【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30年8月24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】	髙橋　慎 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】	03-5555-3431
【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】	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】

2018年8月25日から2019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。

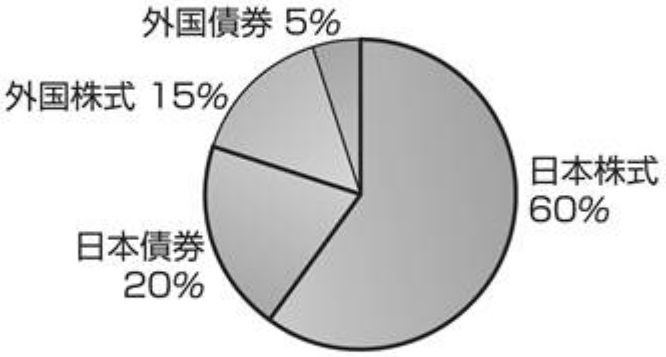
＜信託金の限度額＞
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜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。

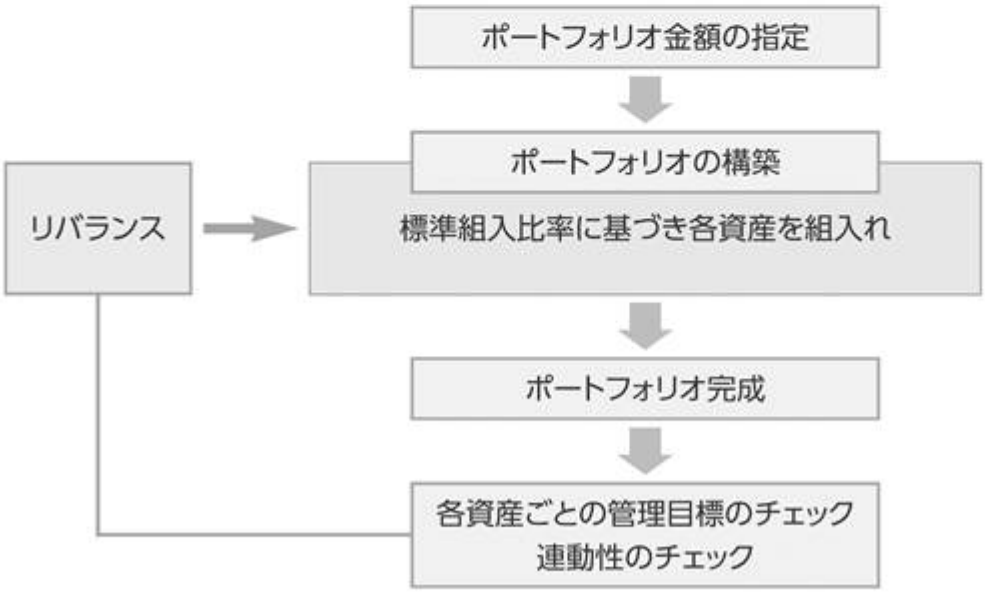
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

●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	FTSE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。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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1月4日（基準時）の時価総額を100として、1969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（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。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（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行ないます。

（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

FTSE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。

FTSE世界国債インデックスとは

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

(2) 【ファンドの沿革】

2000年 4月28日	信託契約締結、当初設定、運用開始
2000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（2018年6月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	設立登記
1960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
1960年 4月 1日	営業開始
1985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。
1995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。
1995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。
2007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

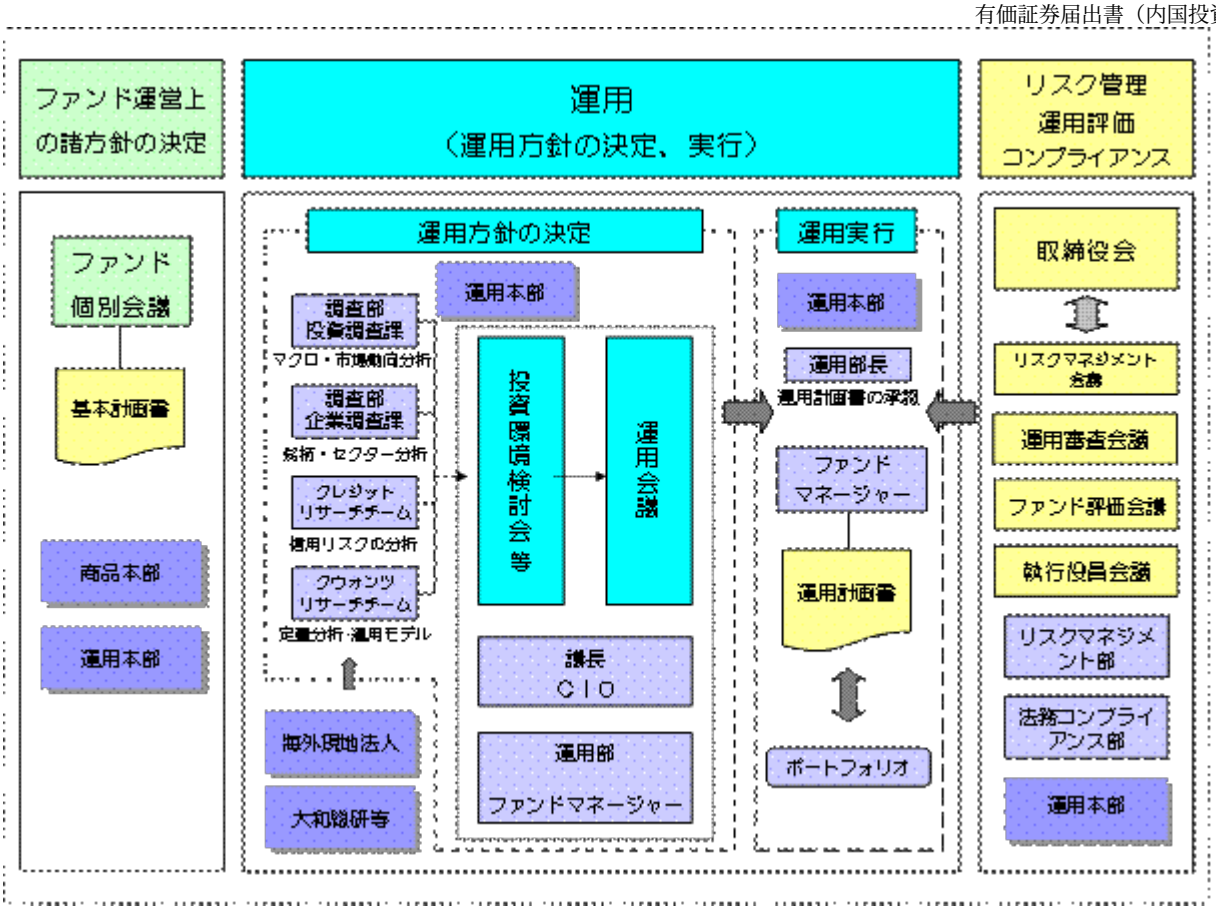
③ 前①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前② 1.から4.の金融商品により運用することの指図ができます。

※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25～35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2018年6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1月4日（基準時）の時価総額を100として、1969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FTSE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）FTSE世界国債インデックスとは

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均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

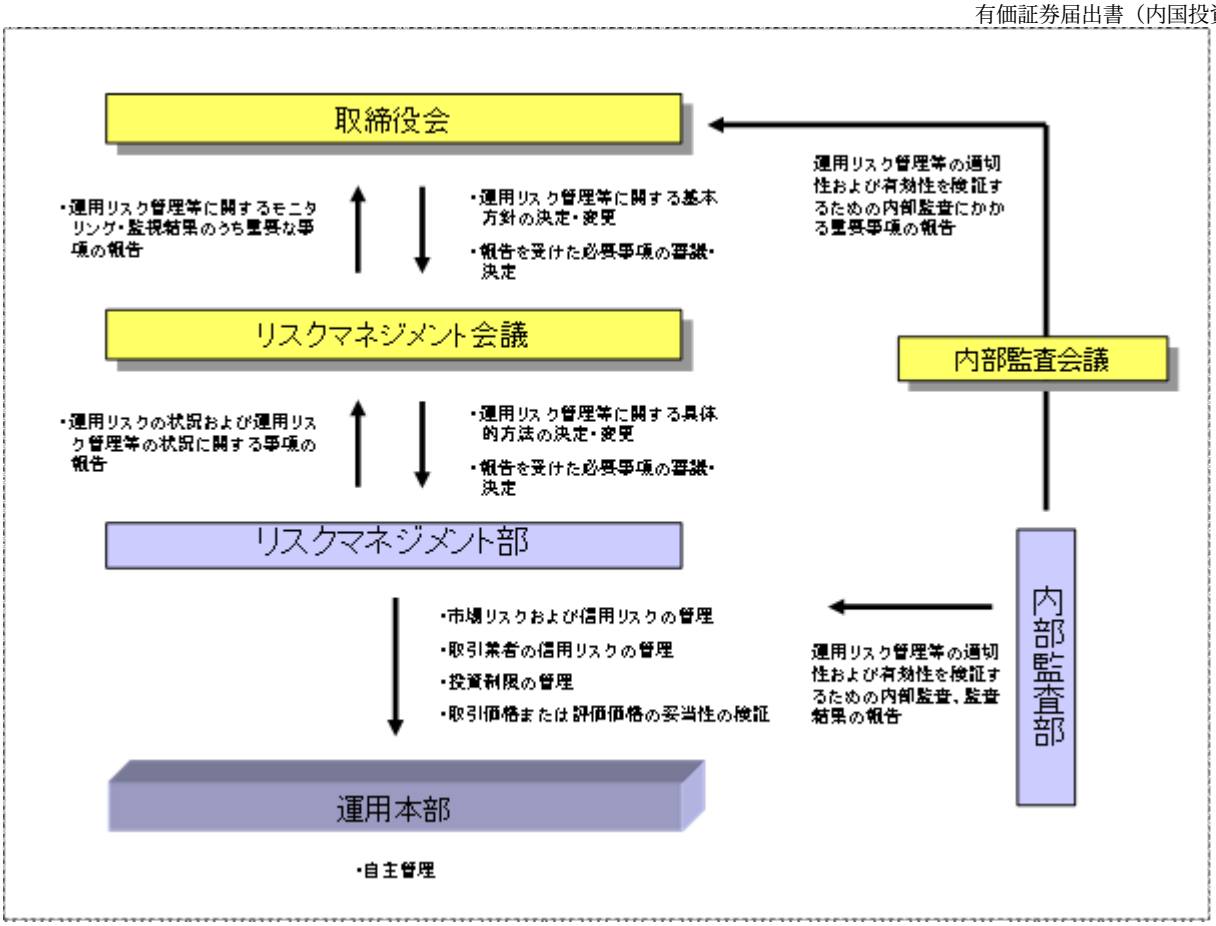
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

