＤ	11,100	607.00	6,737,700	
オープンハウス	8,500	2,828.00	24,038,000	
東急不動産ＨＤ	137,100	655.00	89,800,500	
飯田ＧＨＤ	47,800	2,218.00	106,020,400	
帝国繊維	6,600	1,637.00	10,804,200	

ブックオフコーポレーション	8,800	800.00	7,040,000	
日本コークス工業	66,900	100.00	6,690,000	
あさひ	4,900	1,259.00	6,169,100	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
日本調剤	2,100	4,435.00	9,313,500	貸付株式数 400株
コスモス薬品	2,900	20,930.00	60,697,000	貸付株式数 800株 (800株)
シップヘルスケアＨＤ	10,900	2,987.00	32,558,300	
一六堂	22,400	371.00	8,310,400	
ソフトクリエイトＨＤ	5,800	1,368.00	7,934,400	
セブン＆アイ・ＨＬＤＧＳ	240,900	4,435.00	1,068,391,500	
薬王堂	3,300	2,214.00	7,306,200	
クリエイト・レストランツ・ホール	15,600	1,007.00	15,709,200	
ツルハホールディングス	13,300	11,680.00	155,344,000	
サンマルクホールディングス	3,700	3,540.00	13,098,000	
トリドールホールディングス	7,200	2,475.00	17,820,000	
帝　人	49,100	2,118.00	103,993,800	
東　レ	442,000	929.40	410,794,800	
ク　ラ　レ	101,300	1,618.00	163,903,400	
旭　化　成	381,000	1,017.50	387,667,500	
サカイ　オーベックス	2,800	1,775.00	4,970,000	
稲葉製作所	4,800	1,328.00	6,374,400	
宮地エンジニアリングＧ	32,000	204.00	6,528,000	
トーカロ	4,400	2,477.00	10,898,800	
ＳＵＭＣＯ	63,900	1,253.00	80,066,700	貸付株式数 17,900株 (13,600株)
川田テクノロジーズ	1,400	6,700.00	9,380,000	貸付株式数 300株 (300株)
住江織物	22,000	243.00	5,346,000	
アツギ	74,000	121.00	8,954,000	
コメダホールディングス	7,700	1,728.00	13,305,600	
ダイユー・リックＨＬＤＧＳ	9,500	671.00	6,374,500	
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	5,300	4,865.00	25,784,500	
共和レザー	6,200	795.00	4,929,000	
セーレン	15,600	1,466.00	22,869,600	
ソトー	6,100	1,181.00	7,204,100	
東海染工	53,000	134.00	7,102,000	
小松精練	11,900	669.00	7,961,100	
ワコールホールディングス	35,000	1,327.00	46,445,000	

ホギメディカル	3,900	6,720.00	26,208,000		
ＴＳＩホールディングス	24,800	657.00	16,293,600		
ＴＩＳ	19,200	2,405.00	46,176,000		
電算システム	3,100	1,788.00	5,542,800	貸付株式数	700株 (700株)
グリー	36,500	608.00	22,192,000		
コーエーテクモＨＤ	13,800	1,915.00	26,427,000		
三菱総合研究所	2,500	3,240.00	8,100,000		
ファインデックス	4,800	902.00	4,329,600		
ＫＬａｂ	12,200	643.00	7,844,600	貸付株式数	700株 (700株)
ポールトゥウィン・ピットクル	5,700	916.00	5,221,200	貸付株式数	1,000株
ネクソン	63,500	1,599.00	101,536,500		
アイスタイル	9,400	746.00	7,012,400	貸付株式数	2,600株 (2,600株)
エイチーム	3,700	2,414.00	8,931,800	貸付株式数	1,200株 (900株)
テクノスジャパン	2,500	2,697.00	6,742,500	貸付株式数	600株
コロプラ	16,400	967.00	15,858,800	貸付株式数	4,500株 (4,500株)
ブロードリーフ	7,900	1,363.00	10,767,700		
ハーツユナイテッドグループ	3,500	1,624.00	5,684,000	貸付株式数	900株
特種東海製紙	3,700	3,995.00	14,781,500		
ティーガイア	5,800	1,707.00	9,900,600	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
豆蔵ホールディングス	5,600	1,005.00	5,628,000		
テクマトリックス	2,500	1,884.00	4,710,000		
ガンホー・オンライン・エンター	122,500	254.00	31,115,000	貸付株式数	37,300株 (28,900株)
GMOペイメントゲートウェイ	4,800	4,710.00	22,608,000	貸付株式数	1,300株
インターネットイニシアティブ	8,800	1,640.00	14,432,000		
さくらインターネット	4,800	954.00	4,579,200	貸付株式数	1,300株
ＳＲＡホールディングス	3,500	2,329.00	8,151,500		
朝日ネット	18,500	460.00	8,510,000		
コムチュア	1,500	3,310.00	4,965,000	貸付株式数	400株
王子ホールディングス	232,000	469.00	108,808,000		
日本製紙	26,500	1,978.00	52,417,000		
三菱製紙	11,600	750.00	8,700,000		

北越紀州製紙	32,800	656.00	21,516,800		
中越パルプ	28,000	240.00	6,720,000	貸付株式数	10,000株 (10,000株)
巴川製紙	19,000	254.00	4,826,000		
大王製紙	24,000	1,258.00	30,192,000	貸付株式数	7,500株
ｇｕｍｉ	6,700	724.00	4,850,800	貸付株式数	1,900株 (200株)
ＬＩＮＥ	9,800	4,410.00	43,218,000	貸付株式数	2,700株 (2,600株)
レンゴー	58,300	677.00	39,469,100		
トーモク	24,000	320.00	7,680,000		
ザ・パック	4,500	2,589.00	11,650,500		
昭和電工	40,000	1,544.00	61,760,000		
住友化学	447,000	523.00	233,781,000		
日本化成	49,000	150.00	7,350,000		
住友精化	2,600	4,310.00	11,206,000		
日産化学	33,300	3,805.00	126,706,500		
ラサ工業	62,000	131.00	8,122,000		
クレハ	4,500	4,670.00	21,015,000		
テイカ	11,000	617.00	6,787,000		
石原産業	11,800	958.00	11,304,400		
日東エフシー	5,900	889.00	5,245,100		
日本曹達	36,000	496.00	17,856,000		
東ソー	176,000	768.00	135,168,000		
トクヤマ	95,000	449.00	42,655,000		
セントラル硝子	62,000	452.00	28,024,000		
東亜合成	36,400	1,107.00	40,294,800		
大阪ソーダ	27,000	470.00	12,690,000		
関東電化	13,000	950.00	12,350,000	貸付株式数	3,000株
デンカ	124,000	505.00	62,620,000		
イビデン	40,200	1,554.00	62,470,800	貸付株式数	9,700株 (9,700株)
信越化学	109,500	8,460.00	926,370,000		
日本カーバイド	51,000	149.00	7,599,000		
堺　化　学	22,000	358.00	7,876,000		
エア・ウォーター	49,700	1,955.00	97,163,500		
大陽日酸	47,000	1,252.00	58,844,000		
日本化学工業	26,000	237.00	6,162,000		
日本パーカライジング	30,700	1,324.00	40,646,800		
高圧ガス	10,400	714.00	7,425,600		

四国化成	9,000	1,001.00	9,009,000		
戸田工業	16,000	285.00	4,560,000		
ステラ　ケミファ	3,000	3,000.00	9,000,000		
保土谷化学	2,400	2,821.00	6,770,400		
日本触媒	9,500	7,010.00	66,595,000		
大日精化	24,000	607.00	14,568,000		
カネカ	81,000	911.00	73,791,000		
協和発酵キリン	73,200	1,632.00	119,462,400		
三菱瓦斯化学	56,300	1,734.00	97,624,200		
三井化学	276,000	529.00	146,004,000		
ＪＳＲ	60,400	1,646.00	99,418,400		
東京応化工業	11,500	3,825.00	43,987,500		
大阪有機化学	6,300	809.00	5,096,700		
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	407,000	719.50	292,836,500		
ダイセル	82,400	1,260.00	103,824,000		
住友ベ－クライト	52,000	617.00	32,084,000		
積水化学	138,200	1,732.00	239,362,400		
日本ゼオン	51,000	1,027.00	52,377,000	貸付株式数	14,000株 (14,000株)
アイカ工業	19,000	3,010.00	57,190,000		
宇部興産	300,000	238.00	71,400,000		
積水樹脂	9,500	1,734.00	16,473,000		
タキロン	15,000	503.00	7,545,000		
旭有機材	33,000	217.00	7,161,000		
日立化成	33,500	2,510.00	84,085,000		
ニチバン	7,000	845.00	5,915,000		
リケンテクノス	14,200	549.00	7,795,800	貸付株式数	3,900株
大倉工業	19,000	511.00	9,709,000		
積水化成品	9,000	801.00	7,209,000		
群栄化学	1,800	3,000.00	5,400,000		
タイガース　ポリマー	6,400	671.00	4,294,400		
ダイキョーニシカワ	10,800	1,420.00	15,336,000		
日本化薬	39,000	1,328.00	51,792,000	貸付株式数	10,000株
カーリットホールディングス	13,300	534.00	7,102,200		
ＥＰＳホールディングス	7,900	1,342.00	10,601,800		
プレステージ・インター	9,800	808.00	7,918,400		
アミューズ	3,800	1,636.00	6,216,800		
野村総合研究所	39,100	3,880.00	151,708,000		
ドリームインキュベータ	2,100	2,109.00	4,428,900	貸付株式数	600株 (400株)

クイック	4,400	944.00	4,153,600	
ケネディクス	82,000	422.00	34,604,000	
電通	67,900	5,230.00	355,117,000	
インテージホールディングス	3,700	1,877.00	6,944,900	
イオンファンタジー	1,900	3,155.00	5,994,500	貸付株式数 700株 (700株)
シーティーエス	4,900	1,258.00	6,164,200	
日本精化	8,400	819.00	6,879,600	
扶桑化学工業	4,400	2,542.00	11,184,800	
ＡＤＥＫＡ	25,100	1,539.00	38,628,900	
日油	48,000	1,059.00	50,832,000	
ミヨシ油脂	56,000	141.00	7,896,000	
花　王	155,300	5,267.00	817,965,100	
第一工業製薬	19,000	353.00	6,707,000	
三洋化成	3,500	4,830.00	16,905,000	
武田薬品	228,700	4,685.00	1,071,459,500	
アステラス製薬	623,600	1,579.50	984,976,200	
大日本住友製薬	42,900	1,869.00	80,180,100	
塩野義製薬	82,700	5,410.00	447,407,000	
田辺三菱製薬	71,000	2,151.00	152,721,000	
あすか製薬	7,100	1,697.00	12,048,700	
日本新薬	14,100	5,320.00	75,012,000	
中外製薬	61,000	3,215.00	196,115,000	
科研製薬	11,400	6,080.00	69,312,000	
エーザイ	75,100	6,609.00	496,335,900	
理研ビタミン	2,000	4,435.00	8,870,000	
ロート製薬	29,600	1,616.00	47,833,600	
小野薬品	139,100	2,533.50	352,409,850	
久光製薬	17,200	5,500.00	94,600,000	貸付株式数 4,800株
持田製薬	4,100	7,950.00	32,595,000	
参天製薬	112,100	1,396.00	156,491,600	
扶桑薬品	2,700	2,762.00	7,457,400	
日本ケミファ	1,300	5,350.00	6,955,000	
ツムラ	20,400	3,095.00	63,138,000	貸付株式数 5,700株
日医工	14,200	1,581.00	22,450,200	
テ　ル　モ	89,200	4,025.00	359,030,000	
みらかホールディングス	15,500	5,120.00	79,360,000	
キッセイ薬品工業	10,500	2,685.00	28,192,500	
生化学工業	11,400	1,637.00	18,661,800	
栄研化学	5,100	2,991.00	15,254,100	

日水製薬	4,500	1,200.00	5,400,000	
鳥居薬品	4,300	2,381.00	10,238,300	
ＪＣＲファーマ	4,900	2,860.00	14,014,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
東和薬品	2,900	4,125.00	11,962,500	
富士製薬工業	2,300	2,640.00	6,072,000	
沢井製薬	10,200	6,130.00	62,526,000	
ゼリア新薬工業	12,500	1,857.00	23,212,500	
第一三共	179,600	2,382.00	427,807,200	
キョーリン製薬ＨＤ	14,400	2,402.00	34,588,800	
大幸薬品	4,100	1,879.00	7,703,900	
ダイト	3,900	2,002.00	7,807,800	
大塚ホールディングス	131,300	4,647.00	610,151,100	
大正製薬ＨＤ	13,000	9,760.00	126,880,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
ペプチドリーム	10,400	5,700.00	59,280,000	貸付株式数 2,900株 (2,800株)
大日本塗料	37,000	217.00	8,029,000	
日本ペイントＨＯＬＤ	47,200	3,610.00	170,392,000	貸付株式数 13,200株
関西ペイント	63,800	2,095.00	133,661,000	貸付株式数 17,900株
中国塗料	17,600	779.00	13,710,400	
日本特殊塗料	5,000	1,383.00	6,915,000	
藤倉化成	11,100	613.00	6,804,300	
太陽ホールディングス	4,800	4,430.00	21,264,000	
ＤＩＣ	23,700	3,535.00	83,779,500	
サカタインクス	12,200	1,498.00	18,275,600	
東洋インキＳＣホールディン	55,000	520.00	28,600,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	6,300	965.00	6,079,500	
アルプス技研	2,900	2,618.00	7,592,200	
オリエンタルランド	65,900	6,517.00	429,470,300	
ダスキン	15,100	2,299.00	34,714,900	
パーク２４	29,100	3,250.00	94,575,000	
明光ネットワークジャパン	9,000	989.00	8,901,000	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
ファルコホールディングス	6,400	1,406.00	8,998,400	
フジ・メディア・ＨＤ	59,500	1,534.00	91,273,000	
ラウンドワン	19,700	797.00	15,700,900	
リゾートトラスト	23,600	2,215.00	52,274,000	
オービック	19,900	5,030.00	100,097,000	
ジャストシステム	10,100	1,084.00	10,948,400	

ＴＤＣソフトウェアエンジニア	4,700	1,123.00	5,278,100		
ヤフー	418,700	416.00	174,179,200	貸付株式数	116,500株 (113,900株)
ビー・エム・エル	8,100	2,634.00	21,335,400		
トレンドマイクロ	30,500	4,110.00	125,355,000		
りらいあコミュニケーショ	10,300	1,101.00	11,340,300		
リソー教育	11,500	575.00	6,612,500		
日本オラクル	9,400	5,700.00	53,580,000		
フューチャー	10,200	727.00	7,415,400		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,700	901.00	6,036,700		
ソフトバンク・テクノ	1,600	2,735.00	4,376,000		
ユー・エス・エス	73,600	1,831.00	134,761,600		
オービックビジネスＣ	3,000	4,820.00	14,460,000	貸付株式数	800株 (800株)
伊藤忠テクノソリュー	13,200	3,080.00	40,656,000		
アイティフォー	11,100	636.00	7,059,600		
サイバーエージェント	32,300	2,781.00	89,826,300		
楽天	312,300	1,128.00	352,274,400	貸付株式数	87,000株
テー・オー・ダブリュー	8,000	646.00	5,168,000		
大塚商会	15,500	5,570.00	86,335,000		
総合メディカル	3,100	3,475.00	10,772,500		
サイボウズ	12,600	447.00	5,632,200		
ソフトブレーン	10,100	392.00	3,959,200		
セントラルスポーツ	3,100	2,698.00	8,363,800		
パラカ	2,700	2,029.00	5,478,300		
電通国際情報Ｓ	3,900	1,853.00	7,226,700		
デジタルガレージ	9,200	2,006.00	18,455,200		
ウェザーニューズ	2,200	3,360.00	7,392,000	貸付株式数	700株 (700株)
ＣＩＪ	16,400	519.00	8,511,600		
WOWOW	3,100	2,994.00	9,281,400	貸付株式数	800株
フルキャストホールディングス	7,100	905.00	6,425,500	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
富士フイルムＨＬＤＧＳ	120,800	4,249.00	513,279,200		
コニカミノルタ	135,000	1,092.00	147,420,000		
資　生　堂	116,000	2,909.00	337,444,000		
ライオン	76,000	1,860.00	141,360,000		
高砂香料	4,100	3,090.00	12,669,000		
マンダム	6,200	4,910.00	30,442,000		

ミルボン	3,500	4,640.00	16,240,000		
ファンケル	13,200	1,581.00	20,869,200	貸付株式数	3,900株 (3,900株)
コーセー	10,000	9,170.00	91,700,000		
シーズ・ホールディングス	8,000	2,960.00	23,680,000	貸付株式数	2,600株 (2,600株)
ポーラ・オルビスＨＤ	6,300	8,870.00	55,881,000		
ノエビアホールディングス	3,900	3,580.00	13,962,000		
コ　ニ　シ	9,900	1,277.00	12,642,300		
長谷川香料	7,600	1,944.00	14,774,400		
星光ＰＭＣ	4,200	1,206.00	5,065,200	貸付株式数	1,100株 (100株)
小林製薬	17,100	5,010.00	85,671,000		
荒川化学工業	5,500	1,583.00	8,706,500		
メック	5,600	991.00	5,549,600		
日本高純度化学	3,800	2,526.00	9,598,800	貸付株式数	800株 (800株)
タカラバイオ	13,200	1,461.00	19,285,200	貸付株式数	3,600株
ＪＣＵ	2,100	5,000.00	10,500,000		
新田ゼラチン	8,500	734.00	6,239,000		
デクセリアルズ	15,900	970.00	15,423,000		
アース製薬	4,500	4,750.00	21,375,000	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
イハラケミカル	9,200	1,037.00	9,540,400		
北興化学	15,000	371.00	5,565,000		
大成ラミック	3,400	2,971.00	10,101,400		
クミアイ化学	13,400	680.00	9,112,000	貸付株式数	3,700株 (3,700株)
日本農薬	14,100	615.00	8,671,500	貸付株式数	100株 (100株)
昭和シエル石油	54,300	1,021.00	55,440,300		
ニチレキ	9,400	905.00	8,507,000		
東燃ゼネラル石油	98,000	1,089.00	106,722,000		
ユシロ化学	4,800	1,400.00	6,720,000		
富士石油	16,700	322.00	5,377,400		
ＭＯＲＥＳＣＯ	3,800	1,630.00	6,194,000		
出光興産	28,700	2,588.00	74,275,600		
ＪＸホールディングス	672,200	436.40	293,348,080	貸付株式数	189,100株 (189,100株)

コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	18,400	1,450.00	26,680,000	貸付株式数	5,100株 (5,100株)
横浜ゴム	36,700	2,067.00	75,858,900		
東洋ゴム	32,400	1,397.00	45,262,800		
ブリヂストン	206,000	4,367.00	899,602,000		
住友ゴム	56,700	1,889.00	107,106,300		
藤倉ゴム	10,700	664.00	7,104,800	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
オカモト	19,000	1,069.00	20,311,000	貸付株式数	5,000株 (5,000株)
アキレス	5,900	1,597.00	9,422,300		
ニッタ	5,400	2,945.00	15,903,000		
住友理工	10,600	1,016.00	10,769,600		
三ツ星ベルト	15,000	1,010.00	15,150,000		
バンドー化学	11,400	1,016.00	11,582,400		
旭　硝　子	300,000	743.00	222,900,000		
日本板硝子	28,000	805.00	22,540,000		
有沢製作所	12,800	629.00	8,051,200		
日本山村硝子	34,000	192.00	6,528,000		
日本電気硝子	125,000	610.00	76,250,000		
住友大阪セメント	113,000	404.00	45,652,000		
太平洋セメント	369,000	358.00	132,102,000		
日本ヒユーム	8,700	702.00	6,107,400		
日本コンクリート	17,500	343.00	6,002,500	貸付株式数	3,800株 (3,800株)
アジアパイルＨＤ	11,100	508.00	5,638,800		
東海カーボン	56,000	381.00	21,336,000		
日本カーボン	36,000	248.00	8,928,000	貸付株式数	10,000株 (9,000株)
東洋炭素	4,000	1,687.00	6,748,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
ノリタケ	3,600	2,588.00	9,316,800		
ＴＯＴＯ	44,800	4,385.00	196,448,000		
日本碍子	77,100	2,186.00	168,540,600		
日本特殊陶業	52,700	2,346.00	123,634,200		
ＭＡＲＵＷＡ	2,400	3,985.00	9,564,000		
品川リフラクトリーズ	25,000	253.00	6,325,000		
黒崎播磨	18,000	318.00	5,724,000		
フジミインコーポレーテッド	5,600	1,978.00	11,076,800	貸付株式数	1,500株 (1,500株)

ニチアス	32,000	1,107.00	35,424,000	貸付株式数	8,000株 (8,000株)
新日鐵住金	275,100	2,453.00	674,820,300		
神戸製鋼所	104,300	1,079.00	112,539,700		
中山製鋼所	7,800	708.00	5,522,400		
合同製鐵	3,700	2,172.00	8,036,400		
ＪＦＥホールディングス	166,400	1,670.00	277,888,000		
日新製鋼	27,400	1,465.00	40,141,000	貸付株式数	7,600株 (7,600株)
東京製鐵	30,600	825.00	25,245,000		
共英製鋼	6,600	2,074.00	13,688,400		
大和工業	12,200	3,250.00	39,650,000		
東京鐵鋼	16,000	468.00	7,488,000		
大阪製鐵	4,200	2,085.00	8,757,000		
淀川製鋼所	8,300	3,160.00	26,228,000		
東洋鋼鈑	15,800	376.00	5,940,800		
丸一鋼管	20,200	3,685.00	74,437,000		
大同特殊鋼	101,000	469.00	47,369,000		
日本高周波	89,000	89.00	7,921,000		
日本冶金工	61,300	196.00	12,014,800	貸付株式数	17,300株 (17,300株)
山陽特殊製鋼	36,000	573.00	20,628,000		
愛知製鋼	3,500	5,280.00	18,480,000		
日立金属	61,800	1,495.00	92,391,000		
大平洋金属	39,000	382.00	14,898,000		
新日本電工	41,200	228.00	9,393,600		
栗本鉄工所	3,300	2,375.00	7,837,500		
日本鋳鉄管	25,000	189.00	4,725,000		
日本製鋼所	20,400	2,033.00	41,473,200		
三菱製鋼	45,000	227.00	10,215,000		
大紀アルミニウム	15,000	501.00	7,515,000		
日本軽金属ＨＤ	133,600	255.00	34,068,000		
三井金属	165,000	266.00	43,890,000		
東邦亜鉛	36,000	439.00	15,804,000		
三菱マテリアル	37,800	3,385.00	127,953,000		
住友鉱山	158,000	1,528.00	241,424,000		
ＤＯＷＡホールディングス	68,000	878.00	59,704,000		
古河機金	98,000	207.00	20,286,000	貸付株式数	27,000株 (27,000株)

大阪チタニウム	7,100	1,610.00	11,431,000	貸付株式数	1,900株 (1,800株)
東邦チタニウム	11,000	760.00	8,360,000	貸付株式数	3,200株 (3,200株)
ＵＡＣＪ	78,000	330.00	25,740,000		
古河電工	20,200	3,535.00	71,407,000		
住友電工	229,800	1,602.50	368,254,500		
フジクラ	78,900	617.00	48,681,300		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	104,000	85.00	8,840,000		
タツタ電線	13,600	463.00	6,296,800		
リョービ	38,000	457.00	17,366,000		
アーレステイ	7,800	1,047.00	8,166,600		
アサヒＨＤ	9,200	2,018.00	18,565,600		
東洋製罐グループＨＤ	42,600	2,154.00	91,760,400		
ホッカンホールディングス	21,000	407.00	8,547,000		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	11,100	1,311.00	14,552,100		
ＯＳＪＢ　ＨＤ	24,200	239.00	5,783,800	貸付株式数	6,500株 (6,500株)
駒井ハルテック	2,800	2,097.00	5,871,600		
三和ホールディングス	60,500	1,130.00	68,365,000		
文化シヤツター	17,600	869.00	15,294,400		
三協立山	8,100	1,562.00	12,652,200		
アルインコ	6,500	1,003.00	6,519,500		
ＬＩＸＩＬグループ	85,100	2,544.00	216,494,400	貸付株式数	23,800株 (23,800株)
ノーリツ	11,800	2,034.00	24,001,200		
長府製作所	6,800	2,661.00	18,094,800		
リンナイ	10,400	9,730.00	101,192,000		
ユニプレス	11,200	2,191.00	24,539,200		
岡　部	13,400	1,010.00	13,534,000		
ジーテクト	6,400	2,117.00	13,548,800		
東　プ　レ	11,700	2,704.00	31,636,800		
高周波熱錬	12,000	908.00	10,896,000		
東京製綱	4,600	2,108.00	9,696,800	貸付株式数	1,300株
パイオラックス	3,100	6,870.00	21,297,000		
日本発条	56,000	1,072.00	60,032,000	貸付株式数	14,900株
三浦工業	25,100	1,726.00	43,322,600		
タ　ク　マ	20,000	960.00	19,200,000		
テクノプロ・ホールディング	9,900	3,635.00	35,986,500		

ジャパンマテリアル	2,400	3,715.00	8,916,000	貸付株式数	700株 (300株)
ベクトル	5,600	1,206.00	6,753,600		
アサンテ	3,600	1,699.00	6,116,400		
Ｎ・フィールド	3,800	1,326.00	5,038,800	貸付株式数	1,000株
リクルートホールディングス	133,100	4,365.00	580,981,500		
ツ　ガ　ミ	18,000	630.00	11,340,000	貸付株式数	5,000株 (5,000株)
オークマ	39,000	1,001.00	39,039,000	貸付株式数	11,000株 (11,000株)
東芝機械	37,000	430.00	15,910,000		
アマダホールディングス	81,300	1,273.00	103,494,900		
アイダエンジニア	17,600	1,049.00	18,462,400		
滝澤鉄工所	54,000	153.00	8,262,000		
富士機械製造	18,200	1,298.00	23,623,600	貸付株式数	5,600株
牧野フライス	30,000	808.00	24,240,000		
オーエスジー	27,400	2,261.00	61,951,400	貸付株式数	7,600株 (7,600株)
旭ダイヤモンド	17,800	844.00	15,023,200		
ＤＭＧ森精機	36,000	1,322.00	47,592,000	貸付株式数	9,400株 (9,400株)
ソディツク	16,000	880.00	14,080,000		
ディスコ	7,100	13,560.00	96,276,000		
日東工器	3,900	2,451.00	9,558,900		
日本郵政	159,400	1,417.00	225,869,800		
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	9,700	933.00	9,050,100		
豊田自動織機	53,000	5,360.00	284,080,000		
ＯＫＫ	67,000	117.00	7,839,000		
島精機製作所	8,000	3,460.00	27,680,000		
フリュー	1,400	3,350.00	4,690,000		
日阪製作所	10,000	815.00	8,150,000		
やまびこ	11,700	1,340.00	15,678,000		
ペガサスミシン製造	8,400	653.00	5,485,200		
ナブテスコ	31,600	2,908.00	91,892,800		
三井海洋開発	6,000	1,740.00	10,440,000	貸付株式数	1,600株
レオン自動機	6,600	894.00	5,900,400		
ＳＭＣ	18,300	32,520.00	595,116,000		
新川	7,200	679.00	4,888,800		
ホソカワミクロン	13,000	686.00	8,918,000		