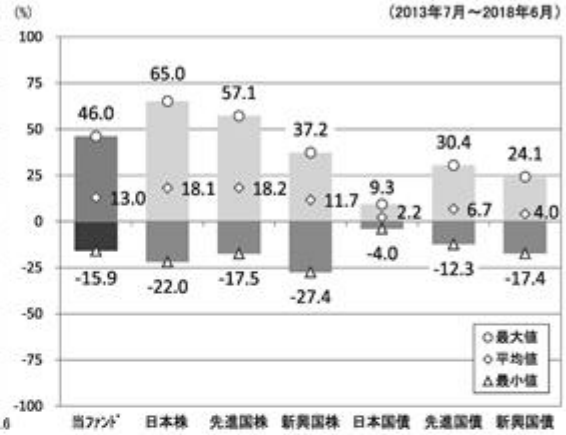
当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

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。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※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：FTSE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。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●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、毎日計上され、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、2037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、2037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、2037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、2018年6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30年6月29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	951,633,601	99.71
内 日本	951,633,601	99.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,785,584	0.29
純資産総額	954,419,185	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30年6月29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	522,164,460	1.1123 580,809,219	1.0887 568,480,447	59.56
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	136,967,358	1.3938 190,916,004	1.4026 192,110,416	20.13
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	59,280,253	2.3872 141,517,771	2.4106 142,900,977	14.97
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	17,691,372	2.8027 49,584,013	2.7212 48,141,761	5.04

(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	99.71%
合計	99.71%

(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
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
平成29年6月末日	844,544,045	－	1.3715	－
7月末日	853,901,917	－	1.3756	－
8月末日	866,878,674	－	1.3760	－
9月末日	895,107,932	－	1.4200	－
10月末日	917,935,643	－	1.4698	－

第18計算期間末 (平成29年11月30日)	937,336,300	937,336,300	1.4842	1.4842
12月末日	950,980,308	－	1.5046	－
平成30年1月末日	971,740,343	－	1.5133	－
2月末日	950,787,064	－	1.4681	－
3月末日	942,984,334	－	1.4410	－
4月末日	966,829,464	－	1.4808	－
5月末日	963,601,259	－	1.4651	－
6月末日	954,419,185	－	1.4597	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第18計算期間	0.0000
平成29年12月1日～ 平成30年5月31日	－

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第18計算期間	16.9

平成29年12月1日～ 平成30年5月31日	△1.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
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
第18計算期間	91,122,014	58,225,626
平成29年12月1日～ 平成30年5月31日	46,971,239	20,799,484

（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30年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		142,485,399,480	99.37
	内 日本	142,485,399,480	99.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		897,453,694	0.63
純資産総額		143,382,853,174	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）		899,860,000	0.63
	内 日本	899,860,000	0.63

(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30年6月29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	701,000	6,749.39 4,731,326,104	7,170.00 5,026,170,000	3.51
2	三菱UFJﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	3,980,000	707.63 2,816,377,440	631.10 2,511,778,000	1.75
3	ソニー	日本	株式	電気機器	386,300	4,349.05 1,680,039,769	5,664.00 2,188,003,200	1.53
4	ｿﾌﾄﾊﾞﾝｸｸﾞﾙｰﾌﾟ	日本	株式	情報・通信業	256,500	8,882.16 2,278,274,673	7,973.00 2,045,074,500	1.43
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	405,800	5,131.25 2,082,261,731	5,036.00 2,043,608,800	1.43
6	三井住友ﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	430,100	4,296.06 1,847,736,002	4,306.00 1,852,010,600	1.29
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	28,300	60,368.12 1,708,417,813	62,560.00 1,770,448,000	1.23
8	本田技研	日本	株式	輸送用機器	518,200	3,306.71 1,713,540,615	3,253.00 1,685,704,600	1.18
9	KDDI	日本	株式	情報・通信業	498,300	2,977.01 1,483,444,654	3,031.00 1,510,347,300	1.05
10	みずほﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	7,720,700	195.67 1,510,785,424	186.50 1,439,910,550	1.00
11	ﾘｸﾙｰﾄﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	日本	株式	サービス業	426,100	2,495.55 1,063,356,267	3,066.00 1,306,422,600	0.91
12	任天堂	日本	株式	その他製品	35,500	41,008.87 1,455,815,207	36,200.00 1,285,100,000	0.90
13	三菱商事	日本	株式	卸売業	398,500	2,638.97 1,051,633,166	3,078.00 1,226,583,000	0.86
14	ﾌｧﾅｯｸ	日本	株式	電気機器	54,800	22,828.20 1,250,985,528	22,005.00 1,205,874,000	0.84

15	花 王	日本	株式	化学	141,900	6,911.40 980,728,775	8,450.00 1,199,055,000	0.84
16	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	51,900	19,651.65 1,019,921,044	22,960.00 1,191,624,000	0.83
17	日本電産	日本	株式	電 気 機 器	69,500	13,866.03 963,689,662	16,625.00 1,155,437,500	0.81
18	セブン&アイ･HLDGS	日本	株式	小売業	237,900	4,421.55 1,051,887,601	4,831.00 1,149,294,900	0.80
19	ＮＴＴドコモ	日本	株式	情報・通信業	405,500	2,593.72 1,051,755,529	2,822.50 1,144,523,750	0.80
20	村田製作所	日本	株式	電 気 機 器	60,500	17,172.06 1,038,909,976	18,620.00 1,126,510,000	0.79
21	キヤノン	日本	株式	電 気 機 器	309,200	3,837.96 1,186,699,826	3,631.00 1,122,705,200	0.78
22	東京海上ＨＤ	日本	株式	保険業	214,000	4,552.94 974,330,046	5,193.00 1,111,302,000	0.78
23	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	358,200	3,690.16 1,321,816,254	3,095.00 1,108,629,000	0.77
24	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	103,900	10,206.95 1,060,502,539	10,615.00 1,102,898,500	0.77
25	日 立	日本	株式	電 気 機 器	1,385,000	793.61 1,099,160,776	781.60 1,082,516,000	0.75
26	ダイキン工業	日本	株式	機械	78,800	11,396.10 898,013,426	13,270.00 1,045,676,000	0.73
27	武田薬品	日本	株式	医薬品	212,700	6,146.14 1,307,286,042	4,678.00 995,010,600	0.69
28	パナソニック	日本	株式	電 気 機 器	658,400	1,647.12 1,084,470,328	1,493.50 983,320,400	0.69
29	信越化学	日本	株式	化学	99,500	10,178.31 1,012,742,556	9,873.00 982,363,500	0.69
30	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	567,300	1,471.65 834,868,755	1,689.00 958,169,700	0.67

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.37%
合計	99.37%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.12%
鉱業	0.29%
建設業	3.16%
食料品	4.47%
繊維製品	0.66%
パルプ・紙	0.26%
化学	7.38%
医薬品	4.72%
石油・石炭製品	0.77%
ゴム製品	0.81%
ガラス・土石製品	0.99%
鉄鋼	1.02%
非鉄金属	0.84%
金属製品	0.62%
機械	5.12%
電気機器	13.58%
輸送用機器	8.55%
精密機器	1.71%
その他製品	2.07%
電気・ガス業	1.75%
陸運業	4.34%
海運業	0.18%
空運業	0.57%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	7.44%
卸売業	4.72%
小売業	5.00%
銀行業	6.62%
証券、商品先物取引業	0.92%
保険業	2.25%
その他金融業	1.21%
不動産業	2.43%
サービス業	4.61%
合計	99.37%

(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 2018年9月	買建	52	929,268,080	899,860,000	0.63%

(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30年6月29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		64,500,645,640	84.58
	内 日本	64,500,645,640	84.58
地方債証券		4,409,707,700	5.78
	内 日本	4,409,707,700	5.78
特殊債券		3,339,762,500	4.38
	内 日本	3,339,762,500	4.38
社債券		3,403,763,000	4.46
	内 日本	3,403,763,000	4.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		605,165,204	0.79
純資産総額		76,259,044,044	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成30年6月29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	130 5年国債	日本	国債証券	980,000,000	100.87 988,563,200	100.76 987,506,800	0.100000 2021/12/20	1.29
2	124 5年国債	日本	国債証券	980,000,000	100.57 985,668,000	100.44 984,341,400	0.100000 2020/06/20	1.29
3	131 5年国債	日本	国債証券	920,000,000	100.94 928,700,300	100.82 927,544,000	0.100000 2022/03/20	1.22
4	126 5年国債	日本	国債証券	890,000,000	100.71 896,404,200	100.55 894,957,300	0.100000 2020/12/20	1.17
5	129 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.87 887,669,300	100.71 886,248,000	0.100000 2021/09/20	1.16
6	125 5年国債	日本	国債証券	860,000,000	100.65 865,643,600	100.50 864,300,000	0.100000 2020/09/20	1.13
7	349 10年国債	日本	国債証券	850,000,000	100.51 854,384,600	100.80 856,825,500	0.100000 2027/12/20	1.12
8	334 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	104.36 834,906,000	104.10 832,864,000	0.600000 2024/06/20	1.09
9	343 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.94 807,564,850	101.11 808,944,000	0.100000 2026/06/20	1.06
10	335 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	103.91 810,572,800	103.62 808,275,000	0.500000 2024/09/20	1.06
11	339 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	103.33 806,013,000	103.25 805,381,200	0.400000 2025/06/20	1.06
12	340 10年国債	日本	国債証券	770,000,000	103.43 796,471,800	103.33 795,679,500	0.400000 2025/09/20	1.04
13	342 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.02 787,966,700	101.16 789,055,800	0.100000 2026/03/20	1.03
14	127 5年国債	日本	国債証券	780,000,000	100.77 786,049,800	100.61 784,773,600	0.100000 2021/03/20	1.03
15	128 5年国債	日本	国債証券	755,000,000	100.80 761,088,400	100.67 760,058,500	0.100000 2021/06/20	1.00
16	346 10年国債	日本	国債証券	750,000,000	100.80 756,052,000	100.95 757,192,500	0.100000 2027/03/20	0.99
17	123 5年国債	日本	国債証券	730,000,000	100.55 734,052,900	100.38 732,817,800	0.100000 2020/03/20	0.96
18	312 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	103.74 726,191,000	103.28 722,960,000	1.200000 2020/12/20	0.95

19	333 10年国債	日本	国債証券	640,000,000	104.28 667,448,600	103.96 665,363,200	0.600000 2024/03/20	0.87
20	350 10年国債	日本	国債証券	650,000,000	100.67 654,359,800	100.72 654,719,000	0.100000 2028/03/20	0.86
21	344 10年国債	日本	国債証券	640,000,000	100.92 645,932,200	101.07 646,854,400	0.100000 2026/09/20	0.85
22	122 5年国債	日本	国債証券	630,000,000	100.50 633,162,600	100.33 632,129,400	0.100000 2019/12/20	0.83
23	348 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	100.62 603,768,800	100.87 605,250,000	0.100000 2027/09/20	0.79
24	345 10年国債	日本	国債証券	590,000,000	100.86 595,083,000	101.01 596,000,300	0.100000 2026/12/20	0.78
25	132 5年国債	日本	国債証券	580,000,000	100.98 585,728,700	100.85 584,964,800	0.100000 2022/06/20	0.77
26	328 10年国債	日本	国債証券	550,000,000	103.64 570,073,200	103.36 568,507,500	0.600000 2023/03/20	0.75
27	135 5年国債	日本	国債証券	550,000,000	101.06 555,843,200	101.01 555,604,500	0.100000 2023/03/20	0.73
28	133 5年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.97 555,344,000	100.91 555,010,500	0.100000 2022/09/20	0.73
29	121 5年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.44 552,469,500	100.28 551,540,000	0.100000 2019/09/20	0.72
30	383 2年国債	日本	国債証券	530,000,000	100.46 532,465,500	100.34 531,812,600	0.100000 2019/12/15	0.70

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	84.58%
地方債証券	5.78%
特殊債券	4.38%
社債券	4.46%
合計	99.21%

(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30年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		96,796,395,401	95.65
	内 香港	1,351,841,880	1.34
	内 シンガポール	460,335,637	0.45
	内 イスラエル	204,203,786	0.20
	内 ノルウェー	289,668,989	0.29
	内 スウェーデン	991,138,517	0.98
	内 デンマーク	651,489,268	0.64
	内 イギリス	6,961,742,900	6.88
	内 アイルランド	213,411,632	0.21
	内 オランダ	1,397,093,384	1.38
	内 ベルギー	418,510,391	0.41
	内 フランス	4,140,291,537	4.09
	内 ドイツ	3,707,337,798	3.66
	内 スイス	3,026,738,692	2.99
	内 ポルトガル	58,801,283	0.06
	内 スペイン	1,191,315,698	1.18
	内 イタリア	940,648,231	0.93
	内 フィンランド	403,374,545	0.40
	内 オーストリア	90,963,452	0.09
	内 カナダ	3,769,542,407	3.72
	内 アメリカ	63,989,641,166	63.23
	内 オーストラリア	2,454,895,140	2.43
	内 ニュージーランド	82,772,280	0.08
	内 非上場	636,788	0.00
投資証券		2,545,765,273	2.52
	内 香港	75,500,490	0.07
	内 シンガポール	40,567,972	0.04

	内 イギリス	86,895,883	0.09
	内 フランス	146,686,805	0.14
	内 カナダ	17,953,033	0.02
	内 アメリカ	1,886,506,115	1.86
	内 オーストラリア	291,654,975	0.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,856,190,589	1.83
純資産総額		101,198,351,263	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		2,059,202,681	2.03
	内 アメリカ	2,059,202,681	2.03
為替予約取引（買建）		894,888,000	0.88
	内 日本	894,888,000	0.88

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

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

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

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

(2) 投資資産（平成30年6月29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	125,000	18,761.06 2,345,147,000	20,505.17 2,563,146,250	2.53
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	179,400	9,284.36 1,665,620,224	10,902.56 1,955,919,300	1.93
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	10,070	130,791.14 1,317,066,922	188,078.28 1,893,948,310	1.87
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	58,600	19,382.63 1,135,823,648	21,691.26 1,271,108,082	1.26
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	84,520	11,507.65 972,633,324	11,598.96 980,344,285	0.97

6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,687	113,493.96 872,428,645	123,165.87 946,776,110	0.94
7	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	103,855	9,072.68 942,252,969	9,060.96 941,026,395	0.93
8	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	7,260	115,050.03 835,263,995	124,554.26 904,263,936	0.89
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	65,750	15,389.59 1,011,867,905	13,485.88 886,696,610	0.88
10	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	241,301	3,142.98 758,419,605	3,169.18 764,726,738	0.76
11	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	113,972	6,271.04 714,731,153	5,928.26 675,655,672	0.67
12	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	77,800	9,362.04 728,369,078	8,460.14 658,199,203	0.65
13	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	46,768	12,984.24 607,249,997	13,890.45 649,628,865	0.64
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	44,200	12,219.86 540,121,311	14,673.07 648,550,118	0.64
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	31,300	21,097.22 660,345,201	20,680.92 647,313,065	0.64
16	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	23,626	24,667.99 582,807,545	27,071.24 639,585,258	0.63
17	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	176,891	3,914.55 692,461,207	3,558.28 629,428,167	0.62
18	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	114,000	4,893.38 557,851,053	5,444.09 620,626,830	0.61
19	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	28,450	19,629.25 558,453,386	21,578.51 613,908,706	0.61
20	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	145,163	4,001.54 580,889,439	4,019.23 583,444,123	0.58
21	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	120,400	4,174.54 502,625,667	4,746.58 571,489,147	0.56
22	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	100,454	5,513.95 553,901,249	5,622.06 564,758,857	0.56
23	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	61,817	9,822.14 607,181,481	8,627.64 533,335,255	0.53

24	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	497,700	1,072.56 533,880,102	1,026.29 510,789,420	0.50
25	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・サービス	13,790	30,293.48 417,747,937	36,992.21 510,122,590	0.50
26	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	22,900	16,574.36 379,553,460	21,787.43 498,932,239	0.49
27	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	64,473	8,292.60 534,648,969	7,392.91 476,643,422	0.47
28	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	98,600	5,022.60 495,231,680	4,805.17 473,790,137	0.47
29	NETFLIX INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	10,650	21,620.40 230,258,026	43,709.72 465,508,590	0.46
30	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	55,350	9,249.27 511,950,427	8,029.92 444,456,603	0.44

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	95.65%
投資証券	2.52%
合計	98.17%

(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	7.15%
素材	4.77%
資本財・サービス	9.95%
一般消費財・サービス	11.83%
生活必需品	8.12%
ヘルスケア	12.34%
金融	16.90%
情報技術	18.72%
電気通信サービス	2.33%
公益事業	3.00%
不動産	0.55%
合計	95.65%

(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 E-MINI FUTURE 2018年9月	買建	137	2,089,253,422	2,059,202,681	2.03%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年7月	買建	8,100,000	890,630,840	894,888,000	0.88%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成30年6月29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		162,028,014,264	98.26
	内 ユーロ	64,913,160,853	39.37
	内 シンガポール	655,767,736	0.40
	内 マレーシア	790,570,080	0.48
	内 ノルウェー	383,003,836	0.23
	内 スウェーデン	614,866,295	0.37
	内 デンマーク	966,531,331	0.59
	内 イギリス	11,299,484,341	6.85
	内 スイス	213,161,873	0.13
	内 ポーランド	1,009,390,658	0.61
	内 カナダ	3,370,434,671	2.04
	内 アメリカ	72,179,290,615	43.77
	内 メキシコ	1,282,777,702	0.78

	内　南アフリカ	911,665,167	0.55
	内　オーストラリア	3,437,909,106	2.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,869,188,092	1.74
純資産総額		164,897,202,356	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		1,582,898,110	0.96
	内　日本	1,582,898,110	0.96

(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30年6月29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	6,300,000	99.21 690,928,611	99.14 690,468,654	2.750000 2028/02/15	0.42
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	99.30 690,142,108	97.07 674,658,103	2.000000 2022/11/30	0.41
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,084,000	161.87 638,540,593	161.38 636,602,851	4.500000 2041/04/25	0.39
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	98.95 647,657,639	96.78 633,438,748	2.250000 2024/11/15	0.38
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	99.47 642,170,899	96.20 621,041,929	2.250000 2025/11/15	0.38
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	98.80 644,385,855	95.17 620,691,938	2.250000 2027/08/15	0.38
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	98.87 632,607,707	95.71 612,357,863	2.125000 2025/05/15	0.37
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,029,000	94.47 629,631,201	91.50 609,844,430	1.625000 2026/05/15	0.37
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	99.92 629,630,644	96.32 606,891,129	2.375000 2027/05/15	0.37

10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	98.14 623,023,359	95.12 603,883,198	2.000000 2025/02/15	0.37
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	97.81 620,941,112	94.75 601,547,019	2.000000 2025/08/15	0.36
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,807,000	165.97 595,904,281	164.84 591,861,452	5.750000 2032/10/25	0.36
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,697,000	125.56 593,752,233	123.25 582,847,545	4.250000 2023/10/25	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	97.55 593,090,100	95.07 577,997,079	2.250000 2027/11/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	103.05 595,666,197	99.91 577,516,568	2.750000 2024/02/15	0.35
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	97.03 589,968,008	93.73 569,874,599	2.000000 2026/11/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,340,000	97.83 577,496,060	95.42 563,301,736	2.250000 2027/02/15	0.34
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	93.28 577,431,777	90.32 559,102,476	1.500000 2026/08/15	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,162,000	100.73 574,795,738	97.64 557,186,792	2.375000 2024/08/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	103.16 572,582,215	100.00 555,021,340	2.750000 2023/11/15	0.34
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,025,000	144.56 559,352,380	142.37 550,869,037	6.000000 2025/10/25	0.33
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	94.68 561,643,174	91.77 544,358,560	1.625000 2026/02/15	0.33
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,824,000	149.31 539,352,417	149.32 539,374,090	4.000000 2038/10/25	0.33
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,499,000	120.81 540,729,524	120.31 538,460,410	2.750000 2027/10/25	0.33
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,630,000	114.53 531,805,881	112.85 523,977,559	3.000000 2022/04/25	0.32
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,550,000	114.21 518,623,502	112.26 509,768,932	3.250000 2021/10/25	0.31
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	152.28 510,921,541	150.46 504,818,651	5.500000 2029/04/25	0.31
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	126.42 508,756,440	125.08 503,336,046	3.500000 2026/04/25	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	102.19 509,345,348	100.12 499,062,843	2.625000 2020/11/15	0.30