ユニオンツール	2,700	2,826.00	7,630,200	貸付株式数	800株 (800株)
オイレス工業	7,700	2,066.00	15,908,200		
サトーホールディングス	7,700	2,258.00	17,386,600		
日精樹脂工業	6,200	1,039.00	6,441,800		
小松製作所	281,700	2,633.50	741,856,950	貸付株式数	83,600株 (83,600株)
住友重機械	177,000	689.00	121,953,000		
日立建機	27,000	2,354.00	63,558,000		
巴工業	4,900	1,519.00	7,443,100		
井関農機	63,000	227.00	14,301,000	貸付株式数	18,000株 (18,000株)
ＴＯＷＡ	5,700	1,341.00	7,643,700		
丸山製作所	43,000	193.00	8,299,000		
北川鉄工所	3,900	2,279.00	8,888,100		
シンニッタン	11,400	605.00	6,897,000		
ローツェ	2,400	1,658.00	3,979,200	貸付株式数	600株
クボタ	293,000	1,727.50	506,157,500	貸付株式数	81,300株 (81,300株)
東洋エンジニア	38,000	320.00	12,160,000		
三菱化工機	34,000	207.00	7,038,000		
月島機械	11,900	1,250.00	14,875,000		
帝国電機製作所	6,800	869.00	5,909,200		
新東工業	14,600	922.00	13,461,200		
渋谷工業	5,300	2,220.00	11,766,000		
アイチ　コーポレーション	9,900	849.00	8,405,100		
小森コーポレーション	14,600	1,462.00	21,345,200		
鶴見製作所	5,200	1,721.00	8,949,200		
住友精密	18,000	348.00	6,264,000		
荏原製作所	25,100	2,974.00	74,647,400		
酉島製作所	7,700	1,083.00	8,339,100	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
北越工業	10,000	776.00	7,760,000		
千代田化工建	46,000	821.00	37,766,000		
ダイキン工業	79,500	10,715.00	851,842,500		
オルガノ	16,000	472.00	7,552,000		
トーヨーカネツ	34,000	354.00	12,036,000		
栗田工業	33,700	2,378.00	80,138,600		
椿本チエイン	34,000	900.00	30,600,000		
日　機　装	20,000	1,038.00	20,760,000		

新興プランテック	14,800	807.00	11,943,600	
アネスト岩田	11,500	1,136.00	13,064,000	
ダイフク	29,400	2,210.00	64,974,000	
加藤製作所	3,800	2,936.00	11,156,800	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
油研工業	38,000	202.00	7,676,000	
タダノ	30,300	1,218.00	36,905,400	
フジテック	17,100	1,255.00	21,460,500	
ＣＫＤ	17,500	1,376.00	24,080,000	
キトー	8,500	1,118.00	9,503,000	
平和	17,700	2,461.00	43,559,700	
理想科学工業	6,000	1,979.00	11,874,000	
ＳＡＮＫＹＯ	15,800	3,615.00	57,117,000	
日本金銭機械	5,900	1,556.00	9,180,400	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	3,500	2,055.00	7,192,500	
福島工業	3,800	3,300.00	12,540,000	
ダイコク電機	3,300	1,706.00	5,629,800	貸付株式数 900株 (900株)
竹内製作所	10,800	2,438.00	26,330,400	
ア　マ　ノ	17,900	1,919.00	34,350,100	
ＪＵＫＩ	10,200	973.00	9,924,600	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
サンデンホールディングス	37,000	365.00	13,505,000	貸付株式数 10,000株
蛇の目ミシン	7,300	796.00	5,810,800	
ブラザー工業	75,500	1,956.00	147,678,000	
マックス	9,000	1,346.00	12,114,000	
モリタホールディングス	11,000	1,638.00	18,018,000	
グローリー	18,500	3,735.00	69,097,500	
新晃工業	4,800	1,322.00	6,345,600	
大和冷機工業	9,900	897.00	8,880,300	
セガサミーホールディングス	57,700	1,710.00	98,667,000	
日本ピストンリング	4,700	1,870.00	8,789,000	
リ　ケ　ン	3,000	4,180.00	12,540,000	
ＴＰＲ	6,500	3,200.00	20,800,000	
ツバキ・ナカシマ	6,700	1,678.00	11,242,600	
ホシザキ	12,800	9,690.00	124,032,000	
大豊工業	5,200	1,600.00	8,320,000	
日本精工	119,800	1,246.00	149,270,800	
Ｎ　Ｔ　Ｎ	133,000	429.00	57,057,000	

ジェイテクト	61,700	1,830.00	112,911,000		
不　二　越	57,000	439.00	25,023,000	貸付株式数	15,000株 (15,000株)
ミネベア	93,900	1,134.00	106,482,600		
日本トムソン	20,500	430.00	8,815,000		
Ｔ　Ｈ　Ｋ	40,900	2,461.00	100,654,900		
ユーシン精機	2,900	2,643.00	7,664,700	貸付株式数	800株 (800株)
イーグル工業	6,500	1,525.00	9,912,500		
日本ピラー工業	7,300	1,219.00	8,898,700		
キッツ	27,700	659.00	18,254,300		
日　立	1,397,000	609.30	851,192,100		
東　芝	1,304,000	425.20	554,460,800		
三菱電機	621,700	1,576.50	980,110,050		
富士電機	174,000	562.00	97,788,000		
東洋電機製造	3,600	1,558.00	5,608,800		
安川電機	67,100	1,755.00	117,760,500		
シンフォニア　テクノロジー	44,000	244.00	10,736,000		
明　電　舎	53,000	365.00	19,345,000		
山洋電気	16,000	736.00	11,776,000		
デンヨー	5,700	1,454.00	8,287,800		
日立工機	14,900	1,046.00	15,585,400		
三桜工業	10,200	731.00	7,456,200		
マキタ	38,000	7,750.00	294,500,000		
東芝テック	36,000	565.00	20,340,000	貸付株式数	10,000株 (10,000株)
芝浦メカトロニクス	18,000	264.00	4,752,000		
マブチモーター	16,500	6,370.00	105,105,000		
日本電産	75,600	10,240.00	774,144,000		
東光高岳	3,400	1,993.00	6,776,200		
ダブル・スコープ	5,800	1,898.00	11,008,400	貸付株式数	1,500株
ダイヘン	32,000	716.00	22,912,000	貸付株式数	8,000株 (8,000株)
田淵電機	12,200	366.00	4,465,200	貸付株式数	1,000株
ＪＶＣケンウッド	43,800	318.00	13,928,400		
日新電機	11,900	1,303.00	15,505,700		
大崎電気	12,000	1,151.00	13,812,000	貸付株式数	3,000株
オムロン	61,900	4,220.00	261,218,000		
日東工業	8,200	1,609.00	13,193,800		

ＩＤＥＣ	8,200	1,020.00	8,364,000	貸付株式数	2,300株 (2,300株)
ジーエス・ユアサ　コーポ	111,000	461.00	51,171,000		
サクサホールディングス	20,000	219.00	4,380,000		
メルコホールディングス	3,400	2,925.00	9,945,000	貸付株式数	1,000株
日本電気	800,000	298.00	238,400,000		
富　士　通	562,000	674.80	379,237,600		
沖　電　気	25,000	1,542.00	38,550,000		
電気興業	18,000	581.00	10,458,000		
サンケン電気	35,000	485.00	16,975,000		
アイホン	4,100	1,848.00	7,576,800		
ルネサスエレクトロニクス	32,100	856.00	27,477,600	貸付株式数	9,000株 (9,000株)
セイコーエプソン	86,600	2,293.00	198,573,800		
ワコム	46,500	307.00	14,275,500	貸付株式数	15,100株 (15,100株)
アルバック	10,700	3,435.00	36,754,500		
アクセル	5,200	850.00	4,420,000		
ＥＩＺＯ	5,700	3,370.00	19,209,000		
ジャパンディスプレイ	108,700	265.00	28,805,500	貸付株式数	30,400株 (30,400株)
日本信号	16,100	918.00	14,779,800		
京三製作所	19,000	384.00	7,296,000		
能美防災	6,900	1,799.00	12,413,100		
ホーチキ	5,100	1,376.00	7,017,600		
エレコム	5,400	1,961.00	10,589,400		
日本無線	4,000	1,407.00	5,628,000		
パナソニック	665,500	1,164.00	774,642,000		
アンリツ	41,300	579.00	23,912,700		
富士通ゼネラル	20,000	2,252.00	45,040,000		
日立国際電気	15,400	2,283.00	35,158,200	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
ソ　ニ　ー	411,300	3,288.00	1,352,354,400		
Ｔ　Ｄ　Ｋ	32,800	7,690.00	252,232,000		
帝国通信工業	32,000	169.00	5,408,000		
ミツミ電機	21,200	666.00	14,119,200		
タムラ製作所	24,000	441.00	10,584,000		
アルプス電気	53,900	2,873.00	154,854,700		
パイオニア	88,300	236.00	20,838,800		
日本電波工業	7,700	839.00	6,460,300		

日本トリム	1,500	4,270.00	6,405,000	貸付株式数	200株 (200株)
ローランド　ディー．ジー．	3,400	2,877.00	9,781,800	貸付株式数	900株 (900株)
フオスター電機	7,000	2,108.00	14,756,000		
クラリオン	31,000	372.00	11,532,000		
Ｓ　Ｍ　Ｋ	17,000	429.00	7,293,000		
ヨコオ	7,100	798.00	5,665,800		
ホシデン	18,500	935.00	17,297,500		
ヒロセ電機	9,400	13,690.00	128,686,000		
日本航空電子	18,000	1,540.00	27,720,000	貸付株式数	5,000株 (5,000株)
Ｔ　Ｏ　Ａ	8,000	957.00	7,656,000		
日立マクセル	8,500	2,005.00	17,042,500		
古野電気	8,700	797.00	6,933,900		
ユニデンホールディングス	40,000	157.00	6,280,000		
アルパイン	14,000	1,475.00	20,650,000		
スミダコーポレーション	5,300	1,030.00	5,459,000		
アイコム	4,000	1,960.00	7,840,000		
リオン	3,400	1,513.00	5,144,200		
船井電機	7,200	944.00	6,796,800	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
横河電機	62,500	1,585.00	99,062,500		
新電元工業	23,000	433.00	9,959,000		
アズビル	17,300	3,100.00	53,630,000		
日本光電工業	24,200	2,566.00	62,097,200	貸付株式数	6,800株
共和電業	15,500	400.00	6,200,000		
堀場製作所	11,400	5,090.00	58,026,000		
アドバンテスト	39,500	1,551.00	61,264,500		
エスペック	5,900	1,253.00	7,392,700		
キーエンス	13,200	78,230.00	1,032,636,000		
日置電機	3,500	2,067.00	7,234,500	貸付株式数	1,000株
シスメックス	45,300	6,890.00	312,117,000		
日本マイクロニクス	11,300	1,007.00	11,379,100		
メガチップス	5,800	2,709.00	15,712,200	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,500	5,280.00	18,480,000	貸付株式数	900株 (900株)
デンソー	143,800	4,980.00	716,124,000		
コーセル	8,700	1,162.00	10,109,400		

イリソ電子工業	1,900	6,730.00	12,787,000		
オプテックス	4,500	2,864.00	12,888,000		
千代田インテグレ	3,400	2,294.00	7,799,600		
レーザーテック	7,100	2,091.00	14,846,100		
スタンレー電気	41,500	3,155.00	130,932,500		
岩崎電気	38,000	174.00	6,612,000		
ウシオ電機	35,400	1,379.00	48,816,600		
日本セラミック	5,100	2,107.00	10,745,700	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
遠藤照明	6,400	853.00	5,459,200		
日本デジタル研究所	6,100	2,412.00	14,713,200		
古河電池	6,000	809.00	4,854,000		
山一電機	6,800	1,079.00	7,337,200		
図　研	5,300	1,106.00	5,861,800		
日本電子	22,000	451.00	9,922,000	貸付株式数	6,000株 (6,000株)
カ　シ　オ	48,700	1,495.00	72,806,500	貸付株式数	13,700株
ファナック	59,100	19,305.00	1,140,925,500		
日本シイエムケイ	13,800	600.00	8,280,000		
エンプラス	2,700	3,295.00	8,896,500		
ロ　ー　ム	28,200	6,250.00	176,250,000		
浜松ホトニクス	45,400	3,035.00	137,789,000	貸付株式数	12,500株
三井ハイテック	8,800	680.00	5,984,000		
新光電気工業	20,600	703.00	14,481,800		
京　セ　ラ	95,600	5,436.00	519,681,600		
太陽誘電	27,500	1,245.00	34,237,500	貸付株式数	8,000株
村田製作所	61,200	15,425.00	944,010,000		
ユーシン	10,000	734.00	7,340,000	貸付株式数	3,500株 (3,500株)
双葉電子工業	9,700	1,782.00	17,285,400		
日東電工	44,000	7,896.00	347,424,000		
北陸電気工業	45,000	128.00	5,760,000		
東海理化電機	15,300	2,243.00	34,317,900		
ニチコン	18,100	993.00	17,973,300		
日本ケミコン	56,000	232.00	12,992,000		
K　O　A	8,800	1,059.00	9,319,200		
三井造船	203,000	164.00	33,292,000		
日立造船	44,300	607.00	26,890,100		
三菱重工業	976,000	506.80	494,636,800		
川崎重工業	453,000	361.00	163,533,000		

ＩＨＩ	448,000	317.00	142,016,000	貸付株式数	124,000株 (124,000株)
名村造船所	18,100	714.00	12,923,400		
日本車輌	26,000	284.00	7,384,000	貸付株式数	8,000株 (8,000株)
ＦＰＧ	21,200	913.00	19,355,600	貸付株式数	5,800株
じもとホールディングス	52,500	191.00	10,027,500		
全国保証	16,400	3,875.00	63,550,000		
めぶきフィナンシャルＧ	276,400	416.00	114,982,400		
東京ＴＹフィナンシャルＧ	8,400	3,775.00	31,710,000		
九州フィナンシャルＧ	93,900	753.00	70,706,700		
かんぽ生命保険	21,700	2,309.00	50,105,300	貸付株式数	6,100株
ゆうちょ銀行	163,300	1,349.00	220,291,700		
富山第一銀行	15,900	523.00	8,315,700		
コンコルディア・フィナンシャル	374,900	525.50	197,009,950		
西日本フィナンシャルＨＤ	38,200	1,075.00	41,065,000		
日産自動車	697,200	1,056.50	736,591,800		
いすゞ自動車	169,100	1,349.00	228,115,900		
トヨタ自動車 ※	724,800	6,649.00	4,819,195,200		
日野自動車	83,000	1,161.00	96,363,000		
三菱自動車工業	214,600	529.00	113,523,400		
エフテック	4,400	1,286.00	5,658,400	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
武蔵精密工業	6,700	2,836.00	19,001,200		
日産車体	25,600	1,129.00	28,902,400		
新明和工業	23,000	962.00	22,126,000		
極東開発工業	11,900	1,480.00	17,612,000		
日信工業	12,300	1,680.00	20,664,000	貸付株式数	3,600株 (3,600株)
トピー工業	4,900	2,884.00	14,131,600		
ティラド	28,000	245.00	6,860,000		
曙ブレーキ	29,800	307.00	9,148,600	貸付株式数	10,100株 (10,100株)
タチエス	10,300	1,700.00	17,510,000		
Ｎ　Ｏ　Ｋ	28,100	2,275.00	63,927,500		
フタバ産業	19,200	692.00	13,286,400		
ＫＹＢ	65,000	520.00	33,800,000		
市光工業	16,000	377.00	6,032,000		
大同メタル工業	8,000	1,090.00	8,720,000		

プレス工業	31,500	499.00	15,718,500	
カルソニックカンセイ	40,000	1,754.00	70,160,000	
太平洋工業	12,200	1,430.00	17,446,000	貸付株式数 3,800株
ケーヒン	12,900	1,870.00	24,123,000	
河西工業	8,300	1,260.00	10,458,000	
アイシン精機	53,300	4,890.00	260,637,000	
マ　ツ　ダ	184,200	1,834.00	337,822,800	
今仙電機製作所	7,300	932.00	6,803,600	貸付株式数 1,900株
本田技研	524,500	3,332.00	1,747,634,000	
スズキ	115,800	3,680.00	426,144,000	
富士重工業	181,000	4,645.00	840,745,000	
ヤマハ発動機	82,400	2,631.00	216,794,400	貸付株式数 22,700株
ショーワ	16,100	684.00	11,012,400	
小糸製作所	35,000	5,960.00	208,600,000	
ＴＢＫ	17,100	476.00	8,139,600	
エクセディ	7,500	3,145.00	23,587,500	
ミツバ	10,900	1,628.00	17,745,200	
豊田合成	18,400	2,470.00	45,448,000	
愛三工業	9,900	929.00	9,197,100	
ヨ　ロ　ズ	5,700	1,608.00	9,165,600	
エフ・シー・シー	9,600	1,978.00	18,988,800	
シマノ	23,500	18,790.00	441,565,000	
テイ・エス　テック	13,400	3,015.00	40,401,000	
ジャムコ	3,700	2,260.00	8,362,000	貸付株式数 1,100株 (900株)
小　野　建	5,800	1,223.00	7,093,400	
ノ　ジ　マ	6,900	1,337.00	9,225,300	
佐鳥電機	8,900	712.00	6,336,800	
カッパ・クリエイト	8,800	1,236.00	10,876,800	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
伯東	5,500	1,004.00	5,522,000	
コンドーテック	8,300	809.00	6,714,700	
ライトオン	5,100	1,012.00	5,161,200	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,600	2,372.00	20,399,200	
三菱食品	6,200	3,295.00	20,429,000	
良品計画	7,600	22,430.00	170,468,000	貸付株式数 1,800株
松田産業	4,800	1,461.00	7,012,800	
第一興商	9,300	4,465.00	41,524,500	
メディパルＨＤ	57,400	1,637.00	93,963,800	

アドヴァン	6,800	1,113.00	7,568,400		
萩原電気	3,300	2,087.00	6,887,100		
アルビス	2,400	2,941.00	7,058,400		
アズワン	4,500	4,875.00	21,937,500		
シモジマ	6,200	1,093.00	6,776,600		
ドウシシャ	7,100	2,064.00	14,654,400		
小津産業	2,600	2,096.00	5,449,600		
コナカ	12,500	544.00	6,800,000		
コーナン商事	8,100	2,163.00	17,520,300		
黒田電気	7,800	2,298.00	17,924,400		
ネットワンシステムズ	25,300	772.00	19,531,600		
ワタミ	7,200	1,094.00	7,876,800	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	37,300	4,375.00	163,187,500		
丸文	8,200	684.00	5,608,800		
西松屋チェーン	10,300	1,480.00	15,244,000		
ゼンショーホールディングス	29,800	1,956.00	58,288,800		
ハピネット	5,800	1,319.00	7,650,200	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
幸楽苑ホールディングス	5,700	1,582.00	9,017,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
日本ライフライン	5,000	2,585.00	12,925,000		
サイゼリヤ	9,400	2,765.00	25,991,000		
エクセル	3,400	1,437.00	4,885,800		
ＶＴホールディングス	20,400	558.00	11,383,200		
マルカキカイ	3,500	1,414.00	4,949,000		
アルゴグラフィックス	3,700	2,175.00	8,047,500		
ＩＤＯＭ	16,600	568.00	9,428,800	貸付株式数	4,600株
ポプラ	11,400	505.00	5,757,000		
ユナイテッドアローズ	7,800	2,881.00	22,471,800		
進和	4,500	1,673.00	7,528,500		
ハイデイ日高	5,400	2,701.00	14,585,400	貸付株式数	1,500株
シークス	4,100	3,830.00	15,703,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
京都きもの友禅	10,700	948.00	10,143,600		
コロワイド	18,800	1,896.00	35,644,800	貸付株式数	5,700株 (5,700株)
壱番屋	5,200	3,750.00	19,500,000	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
スギホールディングス	12,600	5,340.00	67,284,000		

島津製作所	75,000	1,743.00	130,725,000		
Ｊ　Ｍ　Ｓ	24,000	286.00	6,864,000		
ブイ・テクノロジー	1,200	11,990.00	14,388,000	貸付株式数	400株 (400株)
スター精密	10,000	1,556.00	15,560,000		
東京計器	32,000	215.00	6,880,000		
東京精密	11,100	3,220.00	35,742,000		
マニー	7,800	2,430.00	18,954,000		
ニコン	100,500	1,680.00	168,840,000	貸付株式数	30,000株
トプコン	29,500	1,699.00	50,120,500	貸付株式数	5,600株
オリンパス	92,800	4,020.00	373,056,000		
理研計器	5,700	1,482.00	8,447,400		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	12,000	6,820.00	81,840,000		
キヤノン電子	5,000	1,708.00	8,540,000		
タムロン	5,200	1,919.00	9,978,800	貸付株式数	1,500株
ＨＯＹＡ	122,200	4,499.00	549,777,800		
ノーリツ鋼機	6,900	785.00	5,416,500		
エー・アンド・デイ	12,700	459.00	5,829,300		
キヤノン	312,800	3,261.00	1,020,040,800		
リ　コ　ー	174,100	921.00	160,346,100		
シチズン時計	64,000	699.00	44,736,000	貸付株式数	17,900株 (17,900株)
リズム時計	39,000	185.00	7,215,000		
大研医器	6,900	833.00	5,747,700	貸付株式数	1,900株 (500株)
メニコン	4,100	2,901.00	11,894,100		
パラマウントベッドＨＤ	5,600	4,190.00	23,464,000	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ニホンフラッシュ	3,800	1,192.00	4,529,600		
前田工繊	7,000	1,228.00	8,596,000	貸付株式数	1,600株
永大産業	13,000	491.00	6,383,000		
アートネイチャー	8,500	621.00	5,278,500		
ダンロップスポーツ	4,500	1,050.00	4,725,000		
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	64,300	3,265.00	209,939,500		
共立印刷	27,200	313.00	8,513,600		
ＳＨＯＥＩ	3,200	2,029.00	6,492,800		
フランスベッドＨＬＤＧＳ	7,800	911.00	7,105,800		
マーベラス	10,300	775.00	7,982,500	貸付株式数	3,000株 (2,800株)

パイロットコーポレーション	10,300	4,735.00	48,770,500	
萩原工業	2,500	2,428.00	6,070,000	
エイベックス・グループＨＤ	10,600	1,581.00	16,758,600	
トッパン・フォームズ	9,400	1,090.00	10,246,000	
フジシールインターナショナル	6,600	4,630.00	30,558,000	
タカラトミー	23,000	1,163.00	26,749,000	
レック	2,600	3,340.00	8,684,000	
大建工業	4,500	2,006.00	9,027,000	
き　も　と	20,300	247.00	5,014,100	
凸版印刷	161,000	1,037.00	166,957,000	
大日本印刷	167,000	1,082.00	180,694,000	
共同印刷	21,000	382.00	8,022,000	
日本写真印刷	9,900	2,423.00	23,987,700	貸付株式数 2,800株 (2,700株)
光村印刷	25,000	213.00	5,325,000	
藤森工業	4,700	2,763.00	12,986,100	
宝印刷	4,800	1,405.00	6,744,000	
前澤化成工業	8,500	1,174.00	9,979,000	
アシックス	57,900	2,408.00	139,423,200	
ツ　ツ　ミ	2,700	1,814.00	4,897,800	
ジェイ　エス　ピー	2,800	2,848.00	7,974,400	
ニ　チ　ハ	8,300	2,876.00	23,870,800	
エフピコ	5,500	5,690.00	31,295,000	
ヤマハ	39,200	3,485.00	136,612,000	
河合楽器	3,200	2,144.00	6,860,800	
クリナップ	8,100	946.00	7,662,600	
ピジョン	35,400	2,883.00	102,058,200	
天馬	4,200	1,857.00	7,799,400	
キングジム	7,800	848.00	6,614,400	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
リンテック	13,100	2,425.00	31,767,500	
信越ポリマー	13,100	763.00	9,995,300	
東　リ	22,200	380.00	8,436,000	
イトーキ	12,900	745.00	9,610,500	
任　天　堂	35,900	27,775.00	997,122,500	
三菱鉛筆	4,900	5,950.00	29,155,000	
松　風	4,100	1,350.00	5,535,000	
タカラスタンダード	12,100	1,892.00	22,893,200	
コ　ク　ヨ	30,300	1,335.00	40,450,500	

ナカバヤシ	21,000	250.00	5,250,000	
ニ　フ　コ	10,500	6,280.00	65,940,000	
グローブライド	3,500	1,798.00	6,293,000	
岡村製作所	19,800	973.00	19,265,400	
日本バルカー	5,800	1,492.00	8,653,600	
伊　藤　忠	421,500	1,562.00	658,383,000	
丸　紅	564,900	626.30	353,796,870	
スクロール	12,100	353.00	4,271,300	
高　島	37,000	190.00	7,030,000	
ヨンドシーホールディングス	4,500	2,627.00	11,821,500	
三陽商会	40,000	158.00	6,320,000	貸付株式数　11,000株
長瀬産業	32,000	1,434.00	45,888,000	
蝶　理	4,300	1,709.00	7,348,700	
豊田通商	63,600	2,859.00	181,832,400	
オンワードホールディングス	38,000	751.00	28,538,000	貸付株式数　9,000株 (9,000株)
兼　松	121,000	189.00	22,869,000	
美　津　濃	31,000	556.00	17,236,000	
ユニー・ファミリーマートＨＤ	25,300	7,150.00	180,895,000	貸付株式数　7,100株
三井物産	521,200	1,541.50	803,429,800	
日本紙パルプ	28,000	348.00	9,744,000	
東京エレクトロン	38,900	10,475.00	407,477,500	
日立ハイテクノロジーズ	19,900	4,510.00	89,749,000	
カメイ	7,800	1,044.00	8,143,200	
ＯＵＧホールディングス	28,000	259.00	7,252,000	
スターゼン	2,400	4,740.00	11,376,000	
セイコーＨＤ	40,000	403.00	16,120,000	貸付株式数　11,000株
山　善	22,200	897.00	19,913,400	
住友商事	361,500	1,365.00	493,447,500	
日本ユニシス	16,300	1,412.00	23,015,600	
内田洋行	19,000	458.00	8,702,000	
三菱商事	432,400	2,471.50	1,068,676,600	
第一実業	16,000	671.00	10,736,000	
キヤノンマーケティングＪＰＮ	16,200	1,802.00	29,192,400	
西華産業	23,000	328.00	7,544,000	
菱洋エレクトロ	6,200	1,376.00	8,531,200	
ユアサ商事	5,400	2,813.00	15,190,200	
神鋼商事	3,300	2,201.00	7,263,300	

阪和興業	57,000	743.00	42,351,000		
カナデン	7,600	1,014.00	7,706,400		
菱電商事	11,000	742.00	8,162,000		
ニプロ	39,300	1,258.00	49,439,400		
岩谷産業	62,000	619.00	38,378,000		
すてきナイスグループ	45,000	152.00	6,840,000		
兼松エレクトロニクス	3,800	2,469.00	9,382,200		
三愛石油	16,200	787.00	12,749,400		
稲畑産業	13,600	1,209.00	16,442,400		
ゴールドウイン	2,700	4,960.00	13,392,000	貸付株式数	700株 (700株)
ユニ・チャーム	123,900	2,434.50	301,634,550	貸付株式数	34,600株
デサント	14,100	1,253.00	17,667,300		
ワ　キ　タ	12,700	939.00	11,925,300		
東邦ホールディングス	18,200	2,216.00	40,331,200		
サンゲツ	19,600	1,997.00	39,141,200		
ミツウロコグループ	9,600	704.00	6,758,400		
シナネンホールディングス	3,000	1,991.00	5,973,000		
伊藤忠エネクス	12,600	864.00	10,886,400		
サンリオ	17,300	2,014.00	34,842,200		
リョーサン	8,400	3,440.00	28,896,000		
新光商事	7,800	1,212.00	9,453,600		
トーホー	3,500	2,493.00	8,725,500		
三信電気	7,500	939.00	7,042,500		
東陽テクニカ	8,300	955.00	7,926,500		
モスフード　サービス	7,400	3,405.00	25,197,000	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
加賀電子	5,700	1,893.00	10,790,100		
三益半導体	5,300	1,371.00	7,266,300		
木曽路	7,100	2,283.00	16,209,300	貸付株式数	2,400株
サトレストランシステムズ	9,400	817.00	7,679,800	貸付株式数	2,600株 (2,600株)
千　趣　会	11,400	751.00	8,561,400	貸付株式数	3,900株 (3,900株)
ケーヨー	12,100	542.00	6,558,200	貸付株式数	3,600株 (2,100株)
上新電機	14,000	952.00	13,328,000		
日本瓦斯	10,600	3,290.00	34,874,000		
ロイヤルホールディングス	9,300	1,935.00	17,995,500	貸付株式数	2,800株 (2,800株)