30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	97.96 507,315,150	95.54 494,813,529	1.750000 2023/05/15	0.30

(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	98.26%
合計	98.26%

(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	豪ドル買/円売 2018年7月	買建	238,000	19,401,670	19,308,940	0.01%
		豪ドル買/円売 2018年8月	買建	182,000	14,736,358	14,731,080	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2018年7月	買建	207,000	17,226,951	17,257,590	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2018年8月	買建	177,000	14,734,683	14,731,710	0.01%
		ユーロ買/円売 2018年7月	買建	3,202,000	408,782,127	409,535,800	0.25%
		ユーロ買/円売 2018年8月	買建	2,026,000	259,204,211	259,125,400	0.16%
		南アフリカ・ランド買/円売 2018年7月	買建	1,536,000	12,873,526	12,303,360	0.01%
		英ポンド買/円売 2018年7月	買建	217,000	31,532,877	31,371,690	0.02%
		メキシコ・ペソ買/円売 2018年8月	買建	1,169,000	6,494,496	6,487,950	0.00%

		メキシコ・ペソ買/円売 2018年7月	買建	2,944,000	15,871,398	16,456,960	0.01%
		米ドル買/円売 2018年8月	買建	2,551,000	281,292,647	281,247,750	0.17%
		米ドル買/円売 2018年7月	買建	4,018,000	439,755,329	443,989,000	0.27%
		南アフリカ・ランド買/円売 2018年8月	買建	946,000	7,534,322	7,530,160	0.00%
		英ポンド買/円売 2018年8月	買建	338,000	48,835,963	48,820,720	0.03%

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

(注2) 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

●ダイワライフスタイル75

2018年6月29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	14,597円
純資産総額	9.5億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.4%
3カ月間	1.3%
6カ月間	-3.0%
1年間	6.4%
3年間	8.8%
5年間	48.9%
設定来	46.0%

※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	第18期 17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

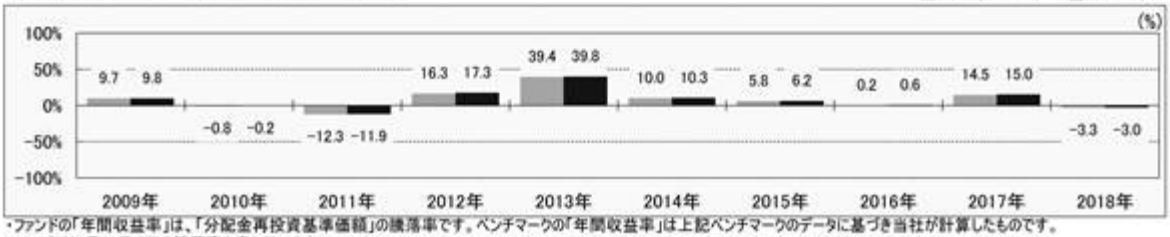
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	1,499	59.6%	日本円	79.9%	直接利回り(%)	1.2	トヨタ自動車	日本	2.1%
国内債券	359	20.0%	米ドル	12.3%	最終利回り(%)	0.5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.0%
外国株式・先物	1,254	14.6%	ユーロ	3.9%	修正デュレーション	8.7	ソニー	日本	0.9%
外国債券	772	5.0%	英ポンド	1.4%	残存年数	9.9	ソフトバンクグループ	日本	0.8%
外国リート	62	0.4%	カナダ・ドル	0.7%	債券格付別構成	比率	日本電信電話	日本	0.8%
外国投資証券	6	0.0%	豪ドル	0.5%	AAA	86.6%	三井住友フィナンシャルG	日本	0.8%
			スイス・フラン	0.5%	AA	6.0%	キーエンス	日本	0.7%
			香港ドル	0.2%	A	4.7%	本田技研	日本	0.7%
			スウェーデン・クローネ	0.2%	BBB	0.3%	KDDI	日本	0.6%
コール・ローン、その他		1.2%	その他	0.4%	BB以下・無格付	2.4%	みずほフィナンシャルG	日本	0.6%
合計	3,952	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		9.2%

※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2.4%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。
・2018年は6月29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18期計算期間（平成28年12月1日から平成29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】

【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17期 平成28年11月30日現在	第18期 平成29年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,783,354	7,412,269
親投資信託受益証券	758,192,614	934,617,626
未収入金	1,165,000	－
流動資産合計	765,140,968	942,029,895
資産合計	765,140,968	942,029,895
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,382,270	394,867
未払受託者報酬	301,443	378,916
未払委託者報酬	3,090,274	3,884,383
その他未払費用	28,174	35,429
流動負債合計	4,802,161	4,693,595
負債合計	4,802,161	4,693,595
純資産の部		
元本等		
元本	※1 598,654,336	※1 631,550,724
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	161,684,471	305,785,576
（分配準備積立金）	181,305,000	273,110,882
元本等合計	760,338,807	937,336,300
純資産合計	760,338,807	937,336,300
負債純資産合計	765,140,968	942,029,895

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期 自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30日	第18期 自　平成28年12月1日 至　平成29年11月30日
営業収益		
受取利息	367	―
有価証券売買等損益	△ 19,217,489	140,217,012
営業収益合計	△ 19,217,122	140,217,012
営業費用		
支払利息	1,122	2,416
受託者報酬	599,610	722,642
委託者報酬	6,146,995	7,407,971
その他費用	56,056	67,574
営業費用合計	6,803,783	8,200,603
営業利益又は営業損失（△）	△ 26,020,905	132,016,409
経常利益又は経常損失（△）	△ 26,020,905	132,016,409
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 26,020,905	132,016,409
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（△）	△ 5,385,025	4,994,817
期首剰余金又は期首欠損金（△）	178,581,088	161,684,471
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,135,311	33,051,439
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,135,311	33,051,439
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,396,048	15,971,926
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,396,048	15,971,926
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	161,684,471	305,785,576

(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18期 自　平成28年12月1日 至　平成29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17期 平成28年11月30日現在	第18期 平成29年11月30日現在
1.　※1　期首元本額	556,327,779円	598,654,336円
期中追加設定元本額	85,325,672円	91,122,014円
期中一部解約元本額	42,999,115円	58,225,626円
2.　計算期間末日における受益権の総数	598,654,336口	631,550,724口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第17期 自　平成27年12月1日 至　平成28年11月30日	第18期 自　平成28年12月1日 至　平成29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（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。	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（108,260,931円）、投資信託約款に規定される収益調整金（246,370,423円）及び分配準備積立金（164,849,951円）より分配対象額は519,481,305円（1万口当たり8,225.49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18期 自　平成28年12月1日 至　平成29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18期 平成29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17期 平成28年11月30日現在	第18期 平成29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	△17,476,975	134,810,851
合計	△17,476,975	134,810,851

（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17期 平成28年11月30日現在	第18期 平成29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18期 自　平成28年12月1日 至　平成29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17期 平成28年11月30日現在	第18期 平成29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）	1.2701円 (12,701円)	1.4842円 (14,842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	505,576,948	562,707,143	
	日本債券インデックスマザーファンド	133,032,170	185,406,935	
	外国株式インデックスマザーファンド	58,671,546	140,172,190	
	外国債券インデックスマザーファンド	16,502,710	46,331,358	
親投資信託受益証券　合計			934,617,626	
合計			934,617,626	

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28年11月30日現在	平成29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		3,916,751,366	5,276,595,266
株式	※3※4	124,953,943,460	141,293,259,400
派生商品評価勘定		97,126,795	81,277,080
未収入金		167,906,640	―
未収配当金		712,518,080	779,613,672
未収利息		331,370	327,444
その他未収収益	※5	14,507,257	9,771,083
流動資産合計		129,863,084,968	147,440,843,945
資産合計		129,863,084,968	147,440,843,945
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		―	1,080
前受金		90,505,000	69,750,000
未払金		129,912,360	452,160
未払解約金		254,683,100	254,453,100
受入担保金		3,158,133,625	3,958,464,457
流動負債合計		3,633,234,085	4,283,120,797
負債合計		3,633,234,085	4,283,120,797
純資産の部			
元本等			
元本	※1	141,237,185,956	128,627,233,302
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△15,007,335,073	14,530,489,846
元本等合計		126,229,850,883	143,157,723,148
純資産合計		126,229,850,883	143,157,723,148
負債純資産合計		129,863,084,968	147,440,843,945

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28年12月1日 至　平成29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28年11月30日現在	平成29年11月30日現在
1．※1　期首	平成27年12月1日	平成28年12月1日
期首元本額	140,709,507,157円	141,237,185,956円
期中追加設定元本額	15,352,397,205円	15,344,235,430円
期中一部解約元本額	14,824,718,406円	27,954,188,084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	1,610,341,359円	－円
トピックス・インデックスファンド	5,648,730,568円	4,364,412,056円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	13,687,983,821円	11,109,078,226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	126,646,485円	63,469,755円	
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	141,686,038円	80,019,243円	
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	2,353,118,777円	1,411,218,462円	
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	109,845,953円	70,073,352円	
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	3,368,030,339円	1,949,560,771円	
Ｄ－Ｉ's　ＴＯＰＩＸインデックス	33,491,212円	28,367,467円	
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	27,594,657円	25,160,362円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	593,766円	571,628円	
ｉＦｒｅｅ　ＴＯＰＩＸインデックス	111,764,976円	294,793,376円	
ｉＦｒｅｅ　８資産バランス	68,977,995円	624,779,967円	
ＤＣダイワ日本株式インデックス	63,783,051,530円	60,695,276,446円	
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,368,199,277円	2,195,311,787円	
ダイワ・ライフ・バランス５０	2,389,384,337円	2,320,693,161円	
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,140,568,498円	2,181,670,247円	
年金ダイワ日本株式インデックス	3,836,869,470円	4,033,420,970円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	23,808,674円	17,249,227円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	61,017,840円	51,964,735円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,636,946円	13,124,314円	
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	448,097円	364,602円	

ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	440,730円	362,318円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	941,908円	690,983円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	63,672,333円	6,930,943円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	353,729,673円	19,322,872円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	196,965,786円	15,921,448円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	1,442,476,447円	359,581,980円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	229,813,057円	168,953,117円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	14,465,411,230円	11,001,597,589円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	384,828,380円	227,225,197円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	659,950,624円	239,347,643円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,178,011,578円	895,003,489円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	182,365,011円	144,200,065円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	313,206,367円	242,040,229円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	45,419,513円	70,307,122円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	1,350,529,038円	5,865,224,891円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	－円	4,249,531円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	－円	1,175,567,763円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,024,916,082円	1,188,177,701円
ダイワライフスタイル２５	206,988,834円	176,027,159円