いなげや	6,600	1,425.00	9,405,000		
島　忠	14,600	2,951.00	43,084,600		
チヨダ	6,800	2,652.00	18,033,600		
ライフコーポレーション	4,500	3,245.00	14,602,500		
リンガーハツト	5,800	2,091.00	12,127,800	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ＡＯＫＩホールディングス	11,100	1,339.00	14,862,900		
オークワ	8,000	1,169.00	9,352,000		
コメリ	8,900	2,708.00	24,101,200		
青山商事	11,800	3,885.00	45,843,000		
しまむら	6,700	13,620.00	91,254,000		
高　島　屋	95,000	949.00	90,155,000	貸付株式数	23,000株
松　屋	13,400	1,016.00	13,614,400	貸付株式数	3,500株 (3,500株)
エイチ・ツー・オーリテイリング	29,000	1,711.00	49,619,000		
近鉄百貨店	23,000	353.00	8,119,000	貸付株式数	7,000株
丸井グループ	60,700	1,576.00	95,663,200		
クレディセゾン	43,200	2,051.00	88,603,200		
アクシアル　リテイリング	4,600	3,880.00	17,848,000		
イオン	236,500	1,576.00	372,724,000	貸付株式数	66,200株
イ　ズ　ミ	11,500	5,010.00	57,615,000	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
平　和　堂	11,600	2,263.00	26,250,800		
フ　ジ	6,500	2,224.00	14,456,000		
ヤオコー	6,600	4,350.00	28,710,000		
ゼビオホールディングス	7,600	1,760.00	13,376,000		
ケーズホールディングス	26,100	2,112.00	55,123,200		
ＰＡＬＴＡＣ	9,300	2,547.00	23,687,100		
新生銀行	545,000	183.00	99,735,000		
あおぞら銀行	360,000	393.00	141,480,000		
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	4,360,300	669.80	2,920,528,940		
りそなホールディングス	672,200	550.10	369,777,220		
三井住友トラストＨＤ	120,200	4,150.00	498,830,000		
三井住友フィナンシャルＧ	460,500	4,206.00	1,936,863,000		
第四銀行	69,000	480.00	33,120,000		
北越銀行	6,300	2,549.00	16,058,700		
千葉銀行	220,000	678.00	149,160,000		
群馬銀行	124,700	581.00	72,450,700		
武蔵野銀行	8,700	3,065.00	26,665,500		

千葉興業銀行	19,300	523.00	10,093,900		
筑波銀行	30,200	336.00	10,147,200		
七十七銀行	86,000	539.00	46,354,000		
青森銀行	45,000	376.00	16,920,000	貸付株式数	12,000株 (12,000株)
秋田銀行	37,000	369.00	13,653,000		
山形銀行	33,000	470.00	15,510,000	貸付株式数	9,000株
岩手銀行	3,600	4,610.00	16,596,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
東邦銀行	50,000	412.00	20,600,000		
東北銀行	64,000	148.00	9,472,000		
みちのく銀行	33,000	218.00	7,194,000		
ふくおかフィナンシャルG	232,000	495.00	114,840,000		
静岡銀行	155,000	925.00	143,375,000		
十六銀行	74,000	367.00	27,158,000		
スルガ銀行	58,800	2,577.00	151,527,600	貸付株式数	15,100株 (15,100株)
八十二銀行	108,200	613.00	66,326,600		
山梨中央銀行	35,000	506.00	17,710,000		
大垣共立銀行	76,000	411.00	31,236,000	貸付株式数	21,000株 (21,000株)
福井銀行	51,000	279.00	14,229,000	貸付株式数	14,000株 (14,000株)
北國銀行	58,000	397.00	23,026,000		
清水銀行	2,500	3,365.00	8,412,500		
滋賀銀行	49,000	596.00	29,204,000	貸付株式数	7,000株
南都銀行	5,400	4,155.00	22,437,000		
百五銀行	49,000	436.00	21,364,000		
京都銀行	102,000	793.00	80,886,000		
紀陽銀行	22,000	1,740.00	38,280,000		
三重銀行	3,800	2,246.00	8,534,800		
ほくほくフィナンシャルG	37,100	1,854.00	68,783,400		
広島銀行	168,000	504.00	84,672,000		
山陰合同銀行	34,300	873.00	29,943,900		
中国銀行	39,800	1,546.00	61,530,800		
鳥取銀行	4,200	1,774.00	7,450,800		
伊予銀行	59,200	734.00	43,452,800	貸付株式数	16,400株
百十四銀行	61,000	381.00	23,241,000		
四国銀行	44,000	294.00	12,936,000		
阿波銀行	47,000	674.00	31,678,000		

大分銀行	34,000	408.00	13,872,000	貸付株式数	9,000株 (9,000株)
宮崎銀行	40,000	362.00	14,480,000		
佐賀銀行	36,000	277.00	9,972,000		
十八銀行	37,000	341.00	12,617,000		
沖縄銀行	5,600	4,275.00	23,940,000		
琉球銀行	12,400	1,476.00	18,302,400		
セブン銀行	214,700	326.00	69,992,200	貸付株式数	60,300株
みずほフィナンシャルG	7,801,500	202.60	1,580,583,900		
高知銀行	68,000	125.00	8,500,000		
山口フィナンシャルG	52,000	1,190.00	61,880,000		
芙蓉総合リース	6,500	5,400.00	35,100,000		
興銀リース	10,600	2,413.00	25,577,800		
東京センチュリー	11,500	3,695.00	42,492,500		
ＳＢＩホールディングス	64,800	1,432.00	92,793,600		
日本証券金融	25,900	545.00	14,115,500		
アイフル	97,400	353.00	34,382,200	貸付株式数	27,400株 (300株)
長野銀行	3,200	2,009.00	6,428,800		
名古屋銀行	4,700	3,835.00	18,024,500	貸付株式数	1,300株 (100株)
北洋銀行	90,000	448.00	40,320,000		
愛知銀行	2,000	6,450.00	12,900,000		
第三銀行	4,400	1,825.00	8,030,000		
中京銀行	2,800	2,357.00	6,599,600		
大光銀行	31,000	262.00	8,122,000		
愛媛銀行	5,200	1,365.00	7,098,000	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
トマト銀行	5,000	1,622.00	8,110,000		
みなと銀行	5,200	1,948.00	10,129,600		
京葉銀行	43,000	488.00	20,984,000		
関西アーバン銀行	7,500	1,292.00	9,690,000		
栃木銀行	32,300	497.00	16,053,100		
北日本銀行	2,500	3,075.00	7,687,500		
東和銀行	118,000	108.00	12,744,000		
福島銀行	91,000	93.00	8,463,000		
大東銀行	43,000	169.00	7,267,000	貸付株式数	14,000株 (14,000株)
リコーリース	4,500	3,500.00	15,750,000	貸付株式数	1,300株

イオンフィナンシャルサービス	36,700	1,904.00	69,876,800	
ア　コ　ム	118,200	547.00	64,655,400	
ジャックス	33,000	531.00	17,523,000	
オ　リ　コ	127,500	202.00	25,755,000	
日立キャピタル	13,700	2,802.00	38,387,400	
オリックス	407,900	1,781.50	726,673,850	
三菱ＵＦＪリース	145,600	527.00	76,731,200	
ジャフコ	9,600	3,950.00	37,920,000	
トモニホールディングス	47,000	590.00	27,730,000	
大和証券Ｇ本社	535,000	687.40	367,759,000	
野村ホールディングス	1,176,000	614.00	722,064,000	
岡三証券グループ	46,000	657.00	30,222,000	
丸三証券	18,300	930.00	17,019,000	
東洋証券	36,000	236.00	8,496,000	
東海東京ＨＤ	63,300	591.00	37,410,300	
光世証券	52,000	161.00	8,372,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
水戸証券	31,900	293.00	9,346,700	
いちよし証券	13,600	820.00	11,152,000	
松井証券	29,900	880.00	26,312,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	119,800	3,728.00	446,614,400	
日本取引所グループ	179,300	1,694.00	303,734,200	
マネックスＧ	60,900	270.00	16,443,000	貸付株式数 19,000株 (19,000株)
カブドットコム証券	39,800	366.00	14,566,800	
極東証券	7,600	1,662.00	12,631,200	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
岩井コスモホールディング	8,000	972.00	7,776,000	
藍澤證券	12,900	630.00	8,127,000	
フィデアホール	58,800	192.00	11,289,600	
池田泉州ＨＤ	57,200	494.00	28,256,800	
アニコム　ホールディングス	4,100	2,700.00	11,070,000	貸付株式数 1,300株 (600株)
ＭＳ＆ＡＤ	171,500	3,549.00	608,653,500	
ＳＯＮＹ　ＦＨ	54,700	1,650.00	90,255,000	
マネーパートナーズＧＰ	8,600	480.00	4,128,000	
第一生命ＨＬＤＧＳ	346,900	1,833.50	636,041,150	
東京海上ＨＤ	232,800	4,899.00	1,140,487,200	

イー・ギャランティ	2,400	2,495.00	5,988,000	貸付株式数 700株 (700株)
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,900	1,710.00	4,959,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	209,100	1,429.00	298,803,900	
アドバンスクリエイト	3,000	1,787.00	5,361,000	
三井不動産	305,000	2,690.50	820,602,500	
三菱地所	428,000	2,305.50	986,754,000	
平和不動産	11,000	1,634.00	17,974,000	
東京建物	66,100	1,476.00	97,563,600	
ダイビル	14,900	1,019.00	15,183,100	
京阪神ビルディング	11,500	585.00	6,727,500	
住友不動産	138,000	3,159.00	435,942,000	
大京	104,000	242.00	25,168,000	
テーオーシー	22,700	989.00	22,450,300	
東京楽天地	13,000	506.00	6,578,000	
レオパレス２１	71,600	621.00	44,463,600	
スターツコーポレーション	6,100	2,086.00	12,724,600	
フジ住宅	9,200	724.00	6,660,800	
空港施設	9,800	576.00	5,644,800	
住友不動産販売	4,900	2,788.00	13,661,200	
ゴールドクレスト	5,400	2,169.00	11,712,600	
リログループ	2,300	15,700.00	36,110,000	
日神不動産	12,600	518.00	6,526,800	
タカラレーベン	25,500	675.00	17,212,500	貸付株式数 7,100株
サンヨーハウジ　名古屋	6,600	991.00	6,540,600	
イオンモール	36,600	1,650.00	60,390,000	
ファースト住建	3,500	1,511.00	5,288,500	
東祥	1,500	5,030.00	7,545,000	貸付株式数 600株 (600株)
トーセイ	9,300	831.00	7,728,300	
エヌ・ティ・ティ都市開発	34,800	986.00	34,312,800	
サンフロンティア不動産	6,900	983.00	6,782,700	
エフ・ジェー・ネクスト	8,200	708.00	5,805,600	
グランディハウス	13,200	380.00	5,016,000	
東武鉄道	308,000	548.00	168,784,000	
相鉄ホールディングス	93,000	561.00	52,173,000	
東京急行	316,000	854.00	269,864,000	
京浜急行	159,000	1,229.00	195,411,000	
小田急電鉄	93,400	2,237.00	208,935,800	

京王電鉄	162,000	912.00	147,744,000	
京成電鉄	43,500	2,714.00	118,059,000	
富士急行	17,000	1,062.00	18,054,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
新京成電鉄	13,000	409.00	5,317,000	
東日本旅客鉄道	112,800	9,766.00	1,101,604,800	
西日本旅客鉄道	56,000	6,957.00	389,592,000	
東海旅客鉄道	48,500	18,680.00	905,980,000	
西武ホールディングス	80,400	2,051.00	164,900,400	
鴻池運輸	8,400	1,553.00	13,045,200	
西日本鉄道	69,000	508.00	35,052,000	
ハマキョウレックス	4,300	2,052.00	8,823,600	
サカイ引越センター	2,400	2,407.00	5,776,800	貸付株式数 700株 (100株)
近鉄グループＨＬＤＧＳ	585,000	442.00	258,570,000	
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	73,300	3,615.00	264,979,500	
南海電鉄	122,000	523.00	63,806,000	
京阪ホールディングス	130,000	728.00	94,640,000	
神戸電鉄	18,000	368.00	6,624,000	
名古屋鉄道	212,000	561.00	118,932,000	貸付株式数 57,000株 (57,000株)
山陽電鉄	23,000	588.00	13,524,000	
トランコム	1,800	5,570.00	10,026,000	
日本通運	225,000	591.00	132,975,000	貸付株式数 61,000株 (61,000株)
ヤマトホールディングス	104,400	2,291.50	239,232,600	
山　九	76,000	665.00	50,540,000	
日　新	26,000	339.00	8,814,000	
丸全昭和運輸	22,000	442.00	9,724,000	
センコー	26,100	808.00	21,088,800	
トナミホールディングス	16,000	346.00	5,536,000	
ニッコンホールディングス	19,400	2,392.00	46,404,800	
福山通運	34,000	625.00	21,250,000	貸付株式数 9,000株 (5,000株)
セイノーホールディングス	40,700	1,271.00	51,729,700	
神奈川中央交通	8,000	730.00	5,840,000	
日立物流	12,100	2,339.00	28,301,900	
丸和運輸機関	1,800	2,960.00	5,328,000	
日本郵船	487,000	212.00	103,244,000	

商船三井	303,000	294.00	89,082,000	貸付株式数	84,000株 (79,000株)
川崎汽船	218,000	251.00	54,718,000	貸付株式数	71,000株 (71,000株)
ＮＳユナイテッド海運	32,000	207.00	6,624,000		
飯野海運	30,900	420.00	12,978,000		
九州旅客鉄道	43,100	2,962.00	127,662,200		
日本航空	104,600	3,385.00	354,071,000		
ＡＮＡホールディングス	1,077,000	317.30	341,732,100		
三菱倉庫	38,000	1,547.00	58,786,000		
三井倉庫ＨＯＬＤ	36,000	334.00	12,024,000		
住友倉庫	41,000	587.00	24,067,000		
渋沢倉庫	28,000	338.00	9,464,000		
ヤマタネ	6,100	1,485.00	9,058,500		
東陽倉庫	28,100	283.00	7,952,300		
日本トランスシティ	19,000	399.00	7,581,000		
東洋埠頭	43,000	188.00	8,084,000		
上　組	68,000	1,050.00	71,400,000		
キユーソー流通システム	2,300	2,312.00	5,317,600	貸付株式数	500株 (500株)
郵船ロジスティクス	6,000	1,114.00	6,684,000		
近鉄エクスプレス	10,600	1,623.00	17,203,800		
東海運	8,700	478.00	4,158,600	貸付株式数	3,600株
内外トランスライン	4,900	1,131.00	5,541,900		
東京放送ＨＤ	38,100	1,789.00	68,160,900		
日本テレビＨＬＤＳ	52,600	1,946.00	102,359,600		
テレビ朝日ＨＤ	15,900	2,148.00	34,153,200		
スカパーＪＳＡＴＨＤ	37,700	546.00	20,584,200		
テレビ東京ＨＤ	5,000	2,225.00	11,125,000	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
ワイヤレスゲート	2,700	1,690.00	4,563,000		
コネクシオ	5,300	1,400.00	7,420,000		
日本通信	52,400	155.00	8,122,000	貸付株式数	12,800株 (12,800株)
日本電信電話	461,500	4,625.00	2,134,437,500		
ＫＤＤＩ	569,200	2,999.00	1,707,030,800		
光通信	6,900	10,200.00	70,380,000		
ＮＴＴドコモ	429,800	2,624.00	1,127,795,200		
エムティーアイ	10,000	749.00	7,490,000		
ＧＭＯインターネット	21,600	1,569.00	33,890,400		

カドカワ	16,900	1,559.00	26,347,100		
学研ホールディングス	24,000	330.00	7,920,000		
ゼンリン	8,000	1,703.00	13,624,000		
東京電力ＨＤ	494,400	425.00	210,120,000		
中部電力	191,900	1,605.50	308,095,450		
関西電力	238,100	1,128.00	268,576,800		
中国電力	79,600	1,302.00	103,639,200		
北陸電力	56,000	1,238.00	69,328,000		
東北電力	145,100	1,333.00	193,418,300		
四国電力	52,400	1,091.00	57,168,400	貸付株式数	14,700株 (13,800株)
九州電力	129,100	1,125.00	145,237,500		
北海道電力	54,800	830.00	45,484,000		
沖縄電力	8,500	2,324.00	19,754,000		
電源開発	46,200	2,509.00	115,915,800		
イーレックス	2,500	2,932.00	7,330,000	貸付株式数	700株
東京瓦斯	625,000	498.70	311,687,500		
大阪瓦斯	564,000	432.60	243,986,400		
東邦瓦斯	147,000	906.00	133,182,000		
北海道瓦斯	21,000	271.00	5,691,000	貸付株式数	5,000株
広島ガス	15,500	344.00	5,332,000		
西部瓦斯	67,000	246.00	16,482,000		
静岡ガス	18,200	788.00	14,341,600		
メタウォーター	3,400	2,864.00	9,737,600	貸付株式数	1,000株 (600株)
松　竹	37,000	1,236.00	45,732,000		
東　宝	37,500	3,285.00	123,187,500		
エイチ・アイ・エス	10,000	3,150.00	31,500,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
東　映	22,000	921.00	20,262,000		
ＮＴＴデータ	35,600	5,690.00	202,564,000		
共立メンテナンス	5,000	6,930.00	34,650,000	貸付株式数	1,300株
イチネンホールディングス	8,700	1,087.00	9,456,900		
建設技術研究所	6,200	1,015.00	6,293,000		
アインホールディングス	7,000	7,990.00	55,930,000		
東京テアトル	84,000	184.00	15,456,000	貸付株式数	23,000株
タナベ経営	3,700	1,298.00	4,802,600		
ナ　ガ　ワ	1,200	4,290.00	5,148,000		
よみうりランド	15,000	469.00	7,035,000	貸付株式数	4,000株 (4,000株)

東京都競馬	43,000	279.00	11,997,000	
常磐興産	5,200	1,536.00	7,987,200	
カナモト	8,500	2,610.00	22,185,000	
東京ドーム	24,400	1,177.00	28,718,800	
ＤＴＳ	6,300	2,532.00	15,951,600	貸付株式数 2,000株
スクウェア・エニックス・ＨＤ	22,200	2,883.00	64,002,600	
シーイーシー	3,900	1,894.00	7,386,600	
カプコン	13,600	2,498.00	33,972,800	
西尾レントオール	5,000	3,060.00	15,300,000	
日本空港ビルデング	18,400	4,255.00	78,292,000	貸付株式数 5,100株 (5,100株)
トランス・コスモス	7,300	2,781.00	20,301,300	
乃村工藝社	13,200	1,674.00	22,096,800	
ジャステック	5,900	1,028.00	6,065,200	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ＳＣＳＫ	15,800	3,975.00	62,805,000	
藤田観光	22,000	329.00	7,238,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	42,000	147.00	6,174,000	
日本管財	5,500	1,631.00	8,970,500	
トーカイ	2,900	3,650.00	10,585,000	
セコム	63,100	8,319.00	524,928,900	
セントラル警備保障	3,300	2,184.00	7,207,200	
アイネス	8,600	1,184.00	10,182,400	
丹青社	11,600	754.00	8,746,400	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
メイテツク	7,300	4,295.00	31,353,500	
ＴＫＣ	5,600	3,090.00	17,304,000	
アサツー　ディ・ケイ	9,800	3,025.00	29,645,000	
富士ソフト	8,700	2,653.00	23,081,100	
応用地質	6,300	1,340.00	8,442,000	
船井総研ホールディン	8,300	1,778.00	14,757,400	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
ＮＳＤ	12,700	1,755.00	22,288,500	
丸紅建材リース	28,000	204.00	5,712,000	
コナミホールディングス	26,000	3,870.00	100,620,000	
学　究　社	4,700	1,362.00	6,401,400	
ベネッセホールディングス	20,400	3,035.00	61,914,000	貸付株式数 5,600株

イオンディライト	6,700	3,140.00	21,038,000	
福井コンピュータＨＬＤＳ	2,000	2,569.00	5,138,000	
ニチイ学館	11,200	876.00	9,811,200	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
ダイセキ	10,600	2,181.00	23,118,600	
日鉄住金物産	4,700	4,420.00	20,774,000	
元気寿司	2,600	2,067.00	5,374,200	
トラスコ中山	6,700	5,180.00	34,706,000	
ヤマダ電機	191,300	611.00	116,884,300	
オートバックスセブン	20,600	1,660.00	34,196,000	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	10,100	1,328.00	13,412,800	
ニトリホールディングス	25,000	11,940.00	298,500,000	
吉野家ホールディングス	19,300	1,557.00	30,050,100	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
加藤産業	8,800	2,521.00	22,184,800	
イノテック	10,700	526.00	5,628,200	
イエローハット	5,600	2,337.00	13,087,200	
松屋フーズ	2,800	3,480.00	9,744,000	
ＪＢＣＣホールディングス	15,000	689.00	10,335,000	
サガミチェーン	8,500	1,268.00	10,778,000	
日　伝	2,500	3,140.00	7,850,000	
関西スーパーマーケット	5,700	1,490.00	8,493,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ミロク情報サービス	4,700	1,901.00	8,934,700	
因幡電機産業	7,500	3,875.00	29,062,500	
王将フードサービス	4,200	4,150.00	17,430,000	
プレナス	6,300	2,232.00	14,061,600	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,100	1,906.00	7,814,600	
アークス	10,800	2,592.00	27,993,600	
バローホールディングス	12,400	2,732.00	33,876,800	
ミスミグループ本社	64,700	2,046.00	132,376,200	貸付株式数 17,900株
ベ　ル　ク	2,700	4,115.00	11,110,500	
大　庄	4,400	1,544.00	6,793,600	
ファーストリテイリング	9,600	39,570.00	379,872,000	
ソフトバンクグループ	258,500	6,712.00	1,735,052,000	
スズケン	25,900	3,420.00	88,578,000	
サンドラッグ	11,000	7,960.00	87,560,000	

サックスバーホールディング	6,300	1,214.00	7,648,200	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
ジェコス	5,000	994.00	4,970,000	
ベルーナ	15,500	640.00	9,920,000	
合計			124,953,943,460	

（注） 1．※先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

トヨタ自動車　100,000株

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「日本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27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	773,613,981	281,934,187
国債証券	39,271,633,420	40,657,453,270
地方債証券	4,537,340,242	3,811,406,400
特殊債券	4,618,196,029	3,372,562,661
社債券	4,544,659,368	3,308,223,600
未収入金	―	411,031,640
未収利息	177,835,149	157,572,707
前払費用	2,983,028	3,873,580
流動資産合計	53,926,261,217	52,004,058,045

資産合計	53,926,261,217	52,004,058,045
負債の部		
流動負債		
未払金	40,390,200	91,609,550
未払解約金	20,952,802	6,752,875
流動負債合計	61,343,002	98,362,425
負債合計	61,343,002	98,362,425
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	40,077,387,149	37,053,043,176
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,787,531,066	14,852,652,444
元本等合計	53,864,918,215	51,905,695,620
純資産合計	53,864,918,215	51,905,695,620
負債純資産合計	53,926,261,217	52,004,058,045

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27年12月1日 至　平成28年11月30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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	平成27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
1.　※1　期首	平成26年12月2日	平成27年12月1日
期首元本額	42,232,877,887円	40,077,387,149円
期中追加設定元本額	2,256,319,749円	4,724,277,547円

期中一部解約元本額	4,411,810,487円	7,748,621,520円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	346,538,523円	216,435,072円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	2,113,073,470円	1,435,119,843円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	202,491,555円	154,601,241円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	2,951,519,418円	2,029,554,751円
Ｄ－Ｉ's 日本債券インデックス	769,428円	765,717円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	3,986,330,780円	4,520,031,855円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	19,222,294,155円	15,037,977,112円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,878,951,953円	2,380,007,134円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	416,763,462円	316,684,776円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	500,900,872円	432,222,563円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	－円	31,913,378円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	－円	2,148,394,984円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	531,534,291円	881,186,341円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	5,982,286,143円	6,545,146,286円
ダイワライフスタイル２５	419,178,583円	420,509,022円
ダイワライフスタイル５０	415,206,042円	398,353,270円
ダイワライフスタイル７５	109,548,474円	104,139,831円

計	40,077,387,149円	37,053,043,176円
2.　期末日における受益権の総数	40,077,387,149口	37,053,043,176口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30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等であり、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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成28年11月30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等 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27年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成28年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	236,670,000	1,434,218,480
地方債証券	△25,121,526	△6,403,150
特殊債券	△20,104,744	875,996
社債券	△27,103,152	△17,015,300
合計	164,340,578	1,411,676,026

（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26年12月2日から平成27年11月30日まで、及び平成27年12月1日から平成28年11月30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27年11月30日現在	平成28年11月30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27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3440円 (13,440円)	1.4008円 (14,008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	３６０　２年国債	130,000,000	130,503,100	
	３６２　２年国債	40,000,000	40,162,000	
	３６３　２年国債	70,000,000	70,297,500	
	３６４　２年国債	85,000,000	85,370,600	
	３６５　２年国債	95,000,000	95,416,100	
	３６６　２年国債	440,000,000	441,993,200	
	３６７　２年国債	60,000,000	60,286,200	
	３６８　２年国債	510,000,000	512,555,100	
	１０７　５年国債	190,000,000	190,908,200	

１０８　５年国債	115,000,000	115,423,200	
１０９　５年国債	50,000,000	50,211,000	
１１０　５年国債	80,000,000	80,545,600	
１１１　５年国債	120,000,000	120,974,400	
１１２　５年国債	150,000,000	151,384,500	
１１３　５年国債	130,000,000	130,998,400	
１１４　５年国債	140,000,000	141,239,000	
１１５　５年国債	145,000,000	146,007,750	
１１６　５年国債	498,000,000	501,839,580	
１１７　５年国債	400,000,000	403,408,000	
１１８　５年国債	140,000,000	141,306,200	
１１９　５年国債	330,000,000	332,237,400	
１２０　５年国債	180,000,000	181,796,400	
１２１　５年国債	50,000,000	50,358,500	
１２２　５年国債	340,000,000	342,550,000	
１２３　５年国債	300,000,000	302,331,000	
１２４　５年国債	340,000,000	342,723,400	
１２５　５年国債	400,000,000	403,356,000	
１２６　５年国債	360,000,000	363,146,400	
１２７　５年国債	500,000,000	504,530,000	
１２８　５年国債	420,000,000	423,931,200	
１２９　５年国債	330,000,000	333,260,400	
１　４０年国債	85,000,000	129,228,050	
２　４０年国債	116,000,000	171,069,840	
３　４０年国債	74,000,000	110,064,640	
４　４０年国債	82,000,000	122,809,760	
５　４０年国債	125,000,000	180,440,000	
６　４０年国債	105,000,000	149,014,950	
７　４０年国債	121,000,000	164,316,790	
８　４０年国債	21,000,000	26,478,900	
９　４０年国債	102,000,000	93,578,880	
２８９　１０年国債	48,000,000	48,880,800	
２９０　１０年国債	132,000,000	134,769,360	
２９１　１０年国債	109,000,000	111,145,120	
２９２　１０年国債	155,000,000	158,856,400	
２９３　１０年国債	238,000,000	245,351,820	
２９４　１０年国債	147,000,000	151,312,980	
２９５　１０年国債	175,000,000	179,576,250	
２９６　１０年国債	25,000,000	25,758,250	

２９７　１０年国債	70,000,000	72,259,600	
２９８　１０年国債	125,000,000	128,778,750	
２９９　１０年国債	250,000,000	258,410,000	
３００　１０年国債	286,000,000	296,939,500	
３０１　１０年国債	120,000,000	125,095,200	
３０３　１０年国債	10,000,000	10,435,800	
３０４　１０年国債	60,000,000	62,446,200	
３０５　１０年国債	470,000,000	490,722,300	
３０６　１０年国債	255,000,000	267,956,550	
３０７　１０年国債	240,000,000	251,400,000	
３０８　１０年国債	150,000,000	157,617,000	
３０９　１０年国債	90,000,000	93,928,500	
３１０　１０年国債	30,000,000	31,276,500	
３１１　１０年国債	30,000,000	31,047,600	
３１２　１０年国債	395,000,000	416,045,600	
３１３　１０年国債	180,000,000	190,953,000	
３１４　１０年国債	260,000,000	273,577,200	
３１５　１０年国債	221,000,000	234,125,190	
３１６　１０年国債	55,000,000	58,015,100	
３１７　１０年国債	214,000,000	226,330,680	
３１８　１０年国債	200,000,000	210,560,000	
３１９　１０年国債	100,000,000	106,063,000	
３２０　１０年国債	120,000,000	126,666,000	
３２１　１０年国債	175,000,000	185,150,000	
３２２　１０年国債	50,000,000	52,634,000	
３２５　１０年国債	170,000,000	178,768,600	
３２８　１０年国債	100,000,000	104,302,000	
３２９　１０年国債	160,000,000	169,211,200	
３３０　１０年国債	262,000,000	277,573,280	
３３１　１０年国債	100,000,000	104,577,000	
３３２　１０年国債	220,000,000	230,278,400	
３３３　１０年国債	265,000,000	277,611,350	
３３４　１０年国債	320,000,000	335,504,000	
３３５　１０年国債	470,000,000	489,664,800	
３３６　１０年国債	175,000,000	182,483,000	
３３７　１０年国債	145,000,000	148,859,900	
３３８　１０年国債	200,000,000	207,066,000	
３３９　１０年国債	390,000,000	403,848,900	
３４０　１０年国債	510,000,000	528,416,100	

３４１　１０年国債	460,000,000	472,700,600	
３４２　１０年国債	503,000,000	507,672,870	
３４３　１０年国債	500,000,000	504,530,000	
３４４　１０年国債	360,000,000	362,991,600	
１　３０年国債	16,000,000	21,432,480	
２　３０年国債	24,000,000	31,120,560	
３　３０年国債	30,000,000	38,639,100	
４　３０年国債	36,000,000	49,611,240	
５　３０年国債	28,000,000	36,048,880	
６　３０年国債	24,000,000	31,765,200	
７　３０年国債	55,000,000	72,323,900	
８　３０年国債	27,000,000	33,556,680	
９　３０年国債	43,000,000	50,786,870	
１０　３０年国債	45,000,000	50,989,050	
１１　３０年国債	40,000,000	49,216,400	
１２　３０年国債	60,000,000	77,770,800	
１３　３０年国債	75,000,000	96,147,750	
１４　３０年国債	82,000,000	110,677,860	
１５　３０年国債	100,000,000	136,903,000	
１６　３０年国債	60,000,000	82,235,400	
１７　３０年国債	80,000,000	108,486,400	
１８　３０年国債	80,000,000	107,284,800	
１９　３０年国債	57,000,000	76,492,290	
２０　３０年国債	60,000,000	82,827,600	
２１　３０年国債	60,000,000	80,749,800	
２２　３０年国債	70,000,000	96,940,200	
２３　３０年国債	60,000,000	83,145,600	
２４　３０年国債	92,000,000	127,797,200	
２５　３０年国債	60,000,000	81,159,000	
２６　３０年国債	110,000,000	151,155,400	
２７　３０年国債	100,000,000	140,056,000	
２８　３０年国債	117,000,000	164,569,860	
２９　３０年国債	135,000,000	188,007,750	
３０　３０年国債	137,000,000	188,929,850	
３１　３０年国債	130,000,000	177,409,700	
３２　３０年国債	155,000,000	215,916,550	
３３　３０年国債	185,000,000	246,379,300	
３４　３０年国債	158,000,000	218,556,660	
３５　３０年国債	195,000,000	261,847,950	

３６　３０年国債	181,000,000	244,159,950	
３７　３０年国債	201,000,000	267,137,040	
３８　３０年国債	119,000,000	155,857,870	
３９　３０年国債	116,000,000	154,969,040	
４０　３０年国債	103,000,000	135,283,290	
４１　３０年国債	113,000,000	145,829,890	
４２　３０年国債	111,000,000	143,508,570	
４３　３０年国債	124,000,000	160,611,000	
４４　３０年国債	120,000,000	155,715,600	
４５　３０年国債	125,000,000	155,940,000	
４６　３０年国債	152,000,000	189,677,760	
４７　３０年国債	147,000,000	187,629,330	
４８　３０年国債	162,000,000	198,454,860	
４９　３０年国債	139,000,000	170,515,470	
５０　３０年国債	150,000,000	159,864,000	
５１　３０年国債	145,000,000	134,758,650	
５２　３０年国債	111,000,000	109,019,760	
３８利付国債２０年	60,000,000	62,276,400	
３９　２０年国債	90,000,000	93,297,600	
４０　２０年国債	57,000,000	59,557,590	
４１　２０年国債	136,000,000	141,234,640	
４２　２０年国債	87,000,000	92,554,080	
４３　２０年国債	100,000,000	108,591,000	
４４　２０年国債	85,000,000	92,399,250	
４５　２０年国債	78,000,000	84,531,720	
４６　２０年国債	73,000,000	79,043,670	
４７　２０年国債	89,000,000	96,869,380	
４８　２０年国債	54,000,000	59,736,420	
４９　２０年国債	64,000,000	70,097,280	
５０　２０年国債	107,000,000	116,269,410	
５１　２０年国債	82,000,000	89,831,000	
５２　２０年国債	52,000,000	57,506,800	
５３　２０年国債	66,000,000	73,368,240	
５４　２０年国債	65,000,000	72,586,800	
５５　２０年国債	140,000,000	155,535,800	
５９　２０年国債	45,000,000	49,899,150	
６０　２０年国債	10,000,000	10,906,200	
６１　２０年国債	100,000,000	106,901,000	
６２　２０年国債	95,000,000	100,469,150	

６３　２０年国債	130,000,000	145,991,300	
６４　２０年国債	90,000,000	102,078,900	
６５　２０年国債	85,000,000	96,793,750	
６６　２０年国債	135,000,000	152,775,450	
６７　２０年国債	55,000,000	62,830,350	
６８　２０年国債	120,000,000	139,719,600	
６９　２０年国債	110,000,000	127,271,100	
７０　２０年国債	83,000,000	98,331,760	
７１　２０年国債	125,000,000	146,197,500	
７２　２０年国債	175,000,000	204,221,500	
７３　２０年国債	120,000,000	139,654,800	
７４　２０年国債	73,000,000	85,545,780	
７５　２０年国債	80,000,000	94,092,800	
７６　２０年国債	51,000,000	59,136,540	
７７　２０年国債	130,000,000	151,884,200	
７８　２０年国債	61,000,000	71,028,400	
７９　２０年国債	50,000,000	58,648,000	
８０　２０年国債	53,000,000	62,620,560	
８１　２０年国債	76,000,000	89,493,800	
８２　２０年国債	87,000,000	103,213,320	
８３　２０年国債	93,000,000	110,773,230	
８４　２０年国債	100,000,000	118,205,000	
８５　２０年国債	58,000,000	69,354,080	
８６　２０年国債	80,000,000	97,148,800	
８７　２０年国債	55,000,000	66,278,300	
８８　２０年国債	100,000,000	121,902,000	
８９　２０年国債	78,000,000	94,338,660	
９０　２０年国債	120,000,000	145,657,200	
９１　２０年国債	60,000,000	73,416,000	
９２　２０年国債	180,000,000	217,440,000	
９３　２０年国債	100,000,000	120,220,000	
９４　２０年国債	65,000,000	78,809,900	
９５　２０年国債	3,000,000	3,712,140	
９６　２０年国債	100,000,000	121,637,000	
９７　２０年国債	81,000,000	99,760,410	
９８　２０年国債	90,000,000	109,877,400	
９９　２０年国債	170,000,000	208,180,300	
１００　２０年国債	142,000,000	176,094,200	
１０１　２０年国債	35,000,000	44,188,900	

１０２　２０年国債	80,000,000	101,352,000	
１０３　２０年国債	70,000,000	87,881,500	
１０４　２０年国債	40,000,000	49,301,600	
１０５　２０年国債	126,000,000	155,843,100	
１０６　２０年国債	67,000,000	83,652,850	
１０７　２０年国債	107,000,000	132,794,490	
１０８　２０年国債	127,000,000	154,584,400	
１０９　２０年国債	90,000,000	109,809,900	
１１０　２０年国債	90,000,000	111,999,600	
１１１　２０年国債	100,000,000	126,102,000	
１１２　２０年国債	125,000,000	156,077,500	
１１３　２０年国債	125,000,000	156,496,250	
１１４　２０年国債	130,000,000	163,174,700	
１１５　２０年国債	110,000,000	139,485,500	
１１６　２０年国債	89,000,000	113,151,930	
１１７　２０年国債	140,000,000	176,162,000	
１１８　２０年国債	15,000,000	18,721,950	
１１９　２０年国債	93,000,000	113,601,360	
１２０　２０年国債	146,000,000	174,456,860	
１２１　２０年国債	135,000,000	167,053,050	
１２２　２０年国債	110,000,000	134,629,000	
１２３　２０年国債	140,000,000	177,562,000	
１２４　２０年国債	93,000,000	116,672,220	
１２５　２０年国債	85,000,000	109,234,350	
１２６　２０年国債	70,000,000	88,001,200	
１２７　２０年国債	90,000,000	111,886,200	
１２８　２０年国債	119,000,000	148,226,400	
１２９　２０年国債	95,000,000	116,983,000	
１３０　２０年国債	110,000,000	135,688,300	
１３１　２０年国債	100,000,000	121,912,000	
１３２　２０年国債	72,000,000	87,906,240	
１３３　２０年国債	175,000,000	216,221,250	
１３４　２０年国債	50,000,000	61,873,000	
１３５　２０年国債	92,000,000	112,481,040	
１３６　２０年国債	80,000,000	96,622,400	
１３７　２０年国債	85,000,000	104,068,050	
１３８　２０年国債	87,000,000	103,897,140	
１３９　２０年国債	55,000,000	66,510,400	
１４０　２０年国債	230,000,000	281,975,400	

	１４１　２０年国債	140,000,000	171,719,800	
	１４２　２０年国債	90,000,000	111,783,600	
	１４３　２０年国債	180,000,000	218,219,400	
	１４４　２０年国債	55,000,000	65,816,300	
	１４５　２０年国債	215,000,000	264,327,450	
	１４６　２０年国債	204,000,000	250,881,240	
	１４７　２０年国債	95,000,000	115,311,000	
	１４８　２０年国債	207,000,000	247,843,170	
	１４９　２０年国債	208,000,000	248,986,400	
	１５０　２０年国債	225,000,000	265,698,000	
	１５１　２０年国債	190,000,000	217,785,600	
	１５２　２０年国債	215,000,000	246,211,550	
	１５３　２０年国債	225,000,000	261,771,750	
	１５４　２０年国債	220,000,000	251,873,600	
	１５５　２０年国債	228,000,000	252,660,480	
	１５６　２０年国債	243,000,000	241,916,220	
	１５７　２０年国債	218,000,000	208,394,920	
	１５８　２０年国債	115,000,000	116,150,000	
国債証券　合計			40,657,453,270	
地方債証券	６６０　東京都公債	100,000,000	102,499,300	
	６６５　東京都公債	100,000,000	103,046,300	
	６８８　東京都公債	100,000,000	103,614,500	
	６９９　東京都公債	100,000,000	104,851,900	
	７１３　東京都公債	100,000,000	104,312,700	
	２４－１　北海道公債	100,000,000	105,118,400	
	２４－６　北海道公債	100,000,000	104,559,900	
	１６３　神奈川県公債	100,000,000	103,678,000	
	３６１　大阪府公債	100,000,000	104,877,800	
	２２－５　京都府公債	100,000,000	105,099,600	
	２４－５　京都府公債	100,000,000	104,572,200	
	２６－１７　兵庫県公債	100,000,000	102,856,700	
	１９兵庫県公債２０年	100,000,000	118,209,800	
	２６－１０　静岡県公債	100,000,000	103,324,000	
	２０－６　愛知県公債	100,000,000	103,503,500	
	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	104,453,400	
	２１－３　埼玉県公債	100,000,000	104,317,200	
	２１－２　千葉県公債	100,000,000	103,996,600	
	２１－６　千葉県公債	100,000,000	104,068,900	
	６１　共同発行地方	100,000,000	102,206,000	

	７６　共同発行地方	50,000,000	51,904,000	
	８１　共同発行地方	100,000,000	104,129,300	
	９０　共同発行地方	100,000,000	104,296,200	
	１０８　共同発行地方	100,000,000	105,222,800	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	104,149,400	
	１２６　共同発行地方	100,000,000	105,182,100	
	１３１　共同発行地方	100,000,000	104,208,400	
	２３－２　島根県公債	100,000,000	105,015,400	
	４７１　名古屋市債	100,000,000	104,524,200	
	２１－５　京都市公債	100,000,000	104,757,300	
	２５－３　京都市５年	100,000,000	100,637,200	
	２４－１０　神戸市公債	100,000,000	104,491,800	
	２４－３　横浜市公債	100,000,000	104,210,100	
	２４－５　札幌市公債	100,000,000	104,441,100	
	２１－３　広島市公債	100,000,000	104,190,700	
	２４－４　福井県公債	100,000,000	102,688,100	
	２２－１　岡山県公債	100,000,000	104,191,600	
地方債証券　合計			3,811,406,400	
特殊債券	１９　政保政策投資Ｃ	100,000,000	104,165,400	
	３２　道路機構	100,000,000	102,046,000	
	６１　道路機構	100,000,000	104,258,400	
	８１　道路機構	100,000,000	105,004,700	
	６４　政保道路機構	219,000,000	225,179,961	
	６６　政保道路機構	100,000,000	102,784,200	
	８６　政保道路機構	100,000,000	122,416,500	
	１１０　政保道路機構	100,000,000	104,716,900	
	１６８　政保道路機構	100,000,000	104,701,500	
	１７３　政保道路機構	100,000,000	104,728,200	
	１７５　政保道路機構	100,000,000	104,631,400	
	１８６　政保道路機構	100,000,000	104,163,100	
	１９０　政保道路機構	100,000,000	103,857,400	
	２３６　政保道路機構	100,000,000	102,183,500	
	３　公営企業１５年	100,000,000	109,851,400	
	２　政保地方公営機	100,000,000	103,195,300	
	１３　地方公共団体	100,000,000	104,458,900	
	２９　地方公共団体	100,000,000	104,934,400	
	３３　地方公共団体	100,000,000	105,265,000	
	３９政保地方公共団	100,000,000	104,523,400	
	Ｆ１４３地方公共団体	100,000,000	112,183,800	

	４８　地方公共団体	100,000,000	104,839,100	
	５１　地方公共団体	100,000,000	105,164,800	
	６５　地方公共団体	100,000,000	103,259,700	
	７１　地方公共団体	100,000,000	102,803,300	
	２５　日本政策金融	100,000,000	105,172,900	
	２５　政保日本政策	100,000,000	105,046,600	
	い７５２　利付商工債	100,000,000	100,343,200	
	い７５７　利付農林債	100,000,000	100,573,000	
	２４　政保中日本道	100,000,000	102,855,100	
	５　中日本高速道路	100,000,000	103,255,600	
特殊債券　合計			3,372,562,661	
社債券	１７　シテイグループ・インク	100,000,000	105,966,300	
	８ドイツ銀行ＡＧロンドン	100,000,000	95,269,500	
	９　ＡＵＳＴ・ＮＺ銀行	100,000,000	100,259,200	
	２９　東日本高速道	100,000,000	100,451,200	
	２１　西日本高速道	100,000,000	104,457,100	
	１１　セブンアンドアイ	100,000,000	101,819,600	
	１４　武田薬品	100,000,000	101,152,700	
	４　ＪＸホールデイングス	100,000,000	105,418,000	
	２４　太平洋セメント	100,000,000	99,964,200	
	１　明治安田２０１３基	100,000,000	100,986,900	
	１　三菱ＵＦＪＦＧ　劣後	100,000,000	103,114,500	
	２０　東京三菱銀行	100,000,000	109,284,900	
	４　りそな銀行劣後	100,000,000	106,877,100	
	９三菱ＵＦＪ信託ＢＫ劣	100,000,000	106,667,500	
	１１三菱ＵＦＪ信託ＢＫ	100,000,000	106,322,600	
	２０　三井住友ＢＫ劣	100,000,000	105,728,600	
	４６　ＮＴＴフアイナンス	100,000,000	100,284,900	
	１５　トヨタフアイナンス	100,000,000	106,240,200	
	２　イオンＦＳ	100,000,000	100,743,400	
	１６４　オリックス	100,000,000	102,682,600	
	１７５　オリックス	100,000,000	104,624,000	
	９　ジヤパンリアルエステイト	100,000,000	100,488,400	
	６２東日本旅客鉄道	100,000,000	103,732,200	
	７２東日本旅客鉄道	100,000,000	104,577,200	
	１８　西日本旅客鉄	100,000,000	103,287,600	
	１５　ＮＴＴドコモ	100,000,000	102,920,300	
	４７２　関西電力	100,000,000	103,426,100	
	３７２　中国電力	100,000,000	105,980,300	

	２６０　北陸電力	100,000,000	107,805,600	
	４２３　九州電力	100,000,000	102,472,400	
	３０　大阪瓦斯	100,000,000	103,212,000	
	２１　ＮＴＴデータ	100,000,000	102,006,500	
社債券　合計			3,308,223,600	
合計			51,149,645,931	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国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27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	239,405,681	―
コール・ローン	177,053,513	834,273,175
株式	76,810,694,854	75,856,759,279
投資証券	1,931,978,847	1,984,502,691
派生商品評価勘定	65,920,564	17,422,289
未収入金	211,709,830	321,945,202
未収配当金	161,785,867	162,157,303
差入委託証拠金	421,379,331	513,155,030
流動資産合計	80,019,928,487	79,690,214,969
資産合計	80,019,928,487	79,690,214,969
負債の部		
流動負債		
前受金	―	59,223,699
未払解約金	142,019,000	624,937,800
流動負債合計	142,019,000	684,161,499
負債合計	142,019,000	684,161,499
純資産の部		

元本等		
元本 ※1	38,848,551,378	40,539,431,105
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	41,029,358,109	38,466,622,365
元本等合計	79,877,909,487	79,006,053,470
純資産合計	79,877,909,487	79,006,053,470
負債純資産合計	80,019,928,487	79,690,214,969

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27年12月1日 至　平成28年11月30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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額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	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として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、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	平成27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
1．※1　期首	平成26年12月2日	平成27年12月1日
期首元本額	41,132,911,173円	38,848,551,378円
期中追加設定元本額	4,000,470,289円	5,066,388,246円
期中一部解約元本額	6,284,830,084円	3,375,508,519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ＶＡ	873,124,109円	725,982,741円

ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	45,226,330円	32,240,774円	
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	595,884,678円	463,206,991円	
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	58,755,519円	50,975,833円	
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,929,753,813円	1,543,587,080円	
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	－円	88,958,951円	
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	－円	147,732,667円	
Ｄ－Ｉ'ｓ 外国株式インデックス	1,475,423円	1,957,148円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	－円	182,021円	
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス	－円	184,046,036円	
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	－円	31,235,406円	
ＤＣダイワ外国株式インデックス	20,429,635,387円	22,444,872,014円	
ダイワ・ライフ・バランス３０	425,329,034円	550,340,778円	
ダイワ・ライフ・バランス５０	623,913,204円	735,584,538円	
ダイワ・ライフ・バランス７０	492,714,343円	553,544,620円	
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,412,182,749円	1,470,526,931円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	7,435,419円	7,625,022円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	13,012,768円	15,729,186円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	2,933,748円	3,621,406円	

ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	333,864円	100,000円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	1,499,345円	197,107円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	19,846,533円	19,292,523円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	163,351,857円	163,931,206円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	2,172,615,062円	1,955,664,069円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	532,843,230円	519,301,921円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	5,407,208,212円	5,011,815,577円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	246,505,874円	231,056,464円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	258,796,304円	399,881,832円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	－円	17,952,452円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,989,938,104円	3,006,649,223円
ダイワライフスタイル２５	21,679,584円	23,902,625円
ダイワライフスタイル５０	68,533,539円	78,118,426円
ダイワライフスタイル７５	54,023,346円	59,617,537円
計	38,848,551,378円	40,539,431,105円
2. 期末日における受益権の総数	38,848,551,378口	40,539,431,105口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30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等であり、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わが国の金融商品取引所（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。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成28年11月30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等 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27年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成28年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	836,729,506	2,054,830,722
投資証券	45,078,520	△33,857,099
合計	881,808,026	2,020,973,623

（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26年12月2日から平成27年11月30日まで、及び平成27年12月1日から平成28年11月30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27年11月30日 現在				平成28年11月30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	960,805,507	－	1,026,726,071	65,920,564	1,097,458,092	－	1,114,880,381	17,422,289
合計	960,805,507	－	1,026,726,071	65,920,564	1,097,458,092	－	1,114,880,381	17,422,289

（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。

（1口当たり情報）

	平成27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0561円 (20,561円)	1.9489円 (19,489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	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,700	66.890	180,603.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,100	133.580	280,518.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,450	105.840	153,468.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	19,600	33.800	662,480.000	
	ABBOTT LABORATORIES	34,100	38.730	1,320,693.000	
	ARCONIC INC	10,333	19.670	203,250.110	
	VERISK ANALYTICS INC	3,750	83.880	314,550.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	10,100	62.150	627,715.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	7,200	68.430	492,696.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,179	78.900	566,423.100	
	QORVO INC	3,200	54.280	173,696.000	
	AFLAC INC	9,700	71.280	691,416.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	2,750	72.880	200,420.000	
	ADOBE SYSTEMS INC	11,450	104.950	1,201,677.500	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,000	27.430	137,150.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,500	58.320	145,800.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,800	18.490	125,732.000	
	GARMIN LTD	2,600	51.990	135,174.000	
	AETNA INC	8,079	132.030	1,066,670.370	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,750	143.470	681,482.500	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16,600	113.340	1,881,444.000	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,751	50.600	189,800.600	
	WR BERKLEY CORP	2,100	62.200	130,620.000	
	AUTOZONE INC	670	790.240	529,460.800	
	DOLLAR TREE INC	5,571	89.670	499,551.570	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,900	37.860	791,274.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL	2,650	76.680	203,202.000	
	CELANESE CORP-SERIES A	3,300	77.160	254,628.000	

DR HORTON INC	7,966	28.840	229,739.440	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,100	47.210	99,141.000	
DENTSPLY SIRONA INC	5,500	60.470	332,585.000	
AUTODESK INC	4,550	75.260	342,433.000	
MOODY'S CORP	4,050	101.090	409,414.500	
DEVON ENERGY CORP	10,900	42.160	459,544.000	
ALBEMARLE CORP	2,600	85.950	223,470.000	
ATMOS ENERGY CORP	2,300	74.150	170,545.000	
ALLIANT ENERGY CORP	5,000	37.250	186,250.000	
CITIGROUP INC	66,123	55.520	3,671,148.960	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,600	97.040	1,028,624.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	11,500	61.270	704,605.000	
ALLEGHANY CORP	350	568.900	199,115.000	
DUN & BRADSTREET CORP	900	123.100	110,790.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	170.870	187,957.000	
HESS CORP	6,500	49.050	318,825.000	
DAVITA INC	3,800	63.660	241,908.000	
DANAHER CORP	14,250	79.130	1,127,602.500	
FORTIVE CORP	7,200	55.280	398,016.000	
AVNET INC	2,800	46.090	129,052.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	13,500	54.840	740,340.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,000	30.900	123,600.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,028	25.860	104,164.080	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13,400	42.770	573,118.000	
BUNGE LTD	3,100	67.110	208,041.000	
TE CONNECTIVITY LTD	8,225	67.220	552,884.500	
APPLE INC	123,900	111.460	13,809,894.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,400	67.620	635,628.000	
BOEING CO/THE	13,500	151.640	2,047,140.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,465	77.110	267,186.150	
SPECTRA ENERGY CORP	15,996	41.120	657,755.520	
BECTON DICKINSON AND CO	4,887	172.730	844,131.510	
CDK GLOBAL INC	2,900	58.650	170,085.000	
NISOURCE INC	7,300	22.370	163,301.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,350	74.980	251,183.000	
CR BARD INC	1,680	215.880	362,678.400	

BANK OF NEW YORK MELLON CORP	25,071	47.050	1,179,590.550	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	93,604	50.960	4,770,059.840	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	27,550	157.680	4,344,084.000	
ANSYS INC	2,100	94.530	198,513.000	
H&R BLOCK INC	5,100	22.380	114,138.000	
BB&T CORP	19,000	44.150	838,850.000	
BAKER HUGHES INC	9,573	60.480	578,975.040	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	38,700	56.360	2,181,132.000	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,300	80.290	104,377.000	
JPMORGAN CHASE & CO	82,670	78.920	6,524,316.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	5,600	73.380	410,928.000	
CIGNA CORP	5,900	138.300	815,970.000	
LKQ CORP	6,800	33.010	224,468.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,000	131.020	131,020.000	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	25,842	3.670	94,840.140	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,000	46.930	234,650.000	
CADENCE DESIGN SYS INC	6,900	26.590	183,471.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,960	112.060	443,757.600	
DOLLAR GENERAL CORP	6,500	78.310	509,015.000	
SERVICENOW INC	3,800	83.420	316,996.000	
CATERPILLAR INC	13,400	94.040	1,260,136.000	
CMS ENERGY CORP	6,400	41.840	267,776.000	
MOSAIC CO/THE	7,550	27.060	204,303.000	
DELTA AIR LINES INC	4,400	48.590	213,796.000	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	4,350	72.510	315,418.500	
CORNING INC	24,700	24.170	596,999.000	
CISCO SYSTEMS INC	115,900	29.830	3,457,297.000	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	20,000	71.200	1,424,000.000	
MORGAN STANLEY	33,300	40.600	1,351,980.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,250	98.410	123,012.500	
DOW CHEMICAL CO/THE	25,800	53.990	1,392,942.000	
MSCI INC	2,200	80.630	177,386.000	
COTY INC-CL A	11,139	19.550	217,767.450	
BROADCOM LTD	9,062	175.450	1,589,927.900	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,050	126.570	132,898.500	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,000	60.180	120,360.000	
ACUITY BRANDS INC	1,000	252.160	252,160.000	

ARAMARK	5,350	35.060	187,571.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,900	26.510	129,899.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,200	95.800	402,360.000	
CENTENE CORP	4,000	57.600	230,400.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,200	32.390	395,158.000	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	4,300	22.490	96,707.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,050	51.250	207,562.500	
GARTNER INC	1,900	104.080	197,752.000	
SPLUNK INC	2,900	57.380	166,402.000	
WHITEWAVE FOODS CO	4,100	55.100	225,910.000	
AGCO CORP	1,700	55.860	94,962.000	
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,300	76.110	1,088,373.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,300	45.280	421,104.000	
SMITH (A.O.) CORP	3,400	48.920	166,328.000	
DEERE & CO	6,200	100.350	622,170.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,600	70.590	254,124.000	
TIME WARNER INC	17,633	92.910	1,638,282.030	
VMWARE INC-CLASS A	1,900	81.610	155,059.000	
TEGNA INC	4,500	22.370	100,665.000	
NASDAQ INC	2,700	64.970	175,419.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	7,000	72.650	508,550.000	
MEDNAX INC	2,000	66.010	132,020.000	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,600	72.860	189,436.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,100	93.520	196,392.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	19,450	66.530	1,294,008.500	
AMETEK INC	5,225	45.980	240,245.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,800	44.840	260,072.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,400	83.720	703,248.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	10,150	151.480	1,537,522.000	
SCANA CORP	3,100	72.450	224,595.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,200	145.000	174,000.000	
WR GRACE & CO	1,600	67.010	107,216.000	
VALSPAR CORP/THE	1,700	102.230	173,791.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	700	395.110	276,577.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,600	21.330	162,108.000	
UGI CORP	3,900	46.340	180,726.000	
CUMMINS INC	3,700	138.220	511,414.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,600	37.950	516,120.000	