ダイワライフスタイル５０	678,795,303円	628,315,358円
ダイワライフスタイル７５	513,159,508円	505,576,948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）	16,040,773,939円	14,162,028,802円
計	141,237,185,956円	128,627,233,302円
2. 期末日における受益権の総数	141,237,185,956口	128,627,233,302口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は15,007,335,073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 3,009,650,890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 3,819,839,950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 664,900,000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 704,400,000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13,416,400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8,686,485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28年12月1日 至 平成29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29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

	平成28年11月30日現在	平成29年11月30日現在

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	12,782,821,308	9,624,573,051
合計	12,782,821,308	9,624,573,051

（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28年9月21日から平成28年11月30日まで、及び平成29年9月20日から平成29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28年11月30日 現在				平成29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	1,082,030,000	－	1,179,200,000	97,170,000	1,715,670,000	－	1,797,000,000	81,330,000
合計	1,082,030,000	－	1,179,200,000	97,170,000	1,715,670,000	－	1,797,000,000	81,330,000

（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28年11月30日現在	平成29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）	0.8937円 (8,937円)	1.1130円 (11,130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	3,800	3,850.00	14,630,000	貸付株式数　1,000株
日本水産	70,100	614.00	43,041,400	
マルハニチロ	11,700	3,230.00	37,791,000	
カネコ種苗	5,400	1,683.00	9,088,200	
サカタのタネ	9,300	3,715.00	34,549,500	
ホクト	6,500	2,018.00	13,117,000	貸付株式数　1,800株
ショーボンドＨＤ	5,800	7,120.00	41,296,000	
ミライト・ホールディングス	18,900	1,503.00	28,406,700	
タマホーム	10,300	710.00	7,313,000	貸付株式数　2,900株
インベスターズクラウド	1,200	6,660.00	7,992,000	貸付株式数　300株
日鉄鉱業	1,800	7,670.00	13,806,000	
三井松島	5,000	1,393.00	6,965,000	
国際石油開発帝石	297,900	1,265.00	376,843,500	
日本海洋掘削	3,500	2,351.00	8,228,500	貸付株式数　900株 (700株)
石油資源開発	8,600	2,573.00	22,127,800	貸付株式数　2,400株
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,000	1,948.00	7,792,000	
安藤・間	47,900	887.00	42,487,300	貸付株式数　13,200株
東急建設	24,300	1,085.00	26,365,500	
コムシスホールディングス	21,300	3,135.00	66,775,500	
ミサワホーム	7,500	994.00	7,455,000	
高松コンストラクションＧＰ	4,000	2,896.00	11,584,000	
東建コーポレーション	2,400	14,090.00	33,816,000	
ヤマウラ	8,300	877.00	7,279,100	
大成建設	63,100	5,900.00	372,290,000	
大　林　組	185,700	1,452.00	269,636,400	
清水建設	190,100	1,247.00	237,054,700	
飛島建設	74,800	162.00	12,117,600	
長谷工コーポレーシヨン	72,000	1,743.00	125,496,000	
松井建設	8,700	952.00	8,282,400	貸付株式数　100株
鹿島建設	272,000	1,179.00	320,688,000	
不動テトラ	55,000	184.00	10,120,000	
鉄建建設	3,900	3,360.00	13,104,000	
西松建設	14,000	3,255.00	45,570,000	

三井住友建設	45,200	640.00	28,928,000	
大豊建設	24,000	580.00	13,920,000	
前田建設	44,000	1,651.00	72,644,000	
奥　村　組	9,600	4,565.00	43,824,000	
東鉄工業	7,300	3,675.00	26,827,500	
淺沼組	26,000	397.00	10,322,000	
戸田建設	72,000	896.00	64,512,000	
熊　谷　組	9,700	3,125.00	30,312,500	
北野建設	19,000	411.00	7,809,000	
三井ホーム	11,000	683.00	7,513,000	
矢作建設	10,200	992.00	10,118,400	
ピーエス三菱	10,900	884.00	9,635,600	
日本ハウスＨＬＤＧＳ	15,100	623.00	9,407,300	貸付株式数　3,100株
大東建託	22,400	20,545.00	460,208,000	貸付株式数　6,200株
新日本建設	8,500	938.00	7,973,000	
ＮＩＰＰＯ	13,000	2,657.00	34,541,000	
東亜道路	1,700	4,605.00	7,828,500	
前田道路	18,000	2,533.00	45,594,000	
日本道路	1,700	6,750.00	11,475,000	
東亜建設	5,400	3,060.00	16,524,000	
若築建設	4,700	1,752.00	8,234,400	
東洋建設	19,900	626.00	12,457,400	
五洋建設	72,600	837.00	60,766,200	
世紀東急	12,600	604.00	7,610,400	
福　田　組	2,300	6,870.00	15,801,000	
住友林業	39,100	1,930.00	75,463,000	
日本基礎技術	19,000	421.00	7,999,000	
日成ビルド工業	10,000	1,371.00	13,710,000	
巴コーポレーション	21,900	608.00	13,315,200	
大和ハウス	183,000	4,114.00	752,862,000	
ライト工業	11,800	1,248.00	14,726,400	
積水ハウス	200,500	2,094.50	419,947,250	
日特建設	10,300	673.00	6,931,900	
ユアテック	9,900	979.00	9,692,100	
中電工	7,700	3,225.00	24,832,500	
関　電　工	23,900	1,105.00	26,409,500	
きんでん	41,100	1,913.00	78,624,300	
東京エネシス	7,600	1,305.00	9,918,000	
トーエネック	1,900	3,250.00	6,175,000	
住友電設	5,000	2,432.00	12,160,000	

日本電設工業	9,400	2,342.00	22,014,800	
協和エクシオ	21,900	2,698.00	59,086,200	
日本工営	3,800	3,745.00	14,231,000	
九電工	12,200	5,320.00	64,904,000	
三機工業	13,100	1,386.00	18,156,600	
日　揮	52,800	1,951.00	103,012,800	貸付株式数　14,700株
中外炉工業	3,700	2,182.00	8,073,400	
太平電業	4,200	2,649.00	11,125,800	
高砂熱学	17,000	2,092.00	35,564,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	5,700	2,928.00	16,689,600	
明星工業	12,600	806.00	10,155,600	
大　氣　社	7,900	3,770.00	29,783,000	
ダイダン	4,500	3,075.00	13,837,500	
日比谷総合設備	7,100	2,469.00	17,529,900	
東芝プラントシステム	13,300	2,127.00	28,289,100	
日本製粉	17,800	1,657.00	29,494,600	
日清製粉Ｇ本社	67,300	2,196.00	147,790,800	
昭和産業	5,100	2,879.00	14,682,900	
中部飼料	7,200	2,265.00	16,308,000	
フィード・ワン	42,900	286.00	12,269,400	
東洋精糖	8,600	1,206.00	10,371,600	
三井製糖	4,500	4,600.00	20,700,000	
塩水港精糖	32,100	266.00	8,538,600	
日新製糖	3,400	2,132.00	7,248,800	
Ｌｉｆｕｌｌ	19,200	919.00	17,644,800	
ジェイエイシーリクルートメント	4,800	2,269.00	10,891,200	貸付株式数　1,300株
日本M&Aセンター	18,500	5,610.00	103,785,000	
タケエイ	7,000	1,307.00	9,149,000	貸付株式数　1,900株
トラスト・テック	2,800	3,870.00	10,836,000	
コシダカホールディングス	3,000	4,925.00	14,775,000	
パソナグループ	5,100	1,728.00	8,812,800	貸付株式数　1,400株 (1,400株)
ＣＤＳ	6,300	1,334.00	8,404,200	
リンクアンドモチベーション	11,100	888.00	9,856,800	貸付株式数　2,900株 (2,800株)
ＧＣＡ	7,200	1,118.00	8,049,600	貸付株式数　2,100株
エス・エム・エス	10,600	3,590.00	38,054,000	貸付株式数　2,900株
パーソルホールディングス	48,900	2,628.00	128,509,200	貸付株式数　13,600株
リニカル	4,200	1,545.00	6,489,000	貸付株式数　1,100株

クックパッド	17,400	670.00	11,658,000	貸付株式数	5,000株
森永製菓	13,100	5,630.00	73,753,000		
江崎グリコ	15,500	5,550.00	86,025,000		
不　二　家	4,300	2,587.00	11,124,100		
山崎製パン	45,100	2,166.00	97,686,600	貸付株式数	12,400株
モロゾフ	1,500	7,470.00	11,205,000		
亀田製菓	3,600	5,350.00	19,260,000	貸付株式数	1,000株
寿スピリッツ	5,600	5,420.00	30,352,000	貸付株式数	1,500株
カルビー	25,300	3,925.00	99,302,500	貸付株式数	7,200株 (600株)
森永乳業	11,200	4,590.00	51,408,000		
六甲バター	3,400	2,720.00	9,248,000		
ヤクルト	33,300	8,760.00	291,708,000	貸付株式数	9,300株 (9,300株)
明治ホールディングス	36,700	9,780.00	358,926,000		
雪印メグミルク	13,500	3,120.00	42,120,000		
プリマハム	39,000	781.00	30,459,000		
日本ハム	48,000	2,757.00	132,336,000		
丸大食品	32,000	496.00	15,872,000	貸付株式数	2,000株
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	3,900	4,830.00	18,837,000	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	35,800	1,016.00	36,372,800		
スタジオアリス	3,200	2,622.00	8,390,400		
シミックホールディングス	4,800	1,690.00	8,112,000		
システナ	4,700	3,995.00	18,776,500	貸付株式数	1,300株
デジタルアーツ	2,900	4,865.00	14,108,500	貸付株式数	500株
新日鉄住金ＳＯＬ	8,600	2,902.00	24,957,200		
綜合警備保障	21,100	6,230.00	131,453,000		
キューブシステム	8,100	803.00	6,504,300		
いちご	77,900	416.00	32,406,400	貸付株式数	21,700株
日本駐車場開発	75,500	165.00	12,457,500		
コア	3,200	1,620.00	5,184,000		
カカクコム	41,300	1,774.00	73,266,200	貸付株式数	11,400株
ディップ	7,800	2,916.00	22,744,800		
オプトホールディング	5,800	1,323.00	7,673,400	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ツクイ	14,300	919.00	13,141,700	貸付株式数	3,900株
エムスリー	55,900	3,690.00	206,271,000		
アウトソーシング	16,100	1,972.00	31,749,200	貸付株式数	4,400株
ウェルネット	5,700	1,210.00	6,897,000	貸付株式数	1,600株

ワールドホールディングス	2,000	2,904.00	5,808,000	貸付株式数 500株
ディー・エヌ・エー	28,700	2,545.00	73,041,500	
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	73,400	1,509.00	110,760,600	
ぐるなび	8,800	1,368.00	12,038,400	貸付株式数 2,400株
ファンコミュニケーションズ	15,100	973.00	14,692,300	貸付株式数 1,200株
ＷＤＢホールディングス	3,000	3,175.00	9,525,000	
ティア	10,300	988.00	10,176,400	
バリューコマース	7,600	770.00	5,852,000	
インフォマート	28,200	682.00	19,232,400	貸付株式数 7,900株
サッポロホールディングス	20,500	3,515.00	72,057,500	
アサヒグループホールディン	116,700	5,707.00	666,006,900	
キリンＨＤ	266,700	2,629.50	701,287,650	
宝ホールディングス	45,500	1,257.00	57,193,500	
オエノンホールディングス	31,100	355.00	11,040,500	
コカ・コーラボトラーズＪ	39,200	4,265.00	167,188,000	
サントリー食品インター	42,600	4,860.00	207,036,000	
ダイドーグループＨＤ	2,900	5,790.00	16,791,000	
伊　藤　園	18,400	4,180.00	76,912,000	貸付株式数 5,200株
キーコーヒー	6,800	2,147.00	14,599,600	
日清オイリオグループ	6,600	3,455.00	22,803,000	
不二製油グループ	15,100	3,265.00	49,301,500	
Ｊ－オイルミルズ	3,200	4,030.00	12,896,000	
ローソン	13,700	7,740.00	106,038,000	貸付株式数 4,800株
サンエー	4,200	5,190.00	21,798,000	
カワチ薬品	4,500	2,800.00	12,600,000	
エービーシー・マート	9,700	6,160.00	59,752,000	貸付株式数 2,700株
ハードオフコーポレーション	6,500	1,269.00	8,248,500	
アスクル	5,800	3,130.00	18,154,000	貸付株式数 1,600株
ゲオホールディングス	10,400	2,277.00	23,680,800	貸付株式数 2,800株
アダストリア	8,400	2,485.00	20,874,000	
くらコーポレーション	3,300	5,240.00	17,292,000	
エレマテック	2,900	2,635.00	7,641,500	
パルグループＨＬＤＧＳ	3,000	3,465.00	10,395,000	
ＪＡＬＵＸ	2,600	2,839.00	7,381,400	
エディオン	20,600	1,261.00	25,976,600	貸付株式数 8,800株
あらた	2,800	5,900.00	16,520,000	

サーラコーポレーション	10,800	691.00	7,462,800	貸付株式数	3,000株 (3,000株)
ワッツ	5,800	1,180.00	6,844,000		
ハローズ	2,500	2,598.00	6,495,000		
ＪＰホールディングス	19,700	352.00	6,934,400	貸付株式数	6,100株 (2,000株)
あみやき亭	2,200	5,060.00	11,132,000		
東京エレクトロンデバイス	4,100	2,053.00	8,417,300		
ひらまつ	14,800	560.00	8,288,000	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
フィールズ	5,500	1,269.00	6,979,500	貸付株式数	1,500株
双日	315,000	324.00	102,060,000		
ゲンキー	2,500	4,185.00	10,462,500	貸付株式数	600株 (200株)
アルフレッサホールディングス	59,800	2,412.00	144,237,600		
大黒天物産	1,600	5,260.00	8,416,000		
ハニーズホールディングス	6,800	1,150.00	7,820,000	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
キッコーマン	43,600	4,400.00	191,840,000		
味　の　素	127,600	2,064.00	263,366,400		
キユーピー	31,500	2,885.00	90,877,500		
ハウス食品Ｇ本社	21,400	3,660.00	78,324,000		
カ　ゴ　メ	22,400	4,165.00	93,296,000		
アリアケジャパン	5,100	10,180.00	51,918,000		
ニチレイ	26,500	3,260.00	86,390,000		
横浜冷凍	13,800	1,119.00	15,442,200	貸付株式数	4,000株 (3,900株)
東洋水産	30,200	4,780.00	144,356,000		
日清食品ＨＤ	24,100	8,110.00	195,451,000		
永谷園ホールディングス	8,000	1,389.00	11,112,000		
フジッコ	6,200	2,539.00	15,741,800		
ロックフィールド	6,800	2,073.00	14,096,400		
日本たばこ産業	343,000	3,720.00	1,275,960,000		
ケンコーマヨネーズ	4,200	3,425.00	14,385,000	貸付株式数	100株
わらべや日洋ＨＤ	3,900	2,995.00	11,680,500	貸付株式数	1,100株
ユーグレナ	22,000	1,112.00	24,464,000	貸付株式数	6,200株 (6,100株)
片倉工業	7,900	1,305.00	10,309,500		
グ　ン　ゼ	4,400	5,880.00	25,872,000		

ヒューリック	114,200	1,231.00	140,580,200	
山下医科器械	5,600	1,735.00	9,716,000	
アルペン	4,500	2,297.00	10,336,500	
クオール	5,900	2,149.00	12,679,100	
アルコニックス	6,500	2,150.00	13,975,000	貸付株式数 1,900株
神戸物産	3,600	5,100.00	18,360,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
ジンズ	3,700	5,760.00	21,312,000	貸付株式数 1,000株
ビックカメラ	31,600	1,432.00	45,251,200	貸付株式数 8,900株 (8,900株)
ＤＣＭホールディングス	27,900	1,085.00	30,271,500	貸付株式数 9,100株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	3,000	7,040.00	21,120,000	貸付株式数 800株 (800株)
ＭｏｎｏｔａＲＯ	19,600	3,190.00	62,524,000	貸付株式数 5,600株
あい　ホールディングス	7,900	2,673.00	21,116,700	貸付株式数 2,200株
ディーブイエックス	4,700	1,376.00	6,467,200	
アークランドサービスＨＤ	5,000	2,767.00	13,835,000	貸付株式数 1,200株
Ｊ．　フロント　リテイリング	65,100	1,895.00	123,364,500	
ドトール・日レスＨＤ	9,900	2,684.00	26,571,600	
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	11,400	9,280.00	105,792,000	
ブロンコビリー	3,500	3,175.00	11,112,500	貸付株式数 900株 (900株)
スタートトゥデイ	53,600	3,425.00	183,580,000	
物語コーポレーション	1,700	9,790.00	16,643,000	貸付株式数 500株
ココカラファイン	5,700	7,000.00	39,900,000	
三越伊勢丹ＨＤ	102,200	1,299.00	132,757,800	
東洋紡	21,200	2,047.00	43,396,400	
ユニチカ	17,800	836.00	14,880,800	
富士紡ホールディングス	3,500	3,485.00	12,197,500	
日清紡ホールディングス	33,700	1,572.00	52,976,400	
倉敷紡績	59,000	343.00	20,237,000	
ダイワボウＨＤ	4,700	4,390.00	20,633,000	
シキボウ	5,500	1,412.00	7,766,000	
日東紡績	8,300	3,370.00	27,971,000	
トヨタ紡織	15,900	2,326.00	36,983,400	
マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	10,300	2,406.00	24,781,800	
ウエルシアＨＤ	14,600	4,810.00	70,226,000	

クリエイトＳＤＨ	8,000	2,928.00	23,424,000		
バイタルＫＳＫＨＤ	10,300	944.00	9,723,200		
ＵＫＣホールディングス	4,400	1,930.00	8,492,000	貸付株式数	900株
ＴＯＫＡＩホールディングス	29,200	873.00	25,491,600		
三洋貿易	3,800	2,468.00	9,378,400		
ウイン・パートナーズ	5,200	1,261.00	6,557,200		
ジョイフル本田	8,900	3,205.00	28,524,500	貸付株式数	2,500株 (2,200株)
鳥貴族	2,400	3,135.00	7,524,000	貸付株式数	700株
ホットランド	4,400	1,491.00	6,560,400	貸付株式数	1,200株
すかいらーく	33,100	1,643.00	54,383,300	貸付株式数	9,400株 (2,800株)
綿半ホールディングス	3,200	2,590.00	8,288,000		
日本毛織	15,900	992.00	15,772,800		
ユナイテッド・スーパーマーケ	18,100	1,149.00	20,796,900		
三栄建築設計	2,700	2,406.00	6,496,200		
野村不動産ＨＬＤＧＳ	36,300	2,588.00	93,944,400		
三重交通グループＨＤ	14,600	476.00	6,949,600		
サムティ	5,200	1,658.00	8,621,600	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本商業開発	4,300	1,657.00	7,125,100	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
プレサンスコーポレーション	7,400	1,394.00	10,315,600		
ユニゾホールディングス	6,400	3,015.00	19,296,000		
日本管理センター	4,800	1,519.00	7,291,200	貸付株式数	1,300株 (700株)
フージャースＨＤ	8,100	1,178.00	9,541,800		
オープンハウス	8,900	5,540.00	49,306,000		
東急不動産ＨＤ	129,800	810.00	105,138,000		
飯田ＧＨＤ	45,000	2,070.00	93,150,000		
帝国繊維	6,600	2,218.00	14,638,800	貸付株式数	1,600株
日本コークス工業	60,600	123.00	7,453,800		
あさひ	5,200	1,378.00	7,165,600	貸付株式数	1,300株
日本調剤	2,000	3,665.00	7,330,000	貸付株式数	500株 (100株)
コスモス薬品	2,700	25,270.00	68,229,000	貸付株式数	700株
シップヘルスケアＨＤ	11,000	3,595.00	39,545,000		
ソフトクリエイトＨＤ	5,400	1,571.00	8,483,400		