SABRE CORP	4,600	26.030	119,738.000	
CDW CORP/DE	3,550	51.780	183,819.000	
SIGNATURE BANK	1,300	149.510	194,363.000	
AMERCO	170	341.870	58,117.900	
HANESBRANDS INC	8,500	23.470	199,495.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,200	24.810	302,682.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,200	258.670	310,404.000	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	2,950	99.810	294,439.500	
NIELSEN HOLDINGS PLC	8,500	43.400	368,900.000	
KINDER MORGAN INC	43,981	21.400	941,193.400	
HCA HOLDINGS INC	7,100	71.520	507,792.000	
CABOT OIL & GAS CORP	10,550	23.060	243,283.000	
T-MOBILE US INC	6,750	55.390	373,882.500	
ZILLOW GROUP INC - C	2,500	36.010	90,025.000	
COCA-COLA CO/THE	94,650	41.150	3,894,847.500	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,000	52.750	211,000.000	
EATON VANCE CORP	2,500	40.230	100,575.000	
FMC TECHNOLOGIES INC	4,900	33.000	161,700.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,700	38.700	336,690.000	
CSX CORP	22,200	34.800	772,560.000	
FLUOR CORP	3,300	52.770	174,141.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,350	127.720	300,142.000	
EXPEDIA INC	2,875	125.100	359,662.500	
AUTOLIV INC	2,000	103.930	207,860.000	
AMAZON.COM INC	9,210	762.520	7,022,809.200	
FLOWSERVE CORP	2,900	45.040	130,616.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,900	83.900	411,110.000	
EXXON MOBIL CORP	95,305	85.900	8,186,699.500	
FLIR SYSTEMS INC	3,100	35.250	109,275.000	
AES CORP	15,600	11.880	185,328.000	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,800	158.630	285,534.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,000	211.910	211,910.000	
EOG RESOURCES INC	12,650	92.440	1,169,366.000	
EQT CORP	4,050	70.970	287,428.500	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,200	67.280	282,576.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,400	77.630	341,572.000	

AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,790	44.480	346,499.200	
FORD MOTOR CO	85,123	11.920	1,014,666.160	
MACY'S INC	7,398	42.490	314,341.020	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,440	27.650	95,116.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6,287	32.090	201,749.830	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,820	27.120	157,838.400	
MOBILEYE NV	3,900	37.540	146,406.000	
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	300	105.440	31,632.000	
AERCAP HOLDINGS NV	3,800	43.420	164,996.000	
FORTINET INC	3,100	30.240	93,744.000	
MARKEL CORP	320	906.040	289,932.800	
NEXTERA ENERGY INC	10,550	117.270	1,237,198.500	
FREEPORT-MCMORAN INC	27,108	14.970	405,806.760	
US BANCORP	39,500	49.100	1,939,450.000	
UNITED RENTALS INC	2,200	96.300	211,860.000	
F5 NETWORKS INC	1,600	142.810	228,496.000	
FASTENAL CO	6,500	47.010	305,565.000	
FISERV INC	5,200	106.540	554,008.000	
GENERAL ELECTRIC CO	205,600	31.050	6,383,880.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	3,650	40.710	148,591.500	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	6,150	31.140	191,511.000	
GENERAL MOTORS CO	31,900	34.570	1,102,783.000	
TRIPADVISOR INC	2,750	49.300	135,575.000	
LINKEDIN CORP - A	2,600	195.030	507,078.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,050	175.130	1,059,536.500	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,300	211.750	1,757,525.000	
ALPHABET INC-CL A	6,760	789.440	5,336,614.400	
ALPHABET INC-CL C	7,097	770.840	5,470,651.480	
GENERAL MILLS INC	13,600	62.660	852,176.000	
FIRSTENERGY CORP	9,968	32.550	324,458.400	
GENUINE PARTS CO	3,500	96.550	337,925.000	
IHS MARKIT LTD	8,234	35.640	293,459.760	
FIFTH THIRD BANCORP	17,500	25.390	444,325.000	
HARRIS CORP	2,950	104.680	308,806.000	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	46.890	140,670.000	
HALLIBURTON CO	19,750	47.790	943,852.500	
HOME DEPOT INC	28,150	129.620	3,648,803.000	
ASSURANT INC	1,400	86.070	120,498.000	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,600	12.280	302,088.000	
HERSHEY CO/THE	3,300	98.130	323,829.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,500	59.920	269,640.000	
HUMANA INC	3,500	210.000	735,000.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	6,800	98.850	672,180.000	
HELMERICH & PAYNE	2,600	67.570	175,682.000	
HENRY SCHEIN INC	1,900	153.240	291,156.000	
HP INC	40,700	15.150	616,605.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	37,700	23.740	894,998.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,500	35.770	160,965.000	
HOLLYFRONTIER CORP	3,900	27.540	107,406.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,100	36.240	76,104.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,800	82.390	230,692.000	
HARMAN INTERNATIONAL	1,600	109.450	175,120.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	13,953	84.000	1,172,052.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,950	163.530	3,425,953.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	9,100	48.840	444,444.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,600	56.200	202,320.000	
ZOETIS INC	10,700	50.450	539,815.000	
INGERSOLL-RAND PLC	6,029	75.060	452,536.740	
CHENIERE ENERGY INC	4,700	38.970	183,159.000	
LEGGETT & PLATT INC	3,100	48.570	150,567.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	14,523	31.090	451,520.070	
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	2,437	21.520	52,444.240	
WASTE CONNECTIONS INC	4,105	76.950	315,879.750	
JUNIPER NETWORKS INC	8,200	26.780	219,596.000	
JM SMUCKER CO/THE	2,720	127.270	346,174.400	
JOHNSON & JOHNSON	62,400	112.480	7,018,752.000	
ABBVIE INC	37,379	61.590	2,302,172.610	
HOLOGIC INC	5,750	38.980	224,135.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	8,350	116.500	972,775.000	
KROGER CO	21,200	33.100	701,720.000	
KLA-TENCOR CORP	3,700	81.680	302,216.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	6,150	266.580	1,639,467.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,100	149.690	314,349.000	

L BRANDS INC	5,600	71.950	402,920.000	
LOWE'S COS INC	20,500	70.710	1,449,555.000	
ELI LILLY & CO	22,750	67.150	1,527,662.500	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	6,900	56.170	387,573.000	
LAM RESEARCH CORP	3,700	107.570	398,009.000	
RANGE RESOURCES CORP	4,300	36.370	156,391.000	
JONES LANG LASALLE INC	1,000	101.250	101,250.000	
LOEWS CORP	6,500	44.420	288,730.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,449	63.320	345,030.680	
MCDONALD'S CORP	19,400	120.680	2,341,192.000	
3M CO	13,900	172.770	2,401,503.000	
FACEBOOK INC-A	53,150	120.870	6,424,240.500	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	5,254	53.270	279,880.580	
MANPOWERGROUP INC	1,700	85.120	144,704.000	
S&P GLOBAL INC	6,150	119.610	735,601.500	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,400	218.500	305,900.000	
CONCHO RESOURCES INC	3,250	127.330	413,822.500	
PHILLIPS 66	11,000	82.390	906,290.000	
MURPHY OIL CORP	3,600	29.420	105,912.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	10,800	28.870	311,796.000	
MATTEL INC	7,800	31.560	246,168.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,650	93.130	246,794.500	
MYLAN NV	10,450	36.060	376,827.000	
METLIFE INC	21,350	54.190	1,156,956.500	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	10,500	14.380	150,990.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,678	81.110	298,322.580	
MONSANTO CO	10,056	102.390	1,029,633.840	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	421.700	253,020.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,950	131.340	387,453.000	
MERCK & CO. INC.	63,871	62.190	3,972,137.490	
MASCO CORP	7,400	32.210	238,354.000	
M & T BANK CORP	3,369	140.790	474,321.510	
MARSH & MCLENNAN COS	12,150	68.980	838,107.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,522	79.110	595,065.420	
WORKDAY INC-CLASS A	2,650	84.050	222,732.500	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,950	47.710	188,454.500	

VANTIV INC - CL A	3,550	58.000	205,900.000	
NETAPP INC	6,700	36.510	244,617.000	
NIKE INC -CL B	30,550	50.630	1,546,746.500	
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,750	104.370	704,497.500	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,850	66.030	320,245.500	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,000	71.100	213,300.000	
ALLY FINANCIAL INC	10,200	19.270	196,554.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,950	251.800	994,610.000	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,200	63.440	393,328.000	
NEWMONT MINING CORP	12,000	33.550	402,600.000	
MCKESSON CORP	5,150	141.250	727,437.500	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,400	39.750	254,400.000	
XYLEM INC	4,200	51.340	215,628.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	35,850	90.600	3,248,010.000	
NUCOR CORP	7,150	61.630	440,654.500	
WESTERN UNION CO	11,346	21.160	240,081.360	
NEWELL BRANDS INC	10,142	47.470	481,440.740	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,550	67.570	1,185,853.500	
LIBERTY BROADBAND-C	2,600	71.830	186,758.000	
PAYCHEX INC	7,550	59.460	448,923.000	
PATTERSON COS INC	1,900	38.870	73,853.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,200	275.390	605,858.000	
ALTRIA GROUP INC	45,050	65.180	2,936,359.000	
P G & E CORP	11,500	60.460	695,290.000	
PFIZER INC	139,663	31.920	4,458,042.960	
ALKERMES PLC	3,600	58.070	209,052.000	
XCEL ENERGY INC	11,500	40.490	465,635.000	
STRYKER CORP	7,850	115.410	905,968.500	
PARKER HANNIFIN CORP	3,050	136.950	417,697.500	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,750	173.670	651,262.500	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,400	86.680	121,352.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	58,167	82.890	4,821,462.630	
EXELON CORP	21,322	33.660	717,698.520	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,100	125.590	640,509.000	
CONOCOPHILLIPS	28,650	44.230	1,267,189.500	
PEPSICO INC	32,700	102.540	3,353,058.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,200	99.770	1,017,654.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,050	75.980	307,719.000	

ACCENTURE PLC-CL A	14,550	120.940	1,759,677.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,200	61.870	136,114.000	
PENTAIR PLC	4,005	56.210	225,121.050	
QUALCOMM INC	33,650	66.770	2,246,810.500	
INVESCO LTD	9,850	30.940	304,759.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,700	169.800	288,660.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,600	57.190	377,454.000	
RAYTHEON COMPANY	6,900	150.540	1,038,726.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,800	70.060	126,108.000	
RED HAT INC	4,200	80.000	336,000.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,810	387.260	700,940.600	
REPUBLIC SERVICES INC	5,650	55.900	315,835.000	
PRICELINE GROUP INC/THE	1,140	1,520.270	1,733,107.800	
ROSS STORES INC	9,400	68.570	644,558.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,100	85.640	179,844.000	
RESMED INC	3,250	62.110	201,857.500	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,300	88.750	292,875.000	
ROBERT HALF INTL INC	2,800	44.670	125,076.000	
REYNOLDS AMERICAN INC	19,678	54.960	1,081,502.880	
RITE AID CORP	23,000	8.050	185,150.000	
RALPH LAUREN CORP	1,300	108.610	141,193.000	
AUTONATION INC	1,700	44.230	75,191.000	
ROCKWELL COLLINS INC	2,900	92.340	267,786.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	28,835	13.180	380,045.300	
CHEVRON CORP	43,318	109.340	4,736,390.120	
EDISON INTERNATIONAL	7,500	71.150	533,625.000	
TESLA MOTORS INC	2,670	189.570	506,151.900	
SYMANTEC CORP	14,700	24.320	357,504.000	
ENDO INTERNATIONAL PLC	4,600	16.170	74,382.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,472	119.930	416,396.960	
SYNOPSYS INC	3,400	61.170	207,978.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,885	280.490	1,370,193.650	
CBRE GROUP INC - A	7,100	29.160	207,036.000	
TWITTER INC	13,000	18.190	236,470.000	
NAVIENT CORP	8,700	17.190	149,553.000	
SOUTHERN CO/THE	21,750	48.310	1,050,742.500	
SYSCO CORP	12,400	53.890	668,236.000	
TRAVELERS COS INC/THE	6,723	113.700	764,405.100	

SOUTHWESTERN ENERGY CO	11,000	11.590	127,490.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,200	47.420	151,744.000	
STERICYCLE INC	1,950	75.830	147,868.500	
SCHLUMBERGER LTD	32,202	79.920	2,573,583.840	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,900	36.990	144,261.000	
AT&T INC	141,491	39.480	5,586,064.680	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,800	47.240	179,512.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,830	276.320	505,665.600	
SEMPRA ENERGY	5,400	101.270	546,858.000	
TIFFANY & CO	2,800	80.600	225,680.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,000	39.500	276,500.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	23,000	74.400	1,711,200.000	
SALESFORCE.COM INC	14,700	72.930	1,072,071.000	
SIGNET JEWELERS LTD	1,700	91.820	156,094.000	
WESTROCK CO	5,930	50.890	301,777.700	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	21,784	45.380	988,557.920	
TESORO CORP	2,850	82.160	234,156.000	
UNION PACIFIC CORP	18,900	100.570	1,900,773.000	
MARATHON OIL CORP	19,000	14.950	284,050.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	12,300	45.980	565,554.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	18,250	108.840	1,986,330.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,950	116.280	1,854,666.000	
UNUM GROUP	5,400	42.020	226,908.000	
SPRINT CORP	17,765	8.000	142,120.000	
ANTERO RESOURCES CORP	3,400	24.790	84,286.000	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	3,494	80.930	282,769.420	
VOYA FINANCIAL INC	5,000	37.830	189,150.000	
AMEREN CORPORATION	5,500	50.930	280,115.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	22,026	157.590	3,471,077.340	
VERISIGN INC	2,200	79.120	174,064.000	
VALERO ENERGY CORP	10,792	63.770	688,205.840	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,390	260.410	361,969.900	
FNF GROUP	5,738	32.610	187,116.180	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,000	123.180	246,360.000	
ANTHEM INC	6,050	145.280	878,944.000	
WALT DISNEY CO/THE	34,700	99.670	3,458,549.000	

WELLS FARGO & CO	110,772	51.860	5,744,635.920	
FOOT LOCKER INC	3,200	72.440	231,808.000	
WASTE MANAGEMENT INC	10,300	70.390	725,017.000	
WILLIAMS COS INC	16,700	28.930	483,131.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,100	74.750	231,725.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	163.580	278,086.000	
WAL-MART STORES INC	35,150	71.370	2,508,655.500	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,600	103.400	475,640.000	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	19,500	4.320	84,240.000	
WYNN RESORTS LTD	1,800	99.790	179,622.000	
XEROX CORP	19,244	9.460	182,048.240	
WABTEC CORP	2,100	84.480	177,408.000	
TJX COMPANIES INC	15,350	78.810	1,209,733.500	
WATERS CORP	1,800	137.630	247,734.000	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	2,000	69.720	139,440.000	
ALLERGAN PLC	9,057	192.640	1,744,740.480	
WHOLE FOODS MARKET INC	7,800	30.610	238,758.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,250	85.530	1,817,512.500	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,083	124.380	383,463.540	
WESTERN DIGITAL CORP	6,450	62.670	404,221.500	
WEC ENERGY GROUP INC	7,380	58.030	428,261.400	
WESTAR ENERGY INC	3,200	57.110	182,752.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,750	42.840	503,370.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	42,950	79.150	3,399,492.500	
PPL CORP	15,400	34.190	526,526.000	
PULTEGROUP INC	7,400	19.290	142,746.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,150	98.000	602,700.000	
NORTHERN TRUST CORP	4,900	81.140	397,586.000	
NVIDIA CORP	12,400	93.250	1,156,300.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,393	109.260	1,244,799.180	
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	9,550	21.510	205,420.500	
TYSON FOODS INC-CL A	6,900	58.960	406,824.000	
NETFLIX INC	9,800	117.510	1,151,598.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,050	141.270	1,278,493.500	

TORCHMARK CORP	2,675	69.670	186,367.250	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,400	81.530	277,202.000	
TEXTRON INC	6,350	45.980	291,973.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	24,950	28.470	710,326.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,300	28.360	292,108.000	
NEWS CORP - CLASS A	8,337	11.540	96,208.980	
OGE ENERGY CORP	4,700	32.260	151,622.000	
OMNICOM GROUP	5,500	88.340	485,870.000	
ORACLE CORP	70,283	40.550	2,849,975.650	
MASTERCARD INC - A	22,450	103.820	2,330,759.000	
ONEOK INC	4,900	52.440	256,956.000	
CENTURYLINK INC	12,795	24.210	309,766.950	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,300	181.100	416,530.000	
YUM! BRANDS INC	8,300	63.540	527,382.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,400	228.710	320,194.000	
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,400	100.050	440,220.000	
NOBLE ENERGY INC	10,100	34.670	350,167.000	
BANK OF AMERICA CORP	232,501	20.290	4,717,445.290	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,800	86.700	329,460.000	
NORDSTROM INC	3,000	56.350	169,050.000	
AMERICAN EXPRESS CO	17,800	71.490	1,272,522.000	
ANALOG DEVICES INC	7,000	74.530	521,710.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	6,000	40.630	243,780.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	24,322	63.280	1,539,096.160	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	1,400	114.430	160,202.000	
ANADARKO PETROLEUM CORP	12,700	60.160	764,032.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,400	77.220	339,768.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,050	82.920	335,826.000	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,500	39.100	175,950.000	
MALLINCKRODT PLC	2,500	52.420	131,050.000	
AVERY DENNISON CORP	2,100	72.950	153,195.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	14,150	55.630	787,164.500	
EMERSON ELECTRIC CO	14,850	54.400	807,840.000	
AON PLC	6,200	113.650	704,630.000	
AMGEN INC	17,400	146.000	2,540,400.000	
CORE LABORATORIES N.V.	1,000	106.150	106,150.000	
COACH INC	6,400	37.400	239,360.000	

EATON CORP PLC	10,436	65.690	685,540.840	
CELGENE CORP	17,900	122.130	2,186,127.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,120	155.800	641,896.000	
APPLIED MATERIALS INC	24,500	32.160	787,920.000	
CIT GROUP INC	4,500	40.160	180,720.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,250	123.990	278,977.500	
CME GROUP INC	7,800	112.670	878,826.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,844	34.600	306,002.400	
ECOLAB INC	6,150	116.410	715,921.500	
EQUIFAX INC	2,750	119.320	328,130.000	
GAP INC/THE	5,800	25.240	146,392.000	
GILEAD SCIENCES INC	30,600	74.870	2,291,022.000	
ST JUDE MEDICAL INC	6,450	79.700	514,065.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,398	89.450	393,401.100	
HORMEL FOODS CORP	6,850	35.470	242,969.500	
STATE STREET CORP	9,193	77.010	707,952.930	
STAPLES INC	15,600	9.810	153,036.000	
SUNTRUST BANKS INC	11,598	51.140	593,121.720	
SCHWAB (CHARLES) CORP	27,400	38.460	1,053,804.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,400	44.760	510,264.000	
B/E AEROSPACE INC	2,300	59.910	137,793.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,600	57.650	265,190.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,100	55.640	172,484.000	
CARDINAL HEALTH INC	7,550	70.990	535,974.500	
FEDEX CORP	5,850	190.320	1,113,372.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,404	82.600	941,970.400	
FMC CORP	3,200	54.800	175,360.000	
FLEX LTD	12,200	14.540	177,388.000	
CERNER CORP	7,000	49.770	348,390.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,800	121.250	218,250.000	
CITRIX SYSTEMS INC	3,650	87.940	320,981.000	
INTEL CORP	108,400	35.310	3,827,604.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,800	24.340	214,192.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,100	46.920	426,972.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	7,400	125.610	929,514.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	45,000	4.610	207,450.000	
ILLUMINA INC	3,350	136.530	457,375.500	
SEALED AIR CORP	4,400	46.990	206,756.000	

INTUITIVE SURGICAL INC	870	650.310	565,769.700	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,100	81.590	252,929.000	
SNAP-ON INC	1,300	167.810	218,153.000	
CALPINE CORP	7,200	11.530	83,016.000	
CARMAX INC	4,600	57.510	264,546.000	
COMERICA INC	4,000	61.750	247,000.000	
INGREDION INC	1,600	120.220	192,352.000	
DUKE ENERGY CORP	15,828	76.370	1,208,784.360	
TARGET CORP	12,900	78.410	1,011,489.000	
DOVER CORP	3,500	69.780	244,230.000	
WW GRAINGER INC	1,300	226.350	294,255.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,900	61.720	178,988.000	
CINTAS CORP	2,100	115.580	242,718.000	
CA INC	7,105	32.480	230,770.400	
CONAGRA BRANDS INC	9,500	37.720	358,340.000	
CLOROX COMPANY	2,950	117.690	347,185.500	
ENTERGY CORP	4,250	71.400	303,450.000	
MICROSOFT CORP	169,350	61.090	10,345,591.500	
INCYTE CORP	3,850	105.070	404,519.500	
CVS HEALTH CORP	24,724	75.880	1,876,057.120	
MEDTRONIC PLC	31,638	73.420	2,322,861.960	
MICRON TECHNOLOGY INC	24,100	19.420	468,022.000	
BLACKROCK INC	2,850	368.550	1,050,367.500	
CENTERPOINT ENERGY INC	9,100	24.090	219,219.000	
HASBRO INC	2,600	86.620	225,212.000	
KELLOGG CO	6,100	73.620	449,082.000	
KEYCORP	24,500	17.010	416,745.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,400	87.950	211,080.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	35,611	42.860	1,526,287.460	
KOHLS CORP	4,400	54.140	238,216.000	
COOPER COS INC/THE	1,100	170.150	187,165.000	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	11,100	15.930	176,823.000	
APACHE CORP	8,760	60.740	532,082.400	
CHUBB LTD	10,799	128.240	1,384,863.760	
ARROW ELECTRONICS INC	2,000	68.400	136,800.000	
ALLSTATE CORP	8,700	69.630	605,781.000	
EBAY INC	25,000	28.510	712,750.000	

PAYPAL HOLDINGS INC	24,950	39.890	995,255.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	3,500	73.690	257,915.000	
XILINX INC	5,950	54.010	321,359.500	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	14,310	76.860	1,099,866.600	
DISH NETWORK CORP-A	5,300	57.690	305,757.000	
YAHOO! INC	21,000	41.600	873,600.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,150	78.610	404,841.500	
TOLL BROTHERS INC	3,800	30.610	116,318.000	
TRIMBLE INC	5,900	28.340	167,206.000	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,600	62.570	350,392.000	
LENNAR CORP-A	4,400	44.240	194,656.000	
LEAR CORP	1,700	128.060	217,702.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	6,500	34.070	221,455.000	
PROGRESSIVE CORP	13,400	33.580	449,972.000	
PRAXAIR INC	6,600	122.180	806,388.000	
PACCAR INC	7,987	61.270	489,363.490	
PVH CORP	1,900	106.030	201,457.000	
BIOGEN INC	5,080	302.770	1,538,071.600	
IDEXX LABORATORIES INC	2,000	120.340	240,680.000	
STARBUCKS CORP	33,600	58.170	1,954,512.000	
PERRIGO CO PLC	3,400	85.790	291,686.000	
EVERSOURCE ENERGY	7,480	53.750	402,050.000	
INTUIT INC	5,600	116.160	650,496.000	
BORGWARNER INC	4,800	34.460	165,408.000	
BEST BUY CO INC	7,100	45.620	323,902.000	
BALL CORP	3,792	77.050	292,173.600	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	31,047	20.770	644,846.190	
BED BATH & BEYOND INC	3,600	45.060	162,216.000	
XL GROUP LTD	6,800	36.490	248,132.000	
ELECTRONIC ARTS INC	7,050	81.370	573,658.500	
VULCAN MATERIALS CO	3,050	126.130	384,696.500	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,650	85.650	483,922.500	
VF CORP	7,750	55.630	431,132.500	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,471	61.000	577,731.000	
VIACOM INC-CLASS B	8,171	36.950	301,918.450	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,500	200.100	300,150.000	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,200	16.320	84,864.000	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,200	91.360	200,992.000	
CARNIVAL CORP	8,050	53.220	428,421.000	

	COMCAST CORP-CLASS A	54,570	70.140	3,827,539.800	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,800	53.770	311,866.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	26,500	6.270	166,155.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 445,578,302.990 (50,091,912,822)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	MERLIN ENTERTAINMENT	16,300	4.393	71,605.900	
	TUI AG-DI	11,747	10.530	123,695.910	
	BP PLC	436,300	4.425	1,930,845.650	
	UNILEVER PLC	30,110	31.300	942,443.000	
	BARCLAYS PLC	397,500	2.142	851,643.750	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	43,400	6.730	292,082.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	38,100	3.283	125,082.300	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,300	58.450	134,435.000	
	PRUDENTIAL PLC	60,200	15.465	930,993.000	
	INMARSAT PLC	10,300	7.215	74,314.500	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	79,291	1.970	156,203.270	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,564	31.410	143,355.240	
	BAE SYSTEMS PLC	76,100	6.015	457,741.500	
	AVIVA PLC	93,966	4.517	424,444.420	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	115,002	15.080	1,734,230.160	
	WORLDPAY GROUP PLC	42,700	2.715	115,930.500	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	8,000	7.025	56,200.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	25,200	4.030	101,556.000	
	DCC PLC	2,000	61.000	122,000.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,996,400	0.001	1,996.400	
	ROYAL MAIL PLC	22,400	4.646	104,070.400	
	RELX PLC	25,646	13.790	353,658.340	
	DIAGEO PLC	59,400	20.115	1,194,831.000	
	RIO TINTO PLC	29,150	30.670	894,030.500	
	STANDARD CHARTERED PLC	78,300	6.313	494,307.900	
	TESCO PLC	191,100	2.088	399,112.350	
	FRESNILLO PLC	5,000	12.340	61,700.000	
	SMITH & NEPHEW PLC	21,500	11.280	242,520.000	
	GLENCORE PLC	290,925	2.813	818,517.480	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,700	11.870	67,659.000	

SMITHS GROUP PLC	9,333	14.000	130,662.000	
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	9.475	57,797.500	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	33,983	3.521	119,654.140	
DIXONS CARPHONE PLC	24,800	3.354	83,179.200	
PEARSON PLC	18,863	7.785	146,848.450	
SAINSBURY (J) PLC	38,125	2.332	88,907.500	
NEXT PLC	3,300	49.390	162,987.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	73,900	1.494	110,406.600	
WHITBREAD PLC	4,311	34.820	150,109.020	
IMI PLC	5,850	9.580	56,043.000	
BUNZL PLC	7,755	20.600	159,753.000	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	20,600	2.678	55,166.800	
GKN PLC	40,600	3.084	125,210.400	
VODAFONE GROUP PLC	626,183	1.942	1,216,360.470	
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,993	32.820	98,230.260	
KINGFISHER PLC	51,911	3.575	185,581.820	
WPP PLC	29,800	17.200	512,560.000	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	15,927	9.030	143,820.810	
SEVERN TRENT PLC	5,733	22.210	127,329.930	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	14,900	67.630	1,007,687.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	11,900	9.470	112,693.000	
SCHRODERS PLC	3,200	27.880	89,216.000	
TATE & LYLE PLC	10,100	6.840	69,084.000	
SSE PLC	23,800	14.920	355,096.000	
WEIR GROUP PLC/THE	4,800	17.380	83,424.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,700	4.761	108,074.700	
ASTRAZENECA PLC	29,800	42.460	1,265,308.000	
WOLSELEY PLC	5,965	46.200	275,583.000	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	143,600	2.389	343,060.400	
3I GROUP PLC	22,991	6.725	154,614.470	
SKY PLC	24,800	7.745	192,076.000	
ASHTEAD GROUP PLC	12,200	15.110	184,342.000	
SAGE GROUP PLC/THE	26,114	6.755	176,400.070	
NATIONAL GRID PLC	88,828	9.281	824,412.660	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,503,965	0.577	867,938.200	
RSA INSURANCE GROUP PLC	24,260	5.385	130,640.100	
IMPERIAL BRANDS PLC	22,650	35.180	796,827.000	
CENTRICA PLC	128,360	2.098	269,299.280	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,000	25.170	75,510.000	

PROVIDENT FINANCIAL PLC	3,650	29.650	108,222.500	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	43,560	44.545	1,940,380.200	
ICAP PLC	12,000	4.860	58,320.000	
BHP BILLITON PLC	50,177	13.135	659,074.890	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,500	25.570	217,345.000	
HSBC HOLDINGS PLC	463,300	6.318	2,927,129.400	
SHIRE PLC	21,074	47.210	994,903.540	
OLD MUTUAL PLC	117,025	1.895	221,762.370	
ANGLO AMERICAN PLC	33,483	12.045	403,302.730	
MONDI PLC	8,300	16.330	135,539.000	
WM MORRISON SUPERMARKETS	50,900	2.202	112,081.800	
CARNIVAL PLC	4,511	41.290	186,259.190	
EASYJET PLC	3,500	10.110	35,385.000	
COMPASS GROUP PLC	38,841	13.920	540,666.720	
PERSIMMON PLC	7,550	17.240	130,162.000	
BT GROUP PLC	200,000	3.543	708,700.000	
COCA-COLA HBC AG-DI	4,400	16.750	73,700.000	
WILLIAM HILL PLC	19,200	3.021	58,003.200	
BURBERRY GROUP PLC	10,489	14.080	147,685.120	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,477	33.260	148,905.020	
CAPITA PLC	15,090	5.575	84,126.750	
TRAVIS PERKINS PLC	5,900	13.700	80,830.000	
INTERTEK GROUP PLC	3,800	32.500	123,500.000	
ITV PLC	86,800	1.712	148,601.600	
PETROFAC LTD	5,600	7.700	43,120.000	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	7,549	27.760	209,560.240	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	100,000	19.490	1,949,000.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	88,118	20.315	1,790,117.170	
MEGGITT PLC	17,700	4.714	83,437.800	
G4S PLC	34,600	2.398	82,970.800	
COBHAM PLC	38,600	1.648	63,612.800	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,300	16.690	55,077.000	
ADMIRAL GROUP PLC	5,200	18.990	98,748.000	
INVESTEC PLC	14,500	5.215	75,617.500	
ANTOFAGASTA PLC	8,600	7.000	60,200.000	
STANDARD LIFE PLC	45,463	3.478	158,120.310	

	EXPERIAN PLC	23,054	15.000	345,810.000	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 39,793,076.900 (5,589,335,581)	
イスラエル・シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	164.700	164,700.000	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	56,400	7.064	398,409.600	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	14.400	201,600.000	
	BANK HAPOALIM BM	26,500	23.150	613,475.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,600	15.530	583,928.000	
	NICE LTD	1,700	253.100	430,270.000	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 2,392,382.600 (70,144,658)	
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	
	HEALTHSCOPE LTD	37,500	2.300	86,250.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	61,700	2.600	160,420.000	
	BHP BILLITON LIMITED	75,200	25.460	1,914,592.000	
	SOUTH32 LTD	127,200	2.800	356,160.000	
	LENDLEASE GROUP	12,100	13.610	164,681.000	
	ALUMINA LTD	69,900	1.695	118,480.500	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,200	30.340	552,188.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	39,700	6.200	246,140.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	12.020	141,836.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	62,000	28.760	1,783,120.000	
	WESTPAC BANKING CORP	78,098	31.200	2,436,657.600	
	SANTOS LTD	34,000	4.050	137,700.000	
	AUSNET SERVICES	41,000	1.485	60,885.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	68,900	28.090	1,935,401.000	
	RIO TINTO LTD	9,700	60.390	585,783.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	41,400	6.040	250,056.000	
	AMCOR LIMITED	26,700	14.510	387,417.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,800	5.040	235,872.000	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	10,000	4.350	43,500.000	
	OIL SEARCH LTD	32,900	6.620	217,798.000	
	SEEK LTD	7,500	14.770	110,775.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	17,100	10.870	185,877.000	

NEWCREST MINING LTD	17,600	19.490	343,024.000	
INCITEC PIVOT LTD	45,600	3.230	147,288.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	40,100	77.760	3,118,176.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,000	29.950	179,700.000	
ORICA LTD	8,300	17.470	145,001.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	32,800	11.100	364,080.000	
CIMIC GROUP LTD	2,900	31.270	90,683.000	
WOOLWORTHS LTD	30,000	23.050	691,500.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	9.630	131,931.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	20,500	4.690	96,145.000	
CROWN RESORTS LTD	10,600	11.580	122,748.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	14,554	3.180	46,281.720	
TELSTRA CORP LTD	98,600	5.040	496,944.000	
AMP LTD	66,500	4.750	315,875.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	11,400	20.820	237,348.000	
MACQUARIE GROUP LTD	7,284	83.120	605,446.080	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,600	14.860	187,236.000	
BANK OF QUEENSLAND LTD	9,100	11.230	102,193.000	
CSL LTD	10,600	98.890	1,048,234.000	
WESFARMERS LTD	26,745	42.050	1,124,627.250	
COCHLEAR LTD	1,400	118.500	165,900.000	
SUNCORP GROUP LTD	31,200	12.480	389,376.000	
BORAL LTD	22,700	5.020	113,954.000	
BORAL LTD-RTS	10,225	0.255	2,607.370	
ASX LTD	4,200	48.500	203,700.000	
COMPUTERSHARE LTD	13,900	11.730	163,047.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	4.700	65,800.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	54,900	5.630	309,087.000	
SONIC HEALTHCARE LTD	9,500	21.760	206,720.000	
TRANSURBAN GROUP	47,800	10.450	499,510.000	
CHALLENGER LTD	12,200	10.730	130,906.000	
SYDNEY AIRPORT	25,100	6.250	156,875.000	
TATTS GROUP LTD	36,900	4.210	155,349.000	
AGL ENERGY LTD	15,200	20.950	318,440.000	
BRAMBLES LTD	37,300	11.920	444,616.000	
APA GROUP	26,700	7.980	213,066.000	
DUET GROUP	50,000	2.380	119,000.000	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,300	71.700	236,610.000	

	TPG TELECOM LTD	6,500	7.000	45,500.000	
	REA GROUP LTD	1,200	51.650	61,980.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,400	68.210	95,494.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 25,803,587.520 (2,171,113,854)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,200	44.220	318,384.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	440	631.390	277,811.600	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,696	30.450	142,993.200	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	5,387	64.990	350,101.130	
	SILVER WHEATON CORP	10,700	25.100	268,570.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,150	92.800	292,320.000	
	BCE INC	3,430	58.510	200,689.300	
	FRANCO-NEVADA CORP	4,300	79.550	342,065.000	
	SUNCOR ENERGY INC	39,330	40.350	1,586,965.500	
	METRO INC	5,500	41.050	225,775.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	7,700	50.140	386,078.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	28,200	73.700	2,078,340.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9,150	106.010	969,991.500	
	TORONTO-DOMINION BANK	43,700	64.090	2,800,733.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	6,700	35.620	238,654.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	34,850	90.120	3,140,682.000	
	TOURMALINE OIL CORP	4,700	34.930	164,171.000	
	VERMILION ENERGY INC	2,500	51.270	128,175.000	
	TRANSCANADA CORP	18,950	60.460	1,145,717.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	9,400	38.490	361,806.000	
	BOMBARDIER INC-B	45,400	1.900	86,260.000	
	BARRICK GOLD CORP	27,300	20.750	566,475.000	
	CAE INC	5,800	19.790	114,782.000	
	THOMSON REUTERS CORP	7,804	58.260	454,661.040	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	20,200	23.580	476,316.000	
	EMPIRE CO LTD 'A'	3,900	18.360	71,604.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,400	48.350	67,690.000	
	VERESEN INC	8,000	11.970	95,760.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	690	234.950	162,115.500	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	9,700	11.250	109,125.000	

LINAMAR CORP	1,100	51.100	56,210.000	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	5,400	29.000	156,600.000	
HYDRO ONE LTD	4,000	23.170	92,680.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,160	69.910	360,735.600	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,800	35.580	99,624.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,600	52.520	451,672.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,100	56.370	287,487.000	
KINROSS GOLD CORP	29,500	4.520	133,340.000	
BANK OF MONTREAL	15,200	89.140	1,354,928.000	
POWER CORP OF CANADA	8,700	29.990	260,913.000	
METHANEX CORP	2,200	54.680	120,296.000	
CAMECO CORP	9,200	12.200	112,240.000	
TELUS CORP	5,400	42.410	229,014.000	
POWER FINANCIAL CORP	5,600	33.680	188,608.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,400	33.830	453,322.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,700	142.110	241,587.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	20,800	4.610	95,888.000	
AGRIUM INC	3,100	131.960	409,076.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	25,500	41.670	1,062,585.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	540	637.000	343,980.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,300	54.670	508,431.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,100	112.060	123,266.000	
BLACKBERRY LTD	11,900	10.000	119,000.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	14,250	51.430	732,877.500	
ENBRIDGE INC	22,000	56.690	1,247,180.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	20,550	45.190	928,654.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	46,900	23.090	1,082,921.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	7,100	23.050	163,655.000	
GOLDCORP INC	19,959	18.050	360,259.950	
ENCANA CORP	23,200	15.210	352,872.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,400	200.190	680,646.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,200	55.890	122,958.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,200	37.270	193,804.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	18,350	89.770	1,647,279.500	

	CGI GROUP INC - CLASS A	5,300	65.500	347,150.000	
	HUSKY ENERGY INC	7,558	14.700	111,102.600	
	ONEX CORPORATION	2,000	94.620	189,240.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	9,500	26.540	252,130.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	3,900	26.000	101,400.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	3,400	56.170	190,978.000	
	ELDORADO GOLD CORP	17,200	3.630	62,436.000	
	IGM FINANCIAL INC	2,300	37.600	86,480.000	
	OPEN TEXT CORP	2,800	85.170	238,476.000	
	CI FINANCIAL CORP	5,400	26.710	144,234.000	
	SAPUTO INC	5,800	46.710	270,918.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,100	14.600	249,660.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,800	64.230	629,454.000	
	YAMANA GOLD INC	23,300	4.010	93,433.000	
	YAMANA GOLD INC-RTS	1,456	0.330	480.480	
	FORTIS INC	9,600	40.930	392,928.000	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	13,300	15.200	202,160.000	
	CENOVUS ENERGY INC	19,600	18.960	371,616.000	
	DOLLARAMA INC	2,700	103.140	278,478.000	
	ATCO LTD -CLASS I	1,700	43.100	73,270.000	
	ALTAGAS LTD	3,900	32.080	125,112.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	2,600	20.200	52,520.000	
	KEYERA CORP	4,000	37.290	149,160.000	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,900	32.360	126,204.000	
	INTER PIPELINE LTD	8,100	27.160	219,996.000	
	ARC RESOURCES LTD	8,300	22.250	184,675.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 37,543,091.900 (3,141,605,930)	
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 LTD	30,000	20.080	602,400.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	41,500	17.350	720,025.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,470	9.860	122,954.200	
	KEPPEL CORP LTD	34,500	5.390	185,955.000	
	UOL GROUP LTD	13,200	5.800	76,560.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	11,200	8.280	92,736.000	
	CAPITALAND LTD	59,000	3.030	178,770.000	

	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	3.720	152,520.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,000	39.550	118,650.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	74,200	9.020	669,284.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	153,000	0.965	147,645.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	188,650	3.770	711,210.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	35,000	3.310	115,850.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	29,000	2.730	79,170.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	219,400	0.435	95,439.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	19,000	7.180	136,420.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,800	2.500	117,000.000	
	STARHUB LTD	16,000	2.870	45,920.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	56,000	3.560	199,360.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	69,000	2.040	140,760.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 4,708,628.700 (371,840,408)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFRY AG-REG	1,050	124.300	130,515.000	
	UBS GROUP AG-REG	86,000	15.790	1,357,940.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	200	508.000	101,600.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,000	62.500	250,000.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	16,500	226.400	3,735,600.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	800	63.800	51,040.000	
	SIKA AG-BR	54	4,888.000	263,952.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	58,570.000	117,140.000	
	ABB LTD-REG	43,900	20.680	907,852.000	
	ARYZTA AG	2,100	43.970	92,337.000	
	SWISS RE AG	7,800	93.100	726,180.000	
	NESTLE SA-REG	72,700	68.300	4,965,410.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	420	498.250	209,265.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,000	179.700	179,700.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	43,520	13.460	585,779.200	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,200	44.510	231,452.000	
	SGS SA-REG	130	2,023.000	262,990.000	

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	500	177.100	88,550.000	
	GALENICA AG-REG	90	1,062.000	95,580.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	750	295.800	221,850.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,512	265.000	930,680.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,200	124.300	149,160.000	
	NOVARTIS AG-REG	52,200	70.050	3,656,610.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	50	1,214.000	60,700.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	12,350	65.200	805,220.000	
	SWISSCOM AG-REG	590	433.500	255,765.000	
	GEBERIT AG-REG	900	400.700	360,630.000	
	GIVAUDAN-REG	220	1,820.000	400,400.000	
	ACTELION LTD-REG	2,250	209.000	470,250.000	
	SYNGENTA AG-REG	2,162	383.900	829,991.800	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,300	123.200	160,160.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,300	180.700	234,910.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,100	57.850	63,635.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	10,840	52.550	569,642.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	800	280.100	224,080.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,250	132.300	165,375.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,600	83.650	133,840.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	5,085.000	116,955.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 24,162,736.000 (2,684,721,597)	
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	
	ICA GRUPPEN AB	1,900	273.100	518,890.000	
	ERICSSON LM-B SHS	72,230	47.160	3,406,366.800	
	VOLVO AB-B SHS	34,500	97.750	3,372,375.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,500	391.600	587,400.000	
	SKF AB-B SHARES	8,650	162.300	1,403,895.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	5,450	214.200	1,167,390.000	
	NORDEA BANK AB	70,650	95.450	6,743,542.500	
	SWEDISH MATCH AB	4,550	290.600	1,322,230.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	70.100	627,395.000	
	GETINGE AB-B SHS	4,700	144.100	677,270.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	34,150	91.200	3,114,480.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	35,200	125.100	4,403,520.000	

	SWEDBANK AB - A SHARES	21,300	211.200	4,498,560.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	21,700	268.000	5,815,600.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	14,100	244.200	3,443,220.000	
	SKANSKA AB-B SHS	8,250	208.900	1,723,425.000	
	SANDVIK AB	24,450	108.400	2,650,380.000	
	INVESTOR AB-B SHS	10,800	308.700	3,333,960.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,700	275.300	4,322,210.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,200	131.900	1,213,480.000	
	TELIA CO AB	60,000	34.680	2,080,800.000	
	ALFA LAVAL AB	7,000	138.200	967,400.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	244.500	2,224,950.000	
	ASSA ABLOY AB-B	23,300	170.000	3,961,000.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	6,400	164.800	1,054,720.000	
	BOLIDEN AB	6,000	237.800	1,426,800.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,550	67.950	852,772.500	
	KINNEVIK AB - B	5,300	224.100	1,187,730.000	
	HEXAGON AB-B SHS	6,200	315.800	1,957,960.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,500	159.800	559,300.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 70,619,021.800 (865,083,017)	
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	45,000	230.100	10,354,500.000	
	DANSKE BANK A/S	16,350	206.000	3,368,100.000	
	ISS A/S	3,900	242.900	947,310.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	8,865.000	842,175.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,200	470.200	2,445,040.000	
	TDC A/S	19,300	35.800	690,940.000	
	CARLSBERG AS-B	2,450	596.000	1,460,200.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,500	238.300	1,310,650.000	
	COLOPLAST-B	2,800	441.500	1,236,200.000	
	DSV A/S	4,600	314.100	1,444,860.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,375	116.000	391,500.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	160	9,355.000	1,496,800.000	
	PANDORA A/S	2,650	842.500	2,232,625.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,350	397.400	933,890.000	
	GENMAB A/S	1,300	1,237.000	1,608,100.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ	

				30,762,890.000 (494,974,900)	
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	
	MERIDIAN ENERGY LTD	26,000	2.570	66,820.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.510	184,938.390	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	6.100	142,740.000	
	CONTACT ENERGY LTD	13,000	4.730	61,490.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	10.800	217,080.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,300	8.540	45,262.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 718,330.390 (57,646,014)	
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	33,400	40.500	1,352,700.000	
	DNB ASA	22,550	122.100	2,753,355.000	
	ORKLA ASA	19,050	76.550	1,458,277.500	
	TELENOR ASA	17,800	126.700	2,255,260.000	
	STATOIL ASA	26,173	139.700	3,656,368.100	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,500	183.900	275,850.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,160	317.700	1,321,632.000	
	MARINE HARVEST	8,700	154.700	1,345,890.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,850	138.500	671,725.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,800	175.500	315,900.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 15,406,957.600 (203,063,701)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	19,550	88.770	1,735,453.500	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,800	25.940	98,572.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	32,150	14.660	471,319.000	
	COMMERZBANK AG	24,685	6.413	158,304.900	
	VOLKSWAGEN AG	800	129.950	103,960.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	4,350	122.600	533,310.000	
	MAN SE	850	93.380	79,373.000	
	SIEMENS AG-REG	17,900	106.100	1,899,190.000	
	E.ON SE	46,500	6.220	289,230.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,750	81.200	629,300.000	

GEA GROUP AG	4,200	35.185	147,777.000	
OSRAM LICHT AG	2,160	47.685	102,999.600	
CONTINENTAL AG	2,550	167.950	428,272.500	
BASF SE	21,650	78.680	1,703,422.000	
LINDE AG	4,400	150.100	660,440.000	
K+S AG-REG	4,400	18.920	83,248.000	
ALLIANZ SE-REG	10,680	150.400	1,606,272.000	
THYSSENKRUPP AG	8,500	21.050	178,925.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,200	108.250	454,650.000	
RWE AG	11,800	12.020	141,836.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	5,050	12.425	62,746.250	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	900	54.450	49,005.000	
BRENNTAG AG	3,650	48.785	178,065.250	
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,700	68.320	662,704.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,700	36.270	97,929.000	
HOCHTIEF AG	500	132.400	66,200.000	
SAP SE	23,142	79.690	1,844,185.980	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,870	172.900	669,123.000	
SCHAEFFLER AG	3,800	12.240	46,512.000	
ZALANDO SE	1,900	35.845	68,105.500	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,300	84.070	277,431.000	
COVESTRO AG	1,600	58.750	94,000.000	
INNOGY SE	3,400	33.560	114,104.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,700	48.170	178,229.000	
BEIERSDORF AG	2,300	77.210	177,583.000	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,500	37.325	55,987.500	
MERCK KGAA	3,100	95.290	295,399.000	
ADIDAS AG	4,420	139.400	616,148.000	
HENKEL AG & CO KGAA	2,400	94.310	226,344.000	
METRO AG	4,100	27.865	114,246.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	75,400	14.780	1,114,412.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,050	74.000	373,700.000	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	22,500	63.540	1,429,650.000	
QIAGEN N.V.	5,450	25.850	140,882.500	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	27,000	16.015	432,405.000	
HANNOVER RUECK SE	1,400	100.100	140,140.000	

DEUTSCHE POST AG-REG	23,100	29.285	676,483.500	
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	4,600	75.630	347,898.000	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	5,050	31.800	160,590.000	
LANXESS AG	2,200	57.750	127,050.000	
AXEL SPRINGER SE	1,000	40.900	40,900.000	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	8,200	29.280	240,096.000	
SYMRISE AG	3,000	56.930	170,790.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,500	3.611	59,581.500	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,200	68.470	82,164.000	
HUGO BOSS AG -ORD	1,650	54.330	89,644.500	
RTL GROUP	1,000	64.840	64,840.000	
VONOVIA SE	10,900	30.840	336,156.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,876	27.525	602,136.900	
NN GROUP NV	7,600	30.340	230,584.000	
ARCELORMITTAL	42,300	7.052	298,299.600	
UNILEVER NV-CVA	38,350	37.025	1,419,908.750	
HEINEKEN NV	5,300	71.120	376,936.000	
RELX NV	23,419	15.300	358,310.700	
AEGON NV	40,744	4.759	193,900.690	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	29,883	18.920	565,386.360	
AKZO NOBEL	5,800	58.510	339,358.000	
KONINKLIJKE DSM NV	4,400	57.050	251,020.000	
WOLTERS KLUWER	6,900	33.840	233,496.000	
BOSKALIS WESTMINSTER	2,100	29.190	61,299.000	
ING GROEP NV	91,850	12.625	1,159,606.250	
KONINKLIJKE KPN NV	78,250	2.710	212,057.500	
ASML HOLDING NV	8,680	97.550	846,734.000	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	5,400	19.830	107,082.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,200	31.265	162,578.000	
VOPAK	1,600	43.260	69,216.000	
RANDSTAD HOLDING NV	3,000	48.100	144,300.000	
HEINEKEN HOLDING NV	2,300	66.200	152,260.000	
GEMALTO	2,000	48.950	97,900.000	
ALTICE NV - A	8,900	16.010	142,489.000	
ALTICE NV - B	2,900	16.080	46,632.000	
JCDECAUX SA	1,600	24.525	39,240.000	

SFR GROUP SA	2,300	23.340	53,682.000	
TOTAL SA	52,150	43.920	2,290,428.000	
MICHELIN (CGDE)	4,200	101.400	425,880.000	
AIR LIQUIDE SA	9,048	94.850	858,202.800	
KERING	1,800	204.350	367,830.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	13,200	62.150	820,380.000	
BOUYGUES SA	4,650	31.865	148,172.250	
BNP PARIBAS	24,900	54.390	1,354,311.000	
PEUGEOT SA	11,250	13.950	156,937.500	
NATIXIS	22,950	4.677	107,337.150	
THALES SA	2,550	92.310	235,390.500	
DANONE	13,800	59.880	826,344.000	
CARREFOUR SA	12,900	22.195	286,315.500	
SUEZ	7,475	13.235	98,931.620	
VIVENDI	23,741	18.000	427,338.000	
L'OREAL	5,950	161.150	958,842.500	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	11,500	40.605	466,957.500	
LEGRAND SA	6,367	51.750	329,492.250	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,300	42.885	55,750.500	
PERNOD RICARD SA	4,917	98.050	482,111.850	
SOCIETE BIC SA	700	121.950	85,365.000	
EURAZEO	1,075	50.870	54,685.250	
REXEL SA	7,050	14.385	101,414.250	
SOCIETE GENERALE SA	18,000	39.900	718,200.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,550	170.750	1,118,412.500	
ACCOR SA	4,000	33.515	134,060.000	
CAPGEMINI	3,900	75.790	295,581.000	
VALEO SA	5,650	52.770	298,150.500	
PUBLICIS GROUPE	4,600	61.230	281,658.000	
BUREAU VERITAS SA	6,050	17.595	106,449.750	
EIFFAGE	1,300	62.650	81,445.000	
SODEXO	2,300	102.400	235,520.000	
INGENICO GROUP	1,200	73.860	88,632.000	
ZODIAC AEROSPACE	4,800	20.855	100,104.000	
ESSILOR INTERNATIONAL	4,900	100.050	490,245.000	
AXA SA	45,500	22.000	1,001,000.000	
CHRISTIAN DIOR SE	1,300	182.350	237,055.000	
LAGARDERE SCA	2,650	23.050	61,082.500	

TECHNIP SA	2,550	62.030	158,176.500	
EDENRED	4,750	19.940	94,715.000	
RENAULT SA	4,600	74.010	340,446.000	
HERMES INTERNATIONAL	620	383.650	237,863.000	
STMICROELECTRONICS NV	15,300	9.311	142,458.300	
REMY COINTREAU	550	77.330	42,531.500	
ATOS SE	2,150	98.220	211,173.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,050	72.560	221,308.000	
WENDEL	600	108.150	64,890.000	
ORANGE	46,900	13.770	645,813.000	
ALSTOM	3,650	25.845	94,334.250	
CNP ASSURANCES	3,750	16.485	61,818.750	
SANOFI	27,375	76.320	2,089,260.000	
VINCI SA	11,850	61.370	727,234.500	
AIRBUS GROUP SE	13,600	60.430	821,848.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	10,550	16.320	172,176.000	
CREDIT AGRICOLE SA	25,700	10.650	273,705.000	
ENGIE	34,173	11.630	397,431.990	
IMERYS SA	900	65.690	59,121.000	
EDF	5,550	9.907	54,983.850	
SES	8,350	20.740	173,179.000	
SAFRAN SA	7,400	64.100	474,340.000	
ILIAD SA	600	176.900	106,140.000	
ARKEMA	1,550	88.570	137,283.500	
ADP	750	92.370	69,277.500	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	16.945	68,627.250	
SCOR SE	4,100	29.795	122,159.500	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	10,450	8.258	86,296.100	
BOLLORE	19,000	3.049	57,931.000	
UCB SA	2,750	61.500	169,125.000	
KBC GROEP NV	5,800	55.920	324,336.000	
COLRUYT SA	2,000	48.450	96,900.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,700	76.780	130,526.000	
SOLVAY SA	1,700	105.700	179,690.000	
UMICORE	2,250	54.890	123,502.500	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	17,900	98.900	1,770,310.000	
AGEAS	4,790	35.405	169,589.950	
PROXIMUS	3,500	26.600	93,100.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,200	50.190	60,228.000	

UNIPOLSAI SPA	21,750	1.769	38,475.750	
PRYSMIAN SPA	4,800	22.580	108,384.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	27,843	11.640	324,092.520	
SAIPEM SPA	134,300	0.386	51,960.670	
MEDIOBANCA SPA	14,615	6.275	91,709.120	
TENARIS SA	10,550	14.140	149,177.000	
UNICREDIT SPA	123,569	1.940	239,723.860	
TELECOM ITALIA SPA	258,282	0.703	181,572.240	
TELECOM ITALIA-RSP	134,950	0.581	78,405.950	
INTESA SANPAOLO-RSP	21,000	1.900	39,900.000	
INTESA SANPAOLO	298,597	2.038	608,540.680	
ATLANTIA SPA	9,907	20.370	201,805.590	
POSTE ITALIANE SPA	11,800	5.760	67,968.000	
ENI SPA	59,800	12.660	757,068.000	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	9,525	12.180	116,014.500	
ENEL SPA	177,834	3.790	673,990.860	
SNAM SPA	58,200	3.514	204,514.800	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,700	48.510	179,487.000	
TERNA SPA	35,400	4.038	142,945.200	
EXOR SPA	2,500	39.510	98,775.000	
CNH INDUSTRIAL NV	24,300	8.030	195,129.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,350	7.210	139,513.500	
FERRARI NV	2,835	51.850	146,994.750	
TELEFONICA SA	104,627	7.899	826,448.670	
ENDESA SA	7,650	19.535	149,442.750	
BANCO POPULAR ESPANOL	75,473	0.787	59,397.250	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	153,412	5.780	886,721.360	
IBERDROLA SA	127,134	5.731	728,604.950	
BANCO DE SABADELL SA	131,909	1.152	151,959.160	
BANKINTER SA	15,100	6.950	104,945.000	
REPSOL SA	25,700	12.080	310,456.000	
GRIFOLS SA	6,700	18.450	123,615.000	
BANCO SANTANDER SA	343,850	4.262	1,465,488.700	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	14,900	12.455	185,579.500	
AMADEUS IT GROUP SA	10,000	42.875	428,750.000	
GAS NATURAL SDG SA	8,450	16.280	137,566.000	
MAPFRE SA	21,450	2.822	60,531.900	