セブン＆アイ・ＨＬＤＧＳ	228,400	4,605.00	1,051,782,000	
薬王堂	2,700	3,420.00	9,234,000	貸付株式数 800株
クリエイト・レストランツ・ホール	15,500	1,228.00	19,034,000	貸付株式数 1,300株
ツルハホールディングス	11,000	15,520.00	170,720,000	
サンマルクホールディングス	4,100	3,085.00	12,648,500	
トリドールホールディングス	6,800	3,620.00	24,616,000	
帝　人	46,500	2,420.00	112,530,000	
東　レ	419,600	1,057.00	443,517,200	
ク　ラ　レ	96,600	2,161.00	208,752,600	
旭　化　成	360,500	1,405.00	506,502,500	
サカイ　オーベックス	3,100	2,610.00	8,091,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,100	4,600.00	5,060,000	
宮地エンジニアリングＧ	2,200	2,622.00	5,768,400	
トーカロ	3,900	4,755.00	18,544,500	
アルファＣＯ	2,600	2,299.00	5,977,400	
ＳＵＭＣＯ	50,600	2,823.00	142,843,800	貸付株式数 14,000株
川田テクノロジーズ	1,200	6,240.00	7,488,000	貸付株式数 300株 (300株)
住江織物	2,100	3,075.00	6,457,500	
アツギ	8,300	1,286.00	10,673,800	
コメダホールディングス	10,400	1,945.00	20,228,000	貸付株式数 100株
ダイユー・リックＨＬＤＧＳ	9,100	1,081.00	9,837,100	
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	4,300	6,840.00	29,412,000	貸付株式数 1,200株
ダイニック	7,100	1,189.00	8,441,900	貸付株式数 1,900株
共和レザー	7,300	988.00	7,212,400	
スシローグローバルＨＬＤＧＳ	5,100	3,880.00	19,788,000	
ＬＩＸＩＬビバ	5,300	1,780.00	9,434,000	
セーレン	13,300	2,103.00	27,969,900	
ソトー	9,600	1,126.00	10,809,600	
東海染工	5,500	1,428.00	7,854,000	
小松精練	11,300	901.00	10,181,300	
ワコールホールディングス	15,500	3,480.00	53,940,000	
ホギメディカル	3,600	8,090.00	29,124,000	
ＴＳＩホールディングス	22,300	852.00	18,999,600	
ＴＩＳ	18,100	3,820.00	69,142,000	

電算システム	4,400	2,103.00	9,253,200		
グリー	34,500	731.00	25,219,500		
コーエーテクモＨＤ	9,200	2,307.00	21,224,400		
三菱総合研究所	2,900	3,760.00	10,904,000		
ＫＬａｂ	10,800	1,898.00	20,498,400	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
ポールトゥウィン・ピットクル	5,000	1,829.00	9,145,000	貸付株式数	1,300株
ネクソン	60,900	3,220.00	196,098,000		
アイスタイル	13,600	880.00	11,968,000	貸付株式数	3,800株
エイチーム	4,100	2,847.00	11,672,700	貸付株式数	1,100株
テクノスジャパン	6,400	959.00	6,137,600	貸付株式数	1,700株
コロプラ	17,600	1,156.00	20,345,600	貸付株式数	5,000株 (4,500株)
ブロードリーフ	14,500	1,154.00	16,733,000		
ハーツユナイテッドグループ	3,800	1,847.00	7,018,600		
メディアドゥＨＬＤＧＳ	2,400	2,422.00	5,812,800	貸付株式数	600株
特種東海製紙	3,400	4,020.00	13,668,000		
ティーガイア	5,500	2,452.00	13,486,000		
豆蔵ホールディングス	6,500	1,251.00	8,131,500		
ガンホー・オンライン・エンター	147,900	286.00	42,299,400	貸付株式数	41,400株
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	4,000	8,260.00	33,040,000	貸付株式数	1,300株
インターネットイニシアティブ	9,600	2,188.00	21,004,800	貸付株式数	2,600株
さくらインターネット	7,400	833.00	6,164,200	貸付株式数	2,000株
ＳＲＡホールディングス	3,400	3,490.00	11,866,000		
システムインテグレータ	7,500	859.00	6,442,500		
朝日ネット	17,200	525.00	9,030,000		
コムチュア	4,100	2,499.00	10,245,900	貸付株式数	900株
王子ホールディングス	238,000	683.00	162,554,000		
日本製紙	24,400	2,154.00	52,557,600	貸付株式数	6,800株
三菱製紙	13,100	708.00	9,274,800	貸付株式数	3,100株
北越紀州製紙	31,300	630.00	19,719,000		
中越パルプ	3,400	2,077.00	7,061,800		
大王製紙	22,900	1,501.00	34,372,900	貸付株式数	6,700株 (6,500株)
ｇｕｍｉ	7,100	1,070.00	7,597,000	貸付株式数	1,900株

アカツキ	1,100	7,700.00	8,470,000	貸付株式数 300株
ＬＩＮＥ	15,600	4,790.00	74,724,000	貸付株式数 4,300株
レンゴー	53,200	729.00	38,782,800	
トーモク	4,200	2,108.00	8,853,600	
ザ・パック	4,200	3,770.00	15,834,000	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,000	1,291.00	7,746,000	
マクロミル	7,400	2,913.00	21,556,200	貸付株式数 2,000株
昭和電工	38,600	4,165.00	160,769,000	
住友化学	425,000	782.00	332,350,000	
住友精化	2,400	6,470.00	15,528,000	
日産化学	33,500	4,500.00	150,750,000	
ラサ工業	4,000	2,302.00	9,208,000	貸付株式数 1,100株
クレハ	4,700	7,400.00	34,780,000	
テイカ	4,900	2,939.00	14,401,100	
石原産業	10,600	2,046.00	21,687,600	
日本曹達	39,000	746.00	29,094,000	
東ソー	83,500	2,479.00	206,996,500	
トクヤマ	16,800	3,435.00	57,708,000	
セントラル硝子	11,400	2,495.00	28,443,000	
東亜合成	32,700	1,443.00	47,186,100	
大阪ソーダ	5,300	2,861.00	15,163,300	貸付株式数 1,400株
関東電化	14,000	1,275.00	17,850,000	貸付株式数 200株
デンカ	21,000	4,130.00	86,730,000	
イビデン	33,600	1,787.00	60,043,200	貸付株式数 10,800株
信越化学	96,400	11,765.00	1,134,146,000	
日本カーバイド	2,900	2,071.00	6,005,900	
堺　化　学	3,900	2,532.00	9,874,800	
エア・ウォーター	46,700	2,408.00	112,453,600	
大陽日酸	44,200	1,541.00	68,112,200	
日本化学工業	3,400	2,534.00	8,615,600	
日本パーカライジング	28,700	1,861.00	53,410,700	
高圧ガス	10,600	947.00	10,038,200	
四国化成	8,900	1,841.00	16,384,900	
戸田工業	1,500	4,230.00	6,345,000	貸付株式数 400株
ステラ　ケミファ	3,000	3,730.00	11,190,000	貸付株式数 800株
保土谷化学	1,900	6,610.00	12,559,000	貸付株式数 500株
日本触媒	9,000	7,830.00	70,470,000	
大日精化	4,400	5,380.00	23,672,000	
カネカ	76,000	992.00	75,392,000	

協和発酵キリン	69,200	2,129.00	147,326,800		
三菱瓦斯化学	49,400	3,140.00	155,116,000		
三井化学	52,000	3,625.00	188,500,000		
ＪＳＲ	57,500	2,151.00	123,682,500		
東京応化工業	10,000	4,705.00	47,050,000		
大阪有機化学	4,900	1,321.00	6,472,900		
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	387,300	1,216.00	470,956,800		
ＫＨネオケム	8,900	2,684.00	23,887,600		
ダイセル	76,900	1,331.00	102,353,900		
住友ベークライト	46,000	916.00	42,136,000		
積水化学	119,700	2,171.00	259,868,700		
日本ゼオン	48,500	1,553.00	75,320,500	貸付株式数	14,000株 (14,000株)
アイカ工業	15,800	3,935.00	62,173,000		
宇部興産	28,800	3,255.00	93,744,000		
積水樹脂	9,000	2,307.00	20,763,000		
タキロンシーアイ	14,000	814.00	11,396,000		
旭有機材	5,600	1,839.00	10,298,400		
日立化成	28,100	2,953.00	82,979,300		
ニチバン	3,400	2,963.00	10,074,200		
リケンテクノス	14,300	630.00	9,009,000		
大倉工業	15,000	679.00	10,185,000		
積水化成品	8,000	1,417.00	11,336,000		
群栄化学	2,100	3,745.00	7,864,500		
ダイキョーニシカワ	11,600	1,881.00	21,819,600	貸付株式数	2,500株 (2,500株)
竹本容器	3,500	2,143.00	7,500,500		
日本化薬	36,900	1,702.00	62,803,800		
カーリットホールディングス	15,200	1,100.00	16,720,000	貸付株式数	4,000株
ＥＰＳホールディングス	8,400	2,415.00	20,286,000		
プレステージ・インター	12,200	1,412.00	17,226,400	貸付株式数	3,200株
アミューズ	3,900	3,145.00	12,265,500	貸付株式数	100株
野村総合研究所	36,500	5,080.00	185,420,000		
ドリームインキュベータ	2,600	2,438.00	6,338,800	貸付株式数	200株
クイック	4,200	1,801.00	7,564,200		
ＴＡＣ	23,500	371.00	8,718,500		
ケネディクス	74,000	766.00	56,684,000	貸付株式数	2,600株
電通	64,300	5,080.00	326,644,000	貸付株式数	18,800株 (18,800株)