CAIXABANK S.A	74,800	2.718	203,306.400	
CAIXABANK S.A-RTS	74,800	0.039	2,917.200	
ZARDOYA OTIS SA	4,550	7.320	33,306.000	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	18,000	5.242	94,356.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,476	27.445	122,843.820	
AENA SA	1,600	127.300	203,680.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	25,300	32.455	821,111.500	
ENAGAS SA	5,400	23.475	126,765.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,000	16.995	169,950.000	
FERROVIAL SA	11,700	16.710	195,507.000	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	15,700	4.488	70,461.600	
BANKIA SA	108,422	0.822	89,122.880	
UPM-KYMMENE OYJ	12,400	21.480	266,352.000	
NOKIA OYJ	135,850	4.020	546,117.000	
WARTSILA OYJ ABP	3,200	39.800	127,360.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	13,100	9.070	118,817.000	
METSO OYJ	3,000	26.280	78,840.000	
ELISA OYJ	3,550	29.890	106,109.500	
SAMPO OYJ-A SHS	10,300	41.460	427,038.000	
FORTUM OYJ	10,450	13.700	143,165.000	
KONE OYJ-B	7,850	41.170	323,184.500	
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,000	33.570	100,710.000	
NESTE OYJ	2,950	38.140	112,513.000	
ORION OYJ-CLASS B	2,050	40.280	82,574.000	
OMV AG	3,550	29.675	105,346.250	
ERSTE GROUP BANK AG	6,650	25.790	171,503.500	
VOESTALPINE AG	2,850	35.735	101,844.750	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	2,400	17.040	40,896.000	
ANDRITZ AG	1,600	48.195	77,112.000	
BANK OF IRELAND	661,800	0.200	132,360.000	
JERONIMO MARTINS	6,000	14.905	89,430.000	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,500	2.710	134,145.000	
GALP ENERGIA SGPS SA	10,350	12.215	126,425.250	
KERRY GROUP PLC-A	3,850	66.600	256,410.000	
CRH PLC	19,400	31.155	604,407.000	
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,900	100.800	191,520.000	

ユーロ　小計				ユーロ 76,154,701.220 (9,115,717,736)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	33,000	73.150	2,413,950.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	55,000	37.600	2,068,000.000	
	MTR CORP	34,500	38.800	1,338,600.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	35,000	100.400	3,514,000.000	
	SINO LAND CO	88,000	11.620	1,022,560.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	63,169	94.400	5,963,153.600	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	55.000	1,760,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	12,500	77.100	963,750.000	
	CLP HOLDINGS LTD	42,500	76.250	3,240,625.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	33,000	10.420	343,860.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	28,386	42.850	1,216,340.100	
	HONG KONG & CHINA GAS	181,142	14.500	2,626,559.000	
	HANG SENG BANK LTD	17,900	146.400	2,620,560.000	
	WHEELOCK & CO LTD	25,000	43.050	1,076,250.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	129,000	8.560	1,104,240.000	
	WH GROUP LTD	135,000	6.330	854,550.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	27,300	203.600	5,558,280.000	
	LI & FUNG LTD	132,000	3.390	447,480.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	52,000	17.220	895,440.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	75.000	487,500.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	27.750	582,750.000	
	NWS HOLDINGS LTD	46,500	13.800	641,700.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	18,000	20.900	376,200.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	29,040	32.350	939,444.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	14,000	33.500	469,000.000	
	SJM HOLDINGS LTD	47,000	6.170	289,990.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	30,000	22.550	676,500.000	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	64,169	51.950	3,333,579.550	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	65.300	979,500.000	
	PCCW LTD	95,000	4.470	424,650.000	
	AIA GROUP LTD	283,000	47.050	13,315,150.000	
	SANDS CHINA LTD	57,200	38.900	2,225,080.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	8.590	257,700.000	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	31,500	29.750	937,125.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	20,000	17.000	340,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	87,500	29.000	2,537,500.000	
	WYNN MACAU LTD	38,000	13.940	529,720.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	57,000	9.940	566,580.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 68,937,866.250 (999,599,061)	
合計				75,856,759,279 [75,856,759,279]	

(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	3,197	526,737.720	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,187	1,310,190.100	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,600	450,936.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	13,600	348,976.000	
		VORNADO REALTY TRUST	3,827	379,255.700	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,500	514,165.000	
		EQUINIX INC	1,608	552,171.120	
		AMERICAN TOWER CORP	9,750	1,033,987.500	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	17,293	299,168.900	
		KIMCO REALTY CORP	10,000	260,400.000	
		VENTAS INC	7,900	482,453.000	
		WEYERHAEUSER CO	17,614	548,852.240	
		AGNC INVESTMENT CORP	7,800	148,278.000	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,900	172,983.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7,750	660,532.500	
		IRON MOUNTAIN INC	5,610	189,225.300	
		VEREIT INC	22,300	189,996.000	
		PROLOGIS INC	12,262	630,757.280	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,700	189,924.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,000	158,520.000	
		DUKE REALTY CORP	8,000	206,480.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,480	319,487.600	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,600	226,880.000	
		WELLTOWER INC	8,300	532,777.000	
		HCP INC	10,700	316,720.000	

	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	131,109.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,700	159,477.000	
	MACERICH CO/THE	3,000	207,450.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23,200	240,584.000	
	REALTY INCOME CORP	6,000	340,440.000	
	PUBLIC STORAGE	3,400	712,674.000	
	REGENCY CENTERS CORP	2,300	153,870.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,250	238,567.500	
	UDR INC	6,300	215,397.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,700	345,950.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,750	194,837.500	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 13,590,209.960 (1,527,811,404)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	18,200	177,450.000	
	SEGRO PLC	19,950	83,510.700	
	HAMMERSON PLC	17,400	95,700.000	
	BRITISH LAND CO PLC	22,100	132,600.000	
	INTU PROPERTIES PLC	21,100	57,307.600	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 546,568.300 (76,770,983)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	SCENTRE GROUP	121,922	513,291.620	
	DEXUS PROPERTY GROUP	23,950	216,029.000	
	GPT GROUP	40,060	189,483.800	
	MIRVAC GROUP	93,400	190,536.000	
	STOCKLAND	57,000	244,530.000	
	WESTFIELD CORP	45,496	414,923.520	
	GOODMAN GROUP	41,700	273,969.000	
	VICINITY CENTRES	74,873	213,388.050	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 2,256,150.990 (189,832,544)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1,500	47,235.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,000	65,370.000	

		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,300	88,935.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 201,540.000 (16,864,867)	
	シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	48,000	110,880.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	63,200	120,712.000	
		SUNTEC REIT	53,000	88,775.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 320,367.000 (25,299,382)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	2,360	497,724.000	
		ICADE	750	48,585.000	
		GECINA SA	950	116,897.500	
		KLEPIERRE	5,200	183,820.000	
		FONCIERE DES REGIONS	750	55,537.500	
	ユーロ　小計			ユーロ 902,564.000 (108,036,911)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	52,000	2,750,800.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 2,750,800.000 (39,886,600)	
投資証券　合計				1,984,502,691 [1,984,502,691]	
合計				1,984,502,691 [1,984,502,691]	

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　584銘柄 投資証券　36銘柄	97.0%	3.0%	66.4%

イギリス・ポンド	株式 106銘柄 投資証券 5銘柄	98.6%	1.4%	7.3%
イスラエル・シュケル	株式 6銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 63銘柄 投資証券 8銘柄	92.0%	8.0%	3.0%
カナダ・ドル	株式 90銘柄 投資証券 3銘柄	99.5%	0.5%	4.1%
シンガポール・ドル	株式 20銘柄 投資証券 3銘柄	93.6%	6.4%	0.5%
スイス・フラン	株式 38銘柄	100%	-%	3.4%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	100%	-%	0.6%
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	0.3%
ユーロ	株式 232銘柄 投資証券 5銘柄	98.8%	1.2%	11.8%
香港・ドル	株式 38銘柄 投資証券 1銘柄	96.2%	3.8%	1.3%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「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27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	22,299,870	277,840,378
コール・ローン	1,424,967,456	1,355,518,736
国債証券	160,897,617,318	152,458,096,613
派生商品評価勘定	10,321,012	15,156,110
未収利息	1,365,306,752	1,181,963,343
前払費用	28,126,154	27,676,065

流動資産合計	163,748,638,562	155,316,251,245
資産合計	163,748,638,562	155,316,251,245
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,453,112	138,679
未払解約金	81,875,100	338,983,307
流動負債合計	96,328,212	339,121,986
負債合計	96,328,212	339,121,986
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	57,305,049,313	59,006,131,580
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	106,347,261,037	95,970,997,679
元本等合計	163,652,310,350	154,977,129,259
純資産合計	163,652,310,350	154,977,129,259
負債純資産合計	163,748,638,562	155,316,251,245

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27年12月1日 至　平成28年11月30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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額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27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
1．※1　期首	平成26年12月2日	平成27年12月1日
期首元本額	58,642,095,234円	57,305,049,313円
期中追加設定元本額	4,738,151,583円	5,269,599,218円
期中一部解約元本額	6,075,197,504円	3,568,516,951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ＶＡ	1,705,324,690円	1,426,188,983円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	64,835,690円	47,463,120円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	424,599,533円	340,370,920円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	94,962,008円	85,931,327円

	ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,383,635,321円	1,134,382,139円
	ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	－円	45,058,356円
	ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	－円	79,097,081円
	Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	458,057円	850,783円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	－円	17,978円
	ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	－円	71,282,917円
	ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	－円	23,335,905円
	ＤＣダイワ外国債券インデックス	35,721,581,475円	38,020,240,928円
	ダイワ・ライフ・バランス３０	453,561,180円	588,263,235円
	ダイワ・ライフ・バランス５０	223,580,955円	260,217,655円
	ダイワ・ライフ・バランス７０	140,934,888円	159,536,254円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	208,558,781円	251,573,954円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	170,466,025円	202,071,895円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	51,355,053円	59,946,308円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	11,127,145円	12,384,412円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	11,074,521円	15,705,795円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	617,784円	932,613円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	1,816,582,601円	1,705,288,856円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	190,939,449円	194,065,438円

ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	7,736,607,136円	7,200,012,883円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	546,037,516円	519,885,779円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	350,468,264円	335,883,404円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	412,662,256円	396,659,545円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	70,890,454円	103,331,290円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	－円	7,209,795円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,422,306,182円	5,614,367,146円
ダイワライフスタイル２５	30,209,709円	35,139,131円
ダイワライフスタイル５０	48,765,591円	55,152,766円
ダイワライフスタイル７５	12,907,049円	14,282,989円
計	57,305,049,313円	59,006,131,580円
2. 期末日における受益権の総数	57,305,049,313口	59,006,131,580口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30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等であり、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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成28年11月30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等 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27年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成28年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	82,327,006	△1,064,833,729
合計	82,327,006	△1,064,833,729

（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26年12月2日から平成27年11月30日まで、及び平成27年12月1日から平成28年11月30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27年11月30日 現在				平成28年11月30日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち	(円)	(円)	(円)	うち	(円)	(円)

		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	1,316,101,673	－	1,311,969,573	△4,132,100	989,797,739	－	1,004,815,170	15,017,431
アメリカ・ドル	626,126,802	－	634,804,890	8,678,088	605,070,604	－	613,008,100	7,937,496
イギリス・ポンド	82,160,770	－	81,399,780	△760,990	58,653,622	－	61,094,110	2,440,488
オーストラリア・ドル	30,462,896	－	31,099,300	636,404	7,293,210	－	7,319,310	26,100
カナダ・ドル	20,008,159	－	19,916,260	△91,899	18,052,034	－	18,742,080	690,046
シンガポール・ドル	5,422,699	－	5,470,920	48,221	2,640,662	－	2,763,250	122,588
スイス・フラン	4,399,317	－	4,290,120	△109,197	1,594,900	－	1,666,650	71,750
スウェーデン・クローナ	6,881,802	－	6,790,520	△91,282	3,064,686	－	3,221,750	157,064
デンマーク・クローネ	42,231,229	－	41,505,440	△725,789	4,786,255	－	4,968,720	182,465
ノルウェー・クローネ	4,153,665	－	4,159,500	5,835	1,819,517	－	1,883,310	63,793
ポーランド・ズロチ	7,805,927	－	7,635,420	△170,507	3,945,147	－	3,993,040	47,893
メキシコ・ペソ	15,590,542	－	15,793,200	202,658	6,193,399	－	6,054,720	△138,679
ユーロ	463,562,173	－	451,947,553	△11,614,620	273,223,387	－	276,483,900	3,260,513
南アフリカ・ランド	7,295,692	－	7,156,670	△139,022	3,460,316	－	3,616,230	155,914
合計	1,316,101,673	－	1,311,969,573	△4,132,100	989,797,739	－	1,004,815,170	15,017,431

（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。

①　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。

②　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27年11月30日現在	平成28年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.8558円 (28,558円)	2.6265円 (26,265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	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20171115	1,686,000.000	1,740,457.800	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20180215	3,839,000.000	3,957,010.860	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,960,000.000	3,084,053.600	
		4% United States Treasury Note/Bond 20180815	3,173,000.000	3,333,998.020	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,488,000.000	2,615,410.480	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	3,161,000.000	3,270,149.330	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,096,000.000	3,238,199.280	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,621,000.000	2,784,393.140	

		3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,256,014.200	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	4,280,000.000	4,573,907.600	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,278,491.510	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,960,568.360	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20171031	2,372,000.000	2,394,510.280	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,679,124.570	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20171130	883,000.000	895,167.740	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	924,000.000	941,860.920	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20180131	255,000.000	259,959.750	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,397,596.400	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	1,234,000.000	1,261,666.280	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20180331	1,300,000.000	1,332,747.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	260,000.000	266,021.600	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,702,044.710	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20180531	1,322,000.000	1,349,101.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,065,000.000	1,088,004.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,341,000.000	1,368,383.220	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,570,312.220	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20180831	3,444,000.000	3,469,830.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20180930	2,835,000.000	2,849,827.050	

		1.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	1,320,000.000	1,336,394.400	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,169,642.690	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,165,000.000	2,176,582.750	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,861,000.000	1,870,807.470	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,426,000.000	1,429,222.760	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,244,891.520	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20190228	1,843,000.000	1,851,772.680	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190331	300,000.000	302,214.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190430	559,000.000	559,631.670	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,436,893.590	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,378,942.100	
		1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,359,285.840	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,784,000.000	1,765,446.400	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,497,098.850	
		1% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,872,000.000	1,856,930.400	
		1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,195,618.750	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20171031	2,648,000.000	2,646,225.840	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	882,099.400	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,099,666.240	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20171130	2,336,000.000	2,330,697.280	

		1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,338,928.800
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	1,913,000.000	1,910,149.630
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,879,188.920
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20180131	2,153,000.000	2,151,901.970
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,364,661.320
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	3,850,000.000	3,840,644.500
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	3,447,000.000	3,439,037.430
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,956,762.720
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20180331	2,315,000.000	2,308,471.700
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,147,437.200
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,591,300.000
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	4,218,000.000	4,196,572.560
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,433,878.200
		1% United States Treasury Note/Bond 20180531	3,407,000.000	3,407,238.490
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,449,654.790
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,693,000.000	1,702,446.940
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,156,721.170
		2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,870,705.420
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,697,000.000	1,706,537.140
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	3,768,000.000	3,863,066.640

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	2,031,444.970	
		2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,912,671.800	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181031	3,611,000.000	3,622,266.320	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,356,349.800	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,228,467.720	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,638,000.000	2,645,914.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,534,013.200	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20181231	2,026,000.000	2,042,126.960	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,062,408.720	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,443,859.610	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190131	2,185,000.000	2,201,715.250	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,676,333.070	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,373,000.000	2,390,797.500	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,754,860.020	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190331	2,383,000.000	2,407,378.090	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,882,695.270	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,412,000.000	5,536,692.480	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190430	2,975,000.000	3,004,750.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,459,641.090	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,241,000.000	2,256,216.390	

		2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,761,642.200
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2,885,000.000	2,912,494.050
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,540,237.250
		8.875% United States Treasury Note/Bond 20190215	904,000.000	1,058,737.680
		8.125% United States Treasury Note/Bond 20190815	724,000.000	855,529.080
		8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	808,515.540
		8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,721,015.180
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	825,720.780
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,119,844.800
		6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	865,116.000
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	965,126.250
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	919,240.000
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	953,053.200
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	613,088.410
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,382,433.840
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,241,000.000	1,676,317.980
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,926,000.000	2,477,009.340
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	747,464.560
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	693,559.760
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	1,019,000.000	1,310,841.600

		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	849,000.000	947,297.220	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,388,022.200	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	760,000.000	971,903.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,522,422.000	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,227,138.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,860,654.200	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,862,822.350	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,815,698.690	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,328,014.040	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,720,432.350	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,569,165.630	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,500,402.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,680,048.450	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,853,000.000	1,875,143.350	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,672,440.270	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	3,030,000.000	2,922,738.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,026,000.000	2,097,538.060	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,998,000.000	3,943,307.360	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,314,000.000	3,756,452.140	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,149,197.270	

		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,098,784.400
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,357,000.000	3,635,765.280
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,356,133.560
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,891,785.260
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,662,000.000	5,734,077.260
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	3,856,867.410
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190831	2,989,000.000	3,015,482.540
		2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,312,019.470
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,445,188.400
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,675,677.500
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,204,450.700
		2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,179,222.500
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,932,072.270
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,731,222.880
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20171115	1,593,000.000	1,593,302.670
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,890,386.720
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,342,040.500
		1% United States Treasury Note/Bond 20171215	1,517,000.000	1,518,941.760
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,210,070.240
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,220,001.040

		0.875% United States Treasury Note/Bond 20180115	1,547,000.000	1,546,334.790
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,942,867.960
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,382,610.170
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,635,318.750
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,424,593.410
		1% United States Treasury Note/Bond 20180215	1,961,000.000	1,962,608.020
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,781,448.200
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,796,138.010
		1% United States Treasury Note/Bond 20180315	2,081,000.000	2,082,373.460
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,784,126.560
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20180415	2,083,000.000	2,076,396.890
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,867,496.170
		1% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,180,000.000	2,180,239.800
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,723,753.200
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	4,035,000.000	4,065,262.500
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,597,015.190
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,588,518.120
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,816,504.640
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	3,010,619.730
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20180615	2,196,000.000	2,199,667.320

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	3,009,432.810
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,847,207.090
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20180715	2,189,000.000	2,183,943.410
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,140,611.650
		2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,182,900.410
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	6,143,000.000	6,005,212.510
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,510,186.660
		1% United States Treasury Note/Bond 20180815	14,000.000	13,986.280
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,431,625.850
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,844,912.600
		1% United States Treasury Note/Bond 20180915	2,179,000.000	2,176,014.770
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,439,344.880
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,850,144.760
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20181015	2,057,000.000	2,049,347.960
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,820,377.600
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,085,805.960
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,734,480.830
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,540,196.320
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,138,000.000	2,144,414.000
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20171130	2,277,000.000	2,277,432.630

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,092,130.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221130	2,687,000.000	2,684,877.270	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181215	2,151,000.000	2,156,786.190	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,051,794.270	
		1% United States Treasury Note/Bond 20171231	2,276,000.000	2,278,753.960	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	2,492,000.000	2,505,232.520	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20190115	2,146,000.000	2,145,399.120	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,085,674.600	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,062,016.100	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20180131	2,329,000.000	2,324,155.680	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	2,065,000.000	2,047,323.600	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,518,180.080	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,110,910.000	
		1% United States Treasury Note/Bond 20190315	2,100,000.000	2,092,188.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,230,146.530	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,262,000.000	2,188,485.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,942,410.300	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20180331	700,000.000	699,202.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,051,837.040	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190415	1,125,000.000	1,116,866.250	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	5,529,000.000	5,207,156.910
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,412,098.500
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20180430	4,300,000.000	4,286,025.000
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,014,358.400
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,106,098.660
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190515	2,507,000.000	2,486,317.250
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20180531	4,000,000.000	3,992,960.000
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,657,583.000
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,430,250.000
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190615	2,100,000.000	2,081,205.000
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,000,000.000	993,940.000
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,429,475.000
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,868,750.000
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20190715	2,500,000.000	2,466,675.000
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,203,184.000
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	2,987,058.000
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,500,000.000	2,463,950.000
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20180831	2,200,000.000	2,188,054.000
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,589,851.000
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,770,000.000	1,761,486.300

		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,591,294.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,634,467.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,291,040.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190915	2,600,000.000	2,569,008.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20180930	3,000,000.000	2,982,060.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,389,719.900	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,946,937.500	
		1% United States Treasury Note/Bond 20191015	2,147,000.000	2,126,603.500	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	2,326,000.000	2,310,811.220	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 599,940,357.710 (67,445,295,014)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
		2% United Kingdom Gilt 20200722	2,380,000.000	2,514,708.000	
		2% United Kingdom Gilt 20250907	2,121,000.000	2,254,198.800	
		1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,572,859.900	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,182,000.000	1,445,231.400	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	945,000.000	955,300.500	
		0.5% United Kingdom Gilt 20220722	60,000.000	58,956.000	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	400,000.000	358,480.000	
		8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,470,398.600	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,414,674.300	

		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,455,112.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,915,808.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,790,748.800	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,179,817.700	
		4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,974,842.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,856,800.800	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,666,000.000	2,512,827.800	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,574,742.400	
		5% United Kingdom Gilt 20180307	1,604,000.000	1,704,250.000	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,666,000.000	2,510,662.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,500,000.000	2,073,600.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,373,000.000	2,149,843.400	
		4.5% United Kingdom Gilt 20190307	1,573,000.000	1,729,828.100	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,758,978.200	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,232,000.000	1,445,875.200	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,870,000.000	2,611,642.000	
		3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,428,000.000	1,568,943.600	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,244,000.000	2,061,681.200	
		3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	2,020,452.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,252,744.500	

		3.75% United Kingdom Gilt 20210907	1,633,000.000	1,875,827.100	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,182,000.000	1,752,787.800	
		1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,364,413.200	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,156,000.000	2,706,426.800	
		1.25% United Kingdom Gilt 20180722	2,854,000.000	2,908,226.000	
		2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,110,371.400	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,536,216.600	
		1.75% United Kingdom Gilt 20190722	2,161,000.000	2,250,033.200	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,842,000.000	2,068,381.800	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,324,000.000	3,056,757.200	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 78,823,448.300 (11,071,541,548)	
	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	
		5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	2,455,000.000	2,642,267.400	
		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,420,000.000	2,795,172.600	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,209,000.000	2,391,728.480	
		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,032,000.000	2,406,639.840	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	2,063,000.000	2,151,853.410	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,450,373.200	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,066,515.160	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,173,000.000	2,209,767.160	

		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,314,000.000	1,362,512.880	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,516,221.400	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	958,000.000	1,127,546.840	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20181021	1,197,000.000	1,230,097.050	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,224,790.400	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	1,511,000.000	1,547,324.440	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	863,000.000	914,555.620	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	516,506.100	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	1,495,000.000	1,478,734.400	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	412,000.000	400,043.760	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,592,000.000	1,589,245.840	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	678,000.000	640,330.320	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	682,000.000	601,510.360	
	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 37,263,736.660 (3,135,370,803)	
	カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		2.75% Canada Government International Bond 20641201	325,000.000	389,603.500	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	623,212.440	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,419,068.630	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,722,822.360	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,192,000.000	1,768,177.040	

		4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	969,000.000	1,020,763.980	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1,524,000.000	1,639,214.400	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,413,000.000	1,913,724.810	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,476,000.000	1,612,013.400	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	1,053,282.560	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,351,000.000	1,471,711.850	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,491,000.000	1,929,890.760	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,276,230.620	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180301	1,265,000.000	1,274,588.700	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180901	1,021,000.000	1,031,403.990	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,524,228.300	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190301	853,000.000	873,224.630	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,627,000.000	1,671,775.040	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	847,000.000	972,864.200	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,232,122.600	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	829,000.000	847,337.480	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,772,000.000	1,784,935.600	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	931,000.000	927,545.990	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,029,000.000	1,027,405.050	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20171101	1,128,000.000	1,124,322.720	

		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,237,000.000	1,228,637.880	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180501	1,284,000.000	1,276,552.800	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	980,000.000	970,739.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180801	1,344,000.000	1,340,142.720	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	390,000.000	366,424.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20181101	800,000.000	797,344.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	340,000.000	330,677.200	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 38,441,988.750 (3,216,825,619)	
	シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
		4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	491,000.000	515,756.220	
		3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	740,752.800	
		3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	442,000.000	485,758.000	
		3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	466,820.400	
		2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	599,000.000	617,149.700	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	503,000.000	531,168.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	366,582.080	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	507,870.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	402,000.000	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20180401	504,000.000	500,315.760	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	421,000.000	438,387.300	

	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	238,000.000	257,754.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	128,812.500	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	270,000.000	272,295.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	224,000.000	225,456.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	228,256.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	168,000.000	169,009.680	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	246,285.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	190,000.000	186,131.600	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 7,286,560.040 (575,419,646)	
スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	404,000.000	517,851.240	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	497,000.000	728,895.230	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	605,000.000	632,019.300	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	517,000.000	567,438.520	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	407,000.000	452,531.090	
	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	362,000.000	405,925.080	
スイス・フラン　小計			スイス・フラン 3,304,660.460 (367,180,824)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	8,095,000.000	9,879,057.050	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	8,385,000.000	9,345,753.300	

	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,826,099.450	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,165,000.000	9,832,946.200	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,734,876.250	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,495,000.000	6,524,213.500	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	6,080,000.000	6,378,832.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 55,521,777.750 (680,141,777)	
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	1,864,000.000	2,885,472.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	5,291,000.000	5,527,666.430	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	20,161,080.720	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	9,762,651.060	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,650,000.000	8,894,808.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	5,846,000.000	6,445,799.600	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	7,863,000.000	8,841,393.090	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20181115	3,164,000.000	3,214,497.440	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 65,733,368.340 (1,057,649,897)	
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	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	6,075,000.000	6,635,783.250	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,698,000.000	7,476,508.540	

	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,824,000.000	5,022,507.600	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,535,662.950	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,452,477.350	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,140,000.000	3,114,095.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 30,237,034.690 (398,524,117)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,309,000.000	2,624,732.660	
	5.5% Poland Government Bond 20191025	1,912,000.000	2,085,036.000	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,078,000.000	2,016,615.880	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,073,610.320	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,056,766.460	
	Poland Government Bond 20181025	1,668,000.000	1,609,469.880	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	2,905,863.930	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	627,000.000	748,387.200	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,478,170.880	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	884,000.000	998,186.280	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,575,000.000	2,681,321.750	
	3.75% Poland Government Bond 20180425	1,720,000.000	1,767,454.800	
	2.5% Poland Government Bond 20180725	2,099,000.000	2,124,544.830	
	3.25% Poland Government Bond 20190725	1,840,000.000	1,893,728.000	

	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,538,739.530	
ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 31,602,628.400 (852,954,941)	
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	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	1,210,000.000	1,213,678.400	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	647,000.000	672,362.400	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	517,436.190	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	770,700.780	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,611,351.630	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,140,775.200	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,912,263.800	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,463,886.600	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	420,000.000	395,291.400	
	3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	1,595,000.000	1,586,562.450	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	829,552.500	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	678,068.290	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	560,229.360	
	3.314% MALAYSIAN GOVERNMENT 20171031	599,000.000	597,807.990	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,044,000.000	1,017,545.040	
	3.26% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180301	533,000.000	528,490.820	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	938,777.840	

		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	477,000.000	424,973.610	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	530,371.020	
		3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	645,674.560	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	587,406.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,028,545.560	
		4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	850,761.040	
		3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	648,000.000	640,029.600	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	702,618.950	
		3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	687,680.000	
		3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,115,163.720	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	620,000.000	573,059.800	
		3.759% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190315	768,000.000	765,611.520	
		3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	682,077.240	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	450,000.000	434,817.000	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	50,000.000	47,760.500	
		3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	344,586.880	
	マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 26,495,917.690 (667,167,207)	
	メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
		5% Mexican Bonos 20191211	15,647,000.000	14,937,877.960	
		5.75% Mexican Bonos 20260305	7,590,000.000	6,799,122.000	
		8% Mexican Bonos 20231207	8,233,000.000	8,610,318.390	
		10% Mexican Bonos 20241205	21,119,000.000	24,629,822.560	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	8,568,000.000	8,607,755.520	

	7.75% Mexican Bonos 20171214	13,756,000.000	13,993,291.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	8,540,051.380	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	9,558,595.200	
	8.5% Mexican Bonos 20181213	22,092,000.000	22,897,916.160	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	10,562,485.460	
	8% Mexican Bonos 20200611	12,728,000.000	13,231,646.960	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	21,626,000.000	21,194,128.780	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,231,049.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	11,399,000.000	11,089,289.170	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	14,654,000.000	14,801,272.700	
	4.75% Mexican Bonos 20180614	16,633,000.000	16,247,613.390	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	7,045,243.520	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 225,977,479.150 (1,231,577,261)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	445,875.840	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	411,743.700	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	292,944.420	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	414,699.000	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	199,916.000	
	0.25% Austria Government Bond 20191018	527,000.000	539,621.650	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	939,444.030	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	576,000.000	588,493.440	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	234,000.000	245,412.180	
	0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,444,439.520	
	1% Belgium Government Bond 20310622	924,000.000	927,788.400	
	1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	630,199.620	

		1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,331,330.610	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	544,000.000	557,436.800	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	290,000.000	327,520.200	
		0.2% Belgium Government Bond 20231022	150,000.000	151,533.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	774,000.000	1,129,676.220	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,764,167.130	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,157,666.780	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,426,168.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,663,127.820	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,443,673.760	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	3,009,299.500	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,364,546.600	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,120,891.500	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	1,894,264.920	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	2,211,000.000	2,390,091.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,605,651.490	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	2,938,962.420	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,757,557.070	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,331,719.000	
		3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,183,633.520	

		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	2,146,957.440	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,603,634.200	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,631,973.950	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,968,238.980	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,602,544.100	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,707,000.000	1,921,091.940	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,489,239.940	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,728,000.000	2,429,464.320	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,821,601.320	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,568,568.600	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	2,025,682.450	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,839,601.530	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,778,759.500	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,709,000.000	2,431,086.680	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,789,902.600	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,673,486.340	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,394,000.000	2,497,827.780	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,034,000.000	2,200,706.640	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,238,438.320	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	1,700,000.000	1,663,212.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20171215	733,000.000	739,362.440	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20180316	747,000.000	754,843.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20180615	1,500,000.000	1,518,300.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20180914	700,000.000	709,751.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180223	1,190,000.000	1,209,456.500	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180413	1,392,000.000	1,412,058.720	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20181012	1,209,000.000	1,249,610.310	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190222	1,438,000.000	1,495,088.600	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190412	1,113,000.000	1,146,579.210	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,183,619.340	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,770,864.930	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,496,884.480	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,615,035.660	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,200,000.000	1,227,012.000	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	826,319.260	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	685,000.000	1,056,975.550	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,225,000.000	3,302,278.250	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	4,066,384.440	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,507,000.000	4,227,478.890	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,709,000.000	4,305,522.060	

		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,075,000.000	3,438,311.250	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,564,000.000	2,612,615.080	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,809,946.500	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,424,000.000	3,663,148.800	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,697,000.000	4,754,489.880	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,931,000.000	3,125,178.750	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	2,567,000.000	2,809,684.180	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,484,000.000	4,076,219.160	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	3,263,000.000	3,674,953.750	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,380,000.000	3,837,956.200	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,017,000.000	1,746,361.890	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,981,766.360	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,466,107.590	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,550,000.000	4,158,115.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,480,000.000	4,077,342.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,099,000.000	3,735,999.450	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	3,063,697.620	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180525	2,114,000.000	2,167,695.600	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,088,000.000	2,917,938.240	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,712,626.280	

		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181125	1,920,000.000	1,983,820.800	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,549,640.640	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190525	1,764,000.000	1,836,059.400	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,332,137.200	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,799,000.000	3,110,220.810	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2,322,000.000	2,394,121.320	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2,792,000.000	2,803,782.240	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3,070,000.000	3,117,185.900	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20180225	1,335,000.000	1,346,894.850	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,101,000.000	2,181,720.420	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,244,930.240	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	2,020,000.000	2,145,623.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20190225	1,592,000.000	1,614,829.280	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,737,000.000	2,700,050.500	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	879,000.000	871,625.190	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	257,000.000	255,401.460	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,170,000.000	2,194,325.700	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	1,000,000.000	956,190.000	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	810,568.720	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,918,987.980	

		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,168,501.350	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	986,100.150	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	1,544,000.000	1,663,304.880	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,347,000.000	1,514,634.150	
		3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,318,346.940	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,349,000.000	2,224,231.200	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,716,640.310	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,646,653.800	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,487,564.800	
		1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180115	1,477,000.000	1,510,764.220	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,558,859.050	
		1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115	924,000.000	962,992.800	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,004,000.000	1,468,058.840	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,736,966.780	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,412,829.240	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180415	1,323,000.000	1,336,296.150	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,291,529.310	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	948,000.000	958,086.720	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	400,000.000	406,700.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,658,015.660	

		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	510,000.000	755,498.700	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,431,156.560	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,925,615.420	
		0.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180115	1,376,000.000	1,388,851.840	
		1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,470,894.400	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,129,000.000	1,188,972.480	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,229,000.000	1,246,390.350	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,654,947.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,465,000.000	1,345,734.350	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180515	1,258,000.000	1,261,220.480	
		0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,519,552.260	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,591,000.000	1,611,889.830	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,529,056.640	
		0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20181015	371,000.000	371,790.230	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	775,114.560	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,140,000.000	1,074,495.600	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,259,000.000	1,234,562.810	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,254,544.440	
		0.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190415	812,000.000	807,209.200	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,648,956.960	

		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	878,853.360	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,218,000.000	1,141,278.180	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	664,958.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	358,000.000	348,086.980	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	448,000.000	390,602.240	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191015	358,000.000	354,230.260	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,654,000.000	3,559,093.620	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,127,659.690	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,455,000.000	2,089,671.000	
		4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190201	2,074,000.000	2,250,704.800	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,161,970.240	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,098,000.000	2,829,215.940	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,390,000.000	2,878,157.500	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	3,098,360.180	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180201	2,480,000.000	2,610,547.200	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,734,000.000	2,355,066.780	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,101,000.000	2,559,606.280	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180801	2,187,000.000	2,346,126.120	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190301	2,708,000.000	2,961,712.520	
		4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	2,531,000.000	2,796,375.350	

		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,654,192.880	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	1,893,000.000	2,561,948.340	
		4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,869,120.000	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,493,273.960	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,527,821.900	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,415,258.880	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,692,743.310	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,418,886.760	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	2,059,882.980	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,376,422.000	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20171101	1,295,000.000	1,338,693.300	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,810,000.000	2,302,754.400	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,594,000.000	1,905,531.360	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180601	1,770,000.000	1,861,491.300	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,363,000.000	1,805,975.000	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,638,570.220	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20181201	2,111,000.000	2,248,215.000	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,950,052.650	
		2.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190501	1,100,000.000	1,156,166.000	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	1,901,000.000	2,191,035.570	

		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,219,106.900	
		2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,688,197.680	
		1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	1,246,000.000	1,282,333.360	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,611,033.000	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,839,698.960	
		4% Belgium Government Bond 20220328	1,377,000.000	1,694,233.260	
		4% Belgium Government Bond 20180328	966,000.000	1,026,616.500	
		4% Belgium Government Bond 20190328	1,121,000.000	1,242,325.830	
		3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	2,018,881.200	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,474,000.000	2,397,770.540	
		4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,768,356.780	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	801,000.000	1,099,909.170	
		4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,659,541.800	
		4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	977,744.800	
		3% Belgium Government Bond 20190928	1,123,000.000	1,236,962.040	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,543,021.740	
		1.25% Belgium Government Bond 20180622	1,052,000.000	1,083,896.640	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	753,000.000	1,170,523.440	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,777,645.800	
		3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	785,102.760	
		4.5% IRISH TREASURY 20181018	759,000.000	831,302.340	

		4.4% IRISH TREASURY 20190618	684,000.000	769,609.440	
		5.9% IRISH TREASURY 20191018	570,000.000	674,652.000	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,561,300.260	
		5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	923,247.900	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	620,550.000	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	734,251.480	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	874,647.740	
		0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	539,070.360	
		2% IRISH TREASURY 20450218	531,000.000	562,525.470	
		1% IRISH TREASURY 20260515	473,000.000	479,101.700	
		4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,035,000.000	1,205,040.150	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	985,000.000	1,575,665.100	
		4.65% Austria Government Bond 20180115	1,066,000.000	1,131,047.320	
		3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,446,419.520	
		3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,583,302.140	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,073,000.000	1,692,603.850	
		4.35% Austria Government Bond 20190315	989,000.000	1,102,576.760	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	675,000.000	953,471.250	
		3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	963,469.390	
		3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	1,056,689.600	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	574,298.460	
		1.95% Austria Government Bond 20190618	738,000.000	787,202.460	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	907,505.410	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,076,429.550	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	501,000.000	620,072.670	

		1.15% Austria Government Bond 20181019	426,000.000	440,948.340	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,039,636.680	
		4.375% Finland Government Bond 20190704	416,000.000	470,691.520	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	882,174.200	
		3.375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	716,315.120	
		3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	537,948.000	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	484,623.980	
		1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	677,514.600	
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	491,112.900	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	558,053.980	
		1.125% Finland Government Bond 20180915	425,000.000	438,910.250	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	603,938.140	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,832,000.000	2,677,193.200	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20171031	1,735,000.000	1,746,850.050	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,779,359.050	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,552,000.000	1,556,966.400	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180430	260,000.000	261,300.000	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,898,426.880	
		1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,250,000.000	1,288,837.500	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,802,857.230	

		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190131	1,172,000.000	1,175,621.480	
		0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,067,000.000	1,077,968.760	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	852,000.000	879,698.520	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	400,000.000	430,468.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,230,000.000	1,204,502.100	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	2,965,749.190	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,148,248.280	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,428,000.000	2,036,927.760	
		4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	2,206,000.000	2,357,022.760	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,111,734.180	
		4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,659,550.640	
		4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,985,071.250	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,173,000.000	1,630,153.290	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,365,305.800	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,789,000.000	2,264,068.950	
		4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,973,040.130	
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	3,066,514.350	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,265,000.000	1,761,967.900	
		5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,499,361.240	
		4.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180131	2,000,000.000	2,108,500.000	

		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,158,000.000	2,747,090.840	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,601,000.000	1,961,289.040	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,270,000.000	1,732,026.000	
		3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20181031	1,564,000.000	1,677,499.480	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,049,000.000	1,558,079.700	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190430	1,836,000.000	1,951,447.680	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,335,553.200	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,330,668.710	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,968,153.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 509,542,946.720 (60,992,290,722)	
	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% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20181221	4,178,000.000	4,179,002.720	
		7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,614,859.600	
		10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	15,434,000.000	16,954,249.000	
		6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	5,398,963.240	
		6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	6,122,000.000	5,756,088.060	
		6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,265,744.800	
		7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,329,055.570	
		7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	4,639,000.000	4,429,317.200	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	10,852,000.000	9,809,882.440	

		8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	7,321,000.000	6,550,025.490	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	7,862,000.000	7,048,283.000	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	6,044,000.000	5,475,501.360	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	5,943,000.000	5,346,025.650	
		8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	3,166,000.000	2,957,392.260	
		9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	1,579,000.000	1,472,922.780	
	南アフリカ・ランド　小計			南アフリカ・ランド 94,587,313.170 (766,157,237)	
国債証券　合計				152,458,096,613 [152,458,096,613]	
合計				152,458,096,613 [152,458,096,613]	

（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	237銘柄	100%	44.2%
イギリス・ポンド	国債証券	39銘柄	100%	7.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	21銘柄	100%	2.1%
カナダ・ドル	国債証券	32銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券	19銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券	6銘柄	100%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	100%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.7%
ノルウェー・クローネ	国債証券	6銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リンギット	国債証券	33銘柄	100%	0.4%
メキシコ・ペソ	国債証券	17銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	287銘柄	100%	40.0%
南アフリカ・ランド	国債証券	15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28年12月30日

Ⅰ	資産総額	790,103,725円
Ⅱ	負債総額	4,570,702円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	785,533,023円
Ⅳ	発行済数量	600,334,293口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3085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28年12月30日

Ⅰ	資産総額	130,959,851,885円
Ⅱ	負債総額	4,450,163,515円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	126,509,688,370円
Ⅳ	発行済数量	136,803,293,151口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9248円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成28年12月30日

Ⅰ	資産総額	53,928,455,072円
Ⅱ	負債総額	141,581,570円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	53,786,873,502円
Ⅳ	発行済数量	38,613,574,509口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3930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28年12月30日

Ⅰ	資産総額	83,008,698,047円
Ⅱ	負債総額	262,325,233円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	82,746,372,814円
Ⅳ	発行済数量	39,937,993,438口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0719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28年12月30日

Ⅰ	資産総額	159,980,361,098円
Ⅱ	負債総額	266,049,911円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	159,714,311,187円
Ⅳ	発行済数量	58,968,883,279口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7085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

① 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。

② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③ 上記①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た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ます。）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部　【委託会社等の情報】

第１　【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

平成28年12月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．ファンド個別会議

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

ロ．投資環境検討会

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2　【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28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	68	219,503
追加型株式投資信託	664	12,714,360
株式投資信託　　合計	732	12,933,863
単位型公社債投資信託	14	97,869
追加型公社債投資信託	14	2,167,293
公社債投資信託　合計	28	2,265,162
総合計	760	15,199,024

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57期事業年度（平成27年４月１日から平成28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58期事業年度に係る中間会計期間（平成28年４月１日から平成28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、百万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:百万円）

	前事業年度 （平成27年３月31日）		当事業年度 （平成28年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		31,438		31,715
有価証券		4,878		1,137
前払費用		139		159
未収委託者報酬		10,295		9,896
未収収益		110		87
繰延税金資産		585		468
その他		153		83
流動資産計		47,600		43,547
固定資産				
有形固定資産	※1	255	※1	243
建物		21		18
器具備品		234		224
無形固定資産		2,759		2,706
ソフトウェア		2,758		2,385
ソフトウェア仮勘定		1		321

投資その他の資産	12,979	14,223
投資有価証券	6,667	7,872
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	124	123
長期差入保証金	996	1,049
その他	60	47
固定資産計	15,995	17,173
資産合計	63,596	60,720

（単位:百万円）

		前事業年度 （平成27年３月31日）		当事業年度 （平成28年３月31日）
負債の部				
流動負債				
預り金		64		61
未払金		9,172		8,789
未払収益分配金		5		5
未払償還金		72		63
未払手数料		4,965		4,330
その他未払金	※2	4,127	※2	4,390
未払費用		4,162		4,215
未払法人税等		1,133		1,155
未払消費税等		1,429		538
賞与引当金		1,092		937
その他		747		22
流動負債計		17,801		15,720
固定負債				
退職給付引当金		2,072		2,209
役員退職慰労引当金		101		93
繰延税金負債		1,745		1,410
その他		2		-
固定負債計		3,920		3,714
負債合計		21,722		19,435
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174		15,174
資本剰余金				

資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	14,126	13,960
利益剰余金合計	14,501	14,334
株主資本合計	41,171	41,004
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	702	280
評価・換算差額等合計	702	280
純資産合計	41,873	41,284
負債・純資産合計	63,596	60,720

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）	当事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14
その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797

役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837
交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394
役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）		当事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）	
営業外収益				
受取配当金	※1	1,226	※1	109
受取利息		20		25
投資有価証券売却益		145		115
外国税関連費用引当金戻入益		-		171
その他		226		73
営業外収益計		1,620		496
営業外費用				
投資有価証券売却損		84		14
その他		67		94
営業外費用計		152		108
経常利益		20,416		19,471
特別利益				
固定資産売却益		7		-
特別利益計		7		-
特別損失				
外国税関連費用		746		-
その他		26		-
特別損失計		772		-
税引前当期純利益		19,651		19,471
法人税、住民税及び事業税		6,238		6,215

法人税等調整額	△17	△6
法人税等合計	6,220	6,209
当期純利益	13,431	13,262

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,126	△10,126	△10,126
当期純利益	-	-	-	13,431	13,431	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,304	3,304	3,304
当期末残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	494	494	38,360
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,126
当期純利益	-	-	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	208	208	208
当期変動額合計	208	208	3,513
当期末残高	702	702	41,873

当事業年度（自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△13,428
当期純利益	-	-	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△422	△422	△422
当期変動額合計	△422	△422	△589
当期末残高	280	280	41,284

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）子会社株式
移動平均法による原価法により計上しております。

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

時価のないもの
移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法
（１）有形固定資産
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。

建物　　10～18年

器具備品　　４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）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。

（２）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毎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。

（３）役員退職慰労引当金

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

４．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。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「投資有価証券売却益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。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、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （平成27年３月31日）	当事業年度 （平成28年３月31日）
建物	20百万円	23百万円
器具備品	275百万円	232百万円

※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27年３月31日）	当事業年度 （平成28年３月31日）
未払金	4,084百万円	4,320百万円

３　保証債務

前事業年度（平成27年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,834百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成28年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,749百万円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

※１　関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）	当事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）
受取配当金	1,065百万円	―

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27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26年６月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 ３月31日	平成26年 ６月26日

（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27年６月23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。

① 剰余金の配当の総額　13,428百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　5,148円
④ 基準日　平成27年３月31日
⑤ 効力発生日　平成27年６月24日

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28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27年６月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27年 ３月31日	平成27年 ６月24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28年６月23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。

① 剰余金の配当の総額　13,262百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　5,084円
④ 基準日　平成28年３月31日
⑤ 効力発生日　平成28年６月24日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）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。

（ii）価格変動リスクの管理

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

②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リスクマネジメント会議において報告を行っております。

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（１）現金・預金	31,438	31,438	－
（２）未収委託者報酬	10,295	10,295	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	10,520	10,520	－
資産計	52,254	52,254	－
（１）未払手数料	4,965	4,965	－
（２）その他未払金	4,127	4,127	－
（３）未払費用（*）	3,366	3,366	－
負債計	12,460	12,460	－

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

当事業年度（平成28年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（１）現金・預金	31,715	31,715	－
（２）未収委託者報酬	9,896	9,896	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	7,987	7,987	－
資産計	49,599	49,599	－
（１）未払手数料	4,330	4,330	－
（２）その他未払金	4,390	4,390	－
（３）未払費用（*）	3,420	3,420	－
負債計	12,141	12,141	－

（*）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

資　産

（１）現金・預金、並びに（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、証券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。

（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：百万円）

区分	前事業年度（平成27年３月31日）	当事業年度（平成28年３月31日）
（１）その他有価証券		
非上場株式	1,025	1,021
（２）子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	5,129	5,129
（３）長期差入保証金	996	1,049

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27年３月31日）

（単位：百万円）

	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	31,438	-	-	-
未収委託者報酬	10,295	-	-	-
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	6	1,591	3,790	84
合計	41,740	1,591	3,790	84

当事業年度（平成28年３月31日）

（単位：百万円）

	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	31,715	-	-	-
未収委託者報酬	9,896	-	-	-
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	1,115	4,570	1,712	141
合計	42,727	4,570	1,712	141

（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27年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　5,129百万円）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28年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　5,129百万円）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27年３月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	164	55	109
（２）その他			
証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
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	5,779	5,793	△14
小計	5,779	5,793	△14
合計	10,520	9,482	1,038

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　1,025百万円）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28年３月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの （１）株式 （２）その他 証券投資信託	 141 3,875	 55 3,408	 86 466
小計	4,016	3,463	553
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	3,970	4,119	△148
小計	3,970	4,119	△148
合計	7,987	7,583	404

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　1,021百万円）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26年４月１日　至　平成27年３月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（１）株式 （２）その他 証券投資信託	32 34,371	- 145	1 84
合計	34,404	145	85

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（１）株式 （２）その他 証券投資信託	3 19,069	- 115	0 13
合計	19,072	115	14

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。
当事業年度において、証券投資信託について4百万円の減損処理を行っております。

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

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）	当事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）
退職給付債務の期首残高	1,959百万円	2,072百万円
勤務費用	212	222
退職給付の支払額	△118	△120
その他	18	35
退職給付債務の期末残高	2,072	2,209

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

	前事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）	当事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,072百万円	2,209百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,072	2,209
退職給付引当金	2,072	2,209
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,072	2,209

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）	当事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）
勤務費用	212百万円	222百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	212	222

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度170百万円、当事業年度172百万円であります。

（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：百万円）

	前事業年度 （平成27年３月31日）	当事業年度 （平成28年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	670	676
賞与引当金	305	225
外国税関連費用	241	-
未払事業税	231	224
連結法人間取引（譲渡損）	128	121
投資有価証券評価損	105	95
出資金評価損	103	98
その他	206	173
繰延税金資産小計	1,992	1,615
評価性引当額	△ 613	△ 347
繰延税金資産合計	1,379	1,268
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	2,203	2,086
その他有価証券評価差額金	335	124
繰延税金負債合計	2,539	2,210
繰延税金負債の純額	1,159	941

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

	前事業年度 （平成27年３月31日）	当事業年度 （平成28年３月31日）
法定実効税率	35.64%	33.06%
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.14%	0.77%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△2.02%	△0.02%
評価性引当額の増減額	△2.67%	△1.29%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	△0.51%	△0.19%
その他	0.07%	△0.43%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.65%	31.89%

３．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年３月29日に国会で成立し、平成28年４月１日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から平成28年４月１日に開始する事業年度及び平成29年４月１日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年４月１日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が24百万円、繰延税金負債（長期）が74百万円、法人税等調整額が50百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が6百万円増加しております。

（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

内国籍証券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26年４月１日　至　平成27年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28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26年４月１日　至　平成27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（百万円）	科目	期末残高（百万円）
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）	1,834	－	－

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27年４月１日　至　平成28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（百万円）	科目	期末残高（百万円）
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）	1,749	－	－

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26年４月１日　至　平成27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（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	㈱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（注3）	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	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（注4）	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注２)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

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

(注４)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28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（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	㈱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（注3）	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	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（注4）	1,028	長期差入保証金	1,027

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注２)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

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

(注４)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

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）		当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）	
１株当たり純資産額	16,052.69円	１株当たり純資産額	15,826.85円
１株当たり当期純利益	5,148.94円	１株当たり当期純利益	5,084.10円

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

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）	当事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）
当期純利益（百万円）	13,431	13,262
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

(１)中間貸借対照表

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （平成28年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		22,153
有価証券		529
未収委託者報酬		9,521
繰延税金資産		428
その他		351
流動資産合計		32,984
固定資産		
有形固定資産	※１	241
無形固定資産		
ソフトウエア		2,212
その他		252
無形固定資産合計		2,465
投資その他の資産		
投資有価証券		7,003
関係会社株式		5,129
その他		1,296
投資その他の資産合計		13,430
固定資産合計		16,137
資産合計		49,121

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （平成28年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		7,144
未払費用		3,762
未払法人税等		1,205
賞与引当金		733
その他	※３	434
流動負債合計		13,279
固定負債		
退職給付引当金		2,301
役員退職慰労引当金		122
その他		9
固定負債合計		2,432
負債合計		15,712
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,184
利益剰余金合計		6,559
株主資本合計		33,229
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		179
評価・換算差額等合計		179
純資産合計		33,408
負債・純資産合計		49,121

（２）中間損益計算書

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日）

営業収益		
委託者報酬		39,705
その他営業収益		356
営業収益合計		40,062
営業費用		
支払手数料		20,125
その他営業費用		5,997
営業費用合計		26,122
一般管理費	※１	5,754
営業利益		8,184
営業外収益	※２	165
営業外費用	※３	59
経常利益		8,290
特別利益		―
特別損失	※４	260
税引前中間純利益		8,029
法人税、住民税及び事業税		3,936
法人税等調整額		△1,393
中間純利益		5,486

（３）中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,261	△ 13,261	△ 13,261
中間純利益	-	-	-	5,486	5,486	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 7,775	△ 7,775	△ 7,775
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,184	6,559	33,229

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	280	280	41,284
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,261
中間純利益	-	-	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 100	△ 100	△ 100
当中間期変動額合計	△ 100	△ 100	△ 7,875
当中間期末残高	179	179	33,408

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

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	４～20年

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

３．引当金の計上基準
（１）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。

（２）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。

（３）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。

４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
（１）消費税等の会計処理
消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

（２）連結納税制度の適用
連結納税制度を適用しております。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （平成28年９月30日現在）
有形固定資産	273百万円

２　保証債務

当中間会計期間（平成28年９月30日現在）
子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,554百万円に対して保証を行っております。

※３　消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　平成28年４月　１日 至　平成28年９月30日）
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	528百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　平成28年４月　１日 至　平成28年９月30日）
受取配当金	62百万円
投資有価証券売却益	53百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　平成28年４月　１日 至　平成28年９月30日）
為替差損	23百万円
投資有価証券売却損	16百万円

※４　特別損失の主要項目

	当中間会計期間 （自　平成28年４月　１日 至　平成28年９月30日）
MMF等償還関連費用	260百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30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	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 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

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28年６月23日定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年３月31日	平成28年６月24日

（金融商品関係）

当中間会計期間（平成28年９月30日）

金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
（１）現金・預金	22,153	22,153	－
（２）未収委託者報酬	9,521	9,521	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	6,511	6,511	－
資産合計	38,186	38,186	－
（１）未払金	7,144	7,144	－
（２）未払費用（*)	3,762	3,762	－
負債合計	10,906	10,906	－

（*）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

資　産

（１）現金・預金及び（２）未収委託者報酬

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

（３）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券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：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,051

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（平成28年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　5,129百万円）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（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	111	55	56
（２）その他			
証券投資信託	3,994	3,627	366
小計	4,105	3,682	422
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	2,406	2,569	△163
小計	2,406	2,569	△163
合計	6,511	6,252	259

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額　1,021百万円）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28年４月１日　至　平成28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28年４月１日　至　平成28年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　平成28年４月１日　至　平成28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28年４月１日　至　平成28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28年４月１日　至　平成28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28年４月１日 至　平成28年９月30日）	
１株当たり純資産額	12,807.54円
１株当たり中間純利益金額	2,103.26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。

（注２）　１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日）	
中間純利益(百万円)	5,486
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,486
普通株主に帰属しない金額(百万円)	―
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4　【利害関係人との取引制限】

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

①　自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行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。)。

②　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。)。

③　通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④　委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行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。

⑤　上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5　【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第２　【その他の関係法人の概況】

１　【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

①　名称　三井住友信託銀行株式会社

②　資本金の額　342,037百万円（平成28年3月末日現在）

③　事業の内容

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

(2) 販売会社

① 名　称	② 資本金の額 単位：百万円 （平成28年 3月末日現在）	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注1）
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	（注2）
三井住友信託銀行株式会社	342,037	（注3）
三井生命保険株式会社	167,280	（注4）
株式会社山口銀行	10,005	（注5）

（注1）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。

（注2）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

（注3）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。

（注4）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

（注5）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

２　【関係業務の概要】

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

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

3　【資本関係】

該当事項はありません。

＜再信託受託会社の概要＞

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成28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

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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

⑤ 使用開始日を記載することがあります。

⑥ 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

⑦ 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

⑧ 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。

⑨ ファンドの形態等を記載することがあります。

⑩　図案を採用することがあります。

⑪　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28年５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	髙波　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27年４月１日から平成28年３月31日までの第57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28年３月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成29年1月13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	貞廣　篤典　　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林　英之　　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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワライフスタイル７５の平成27年12月1日から平成28年11月30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、ダイワライフスタイル７５の平成28年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

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

(注) ２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年11月24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	髙波　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28年４月１日から平成29年３月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年４月１日から平成28年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成28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28年４月１日から平成28年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

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

(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。