インテージホールディングス	7,500	1,391.00	10,432,500	
ぴあ	2,000	6,700.00	13,400,000	貸付株式数 500株
イオンファンタジー	1,900	4,890.00	9,291,000	貸付株式数 500株
ネクシィーズグループ	2,500	1,845.00	4,612,500	
日本精化	9,200	1,125.00	10,350,000	
扶桑化学工業	4,200	3,360.00	14,112,000	貸付株式数 1,200株
ＡＤＥＫＡ	23,800	1,896.00	45,124,800	
日油	22,000	3,090.00	67,980,000	
ハリマ化成グループ	6,600	869.00	5,735,400	
花　王	135,900	7,438.00	1,010,824,200	
第一工業製薬	14,000	812.00	11,368,000	貸付株式数 3,000株
三洋化成	3,400	5,920.00	20,128,000	
武田薬品	203,400	6,184.00	1,257,825,600	
アステラス製薬	567,400	1,426.00	809,112,400	
大日本住友製薬	40,800	1,628.00	66,422,400	貸付株式数 11,700株
塩野義製薬	79,000	6,259.00	494,461,000	
田辺三菱製薬	67,100	2,427.00	162,851,700	
あすか製薬	6,700	2,044.00	13,694,800	
日本新薬	14,500	8,040.00	116,580,000	
中外製薬	58,000	5,810.00	336,980,000	
科研製薬	9,800	5,620.00	55,076,000	
エーザイ	66,200	6,371.00	421,760,200	
理研ビタミン	2,300	4,480.00	10,304,000	
ロート製薬	30,500	2,879.00	87,809,500	
小野薬品	141,700	2,559.00	362,610,300	
久光製薬	16,300	6,320.00	103,016,000	
持田製薬	3,800	8,120.00	30,856,000	
参天製薬	104,700	1,712.00	179,246,400	
扶桑薬品	3,700	2,822.00	10,441,400	
日本ケミファ	1,600	4,975.00	7,960,000	
ツムラ	19,800	3,880.00	76,824,000	
日医工	14,300	1,688.00	24,138,400	貸付株式数 3,900株
テ　ル　モ	84,600	5,380.00	455,148,000	
みらかホールディングス	15,300	4,875.00	74,587,500	貸付株式数 4,200株
キッセイ薬品工業	10,100	3,205.00	32,370,500	
生化学工業	11,000	1,627.00	17,897,000	
栄研化学	4,500	5,150.00	23,175,000	
鳥居薬品	3,700	2,963.00	10,963,100	
ＪＣＲファーマ	4,100	4,660.00	19,106,000	

東和薬品	2,700	5,830.00	15,741,000	
富士製薬工業	2,100	4,345.00	9,124,500	
沢井製薬	9,600	5,490.00	52,704,000	貸付株式数　2,600株
ゼリア新薬工業	12,100	2,170.00	26,257,000	
第一三共	157,400	2,708.00	426,239,200	
キョーリン製薬ＨＤ	14,700	2,143.00	31,502,100	
大幸薬品	4,000	2,513.00	10,052,000	貸付株式数　1,100株
ダイト	3,900	3,105.00	12,109,500	
大塚ホールディングス	115,000	4,974.00	572,010,000	
大正製薬ＨＤ	12,300	8,920.00	109,716,000	貸付株式数　3,300株
ペプチドリーム	22,800	3,745.00	85,386,000	貸付株式数　6,300株
大日本塗料	6,900	1,881.00	12,978,900	
日本ペイントＨＯＬＤ	44,700	3,450.00	154,215,000	貸付株式数　12,500株
関西ペイント	60,900	2,949.00	179,594,100	貸付株式数　17,000株
中国塗料	17,400	969.00	16,860,600	
日本特殊塗料	4,200	2,281.00	9,580,200	
藤倉化成	12,400	691.00	8,568,400	
太陽ホールディングス	4,400	5,140.00	22,616,000	
ＤＩＣ	22,500	4,175.00	93,937,500	
サカタインクス	12,000	1,945.00	23,340,000	
東洋インキＳＣホールディン	53,000	650.00	34,450,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5,500	1,346.00	7,403,000	
アルプス技研	2,800	3,775.00	10,570,000	
オリエンタルランド	62,600	9,991.00	625,436,600	
ダスキン	14,200	2,928.00	41,577,600	
パーク２４	29,900	2,768.00	82,763,200	貸付株式数　8,500株
明光ネットワークジャパン	7,800	1,351.00	10,537,800	
ファルコホールディングス	7,100	1,725.00	12,247,500	
クレスコ	1,700	4,830.00	8,211,000	
フジ・メディア・ＨＤ	55,700	1,674.00	93,241,800	貸付株式数　16,100株
ラウンドワン	16,500	1,728.00	28,512,000	
リゾートトラスト	22,600	2,456.00	55,505,600	
オービック	17,300	7,790.00	134,767,000	
ジャストシステム	9,300	2,116.00	19,678,800	
ヤフー	395,700	513.00	202,994,100	貸付株式数　114,100株
ビー・エム・エル	7,200	2,706.00	19,483,200	
トレンドマイクロ	26,500	6,350.00	168,275,000	
りらいあコミュニケーショ	8,900	1,268.00	11,285,200	
リソー教育	10,400	859.00	8,933,600	

日本オラクル	9,000	9,980.00	89,820,000	
フューチャー	9,700	1,237.00	11,998,900	
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,600	1,051.00	7,987,600	
ユー・エス・エス	64,600	2,365.00	152,779,000	
オービックビジネスＣ	3,000	5,680.00	17,040,000	
伊藤忠テクノソリュー	12,500	4,725.00	59,062,500	
アイティフォー	14,000	771.00	10,794,000	
サイバーエージェント	35,100	3,830.00	134,433,000	
楽天	271,700	1,147.50	311,775,750	貸付株式数　1,700株
テー・オー・ダブリュー	9,600	968.00	9,292,800	
大塚商会	16,500	8,400.00	138,600,000	
総合メディカル	2,600	6,050.00	15,730,000	貸付株式数　700株
サイボウズ	15,200	502.00	7,630,400	
セントラルスポーツ	2,400	4,130.00	9,912,000	貸付株式数　700株
パラカ	2,900	2,377.00	6,893,300	貸付株式数　800株
電通国際情報Ｓ	3,800	2,414.00	9,173,200	
デジタルガレージ	10,200	2,891.00	29,488,200	貸付株式数　2,800株
イーエムシステムズ	3,100	2,499.00	7,746,900	
ウェザーニューズ	2,500	3,440.00	8,600,000	貸付株式数　700株 (700株)
ＣＩＪ	13,800	710.00	9,798,000	
WOWOW	3,000	3,230.00	9,690,000	貸付株式数　800株
フルキャストホールディングス	5,200	2,174.00	11,304,800	
富士フイルムＨＬＤＧＳ	114,600	4,582.00	525,097,200	
コニカミノルタ	127,300	1,096.00	139,520,800	
資　生　堂	103,200	5,472.00	564,710,400	
ライオン	77,000	2,094.00	161,238,000	
高砂香料	3,500	3,545.00	12,407,500	
マンダム	10,500	3,795.00	39,847,500	
ミルボン	3,800	8,090.00	30,742,000	
ファンケル	13,700	3,215.00	44,045,500	
コーセー	9,400	17,220.00	161,868,000	
シーズ・ホールディングス	7,800	4,715.00	36,777,000	
ポーラ・オルビスＨＤ	23,900	4,100.00	97,990,000	
ノエビアホールディングス	3,800	7,990.00	30,362,000	
エステー	4,700	2,995.00	14,076,500	
コ　ニ　シ	9,300	2,033.00	18,906,900	
長谷川香料	7,600	2,286.00	17,373,600	
小林製薬	15,200	7,090.00	107,768,000	

荒川化学工業	5,400	2,454.00	13,251,600	
メック	4,500	2,414.00	10,863,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	4,100	2,657.00	10,893,700	
タカラバイオ	14,400	1,492.00	21,484,800	
ＪＣＵ	3,500	5,720.00	20,020,000	
新田ゼラチン	10,300	772.00	7,951,600	貸付株式数 800株
デクセリアルズ	14,200	1,364.00	19,368,800	
アース製薬	4,200	5,790.00	24,318,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
北興化学	10,000	718.00	7,180,000	貸付株式数 2,600株
クミアイ化学	24,900	780.00	19,422,000	貸付株式数 7,300株 (3,700株)
日本農薬	15,000	693.00	10,395,000	貸付株式数 4,200株 (4,200株)
昭和シエル石油	50,900	1,432.00	72,888,800	
ニチレキ	7,900	1,358.00	10,728,200	
ユシロ化学	5,300	1,603.00	8,495,900	
ビーピー・カストロール	3,100	2,176.00	6,745,600	
富士石油	15,500	550.00	8,525,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	3,700	2,082.00	7,703,400	
出光興産	46,000	3,770.00	173,420,000	
ＪＸＴＧホールディングス	876,000	630.00	551,880,000	
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	15,700	3,375.00	52,987,500	
横浜ゴム	31,700	2,516.00	79,757,200	
東洋ゴム	32,700	2,290.00	74,883,000	
ブリヂストン	195,300	5,095.00	995,053,500	
住友ゴム	53,600	2,040.00	109,344,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
藤倉ゴム	7,500	1,013.00	7,597,500	
オカモト	20,000	1,142.00	22,840,000	
アキレス	5,300	2,426.00	12,857,800	
ニッタ	5,700	4,395.00	25,051,500	
住友理工	10,200	1,181.00	12,046,200	
三ツ星ベルト	13,000	1,464.00	19,032,000	
バンドー化学	10,700	1,273.00	13,621,100	
旭　硝　子	56,200	4,680.00	263,016,000	
日本板硝子	27,300	993.00	27,108,900	
有沢製作所	11,200	1,260.00	14,112,000	

日本山村硝子	52,000	189.00	9,828,000	
日本電気硝子	23,800	4,360.00	103,768,000	
住友大阪セメント	107,000	526.00	56,282,000	
太平洋セメント	34,800	4,610.00	160,428,000	
日本ヒユーム	11,800	779.00	9,192,200	
日本コンクリート	16,600	503.00	8,349,800	
アジアパイルＨＤ	10,700	812.00	8,688,400	
東海カーボン	51,100	1,187.00	60,655,700	貸付株式数 14,000株
日本カーボン	3,100	4,385.00	13,593,500	貸付株式数 800株
東洋炭素	4,000	3,590.00	14,360,000	
ノリタケ	3,300	5,170.00	17,061,000	
ＴＯＴＯ	42,500	6,240.00	265,200,000	
日本碍子	66,400	2,145.00	142,428,000	
日本特殊陶業	47,000	2,586.00	121,542,000	
ＭＡＲＵＷＡ	2,000	7,120.00	14,240,000	
品川リフラクトリーズ	2,000	3,390.00	6,780,000	
黒崎播磨	1,300	4,640.00	6,032,000	貸付株式数 300株
ニッカトー	11,700	947.00	11,079,900	
フジミインコーポレーテッド	5,100	2,563.00	13,071,300	
ニチアス	30,000	1,445.00	43,350,000	
新日鐵住金	244,500	2,721.00	665,284,500	
神戸製鋼所	99,800	1,053.00	105,089,400	貸付株式数 28,200株
中山製鋼所	9,100	719.00	6,542,900	
合同製鐵	3,700	2,168.00	8,021,600	貸付株式数 1,000株
ＪＦＥホールディングス	147,600	2,642.00	389,959,200	
日新製鋼	15,100	1,730.00	26,123,000	
東京製鐵	29,400	974.00	28,635,600	
共英製鋼	6,300	2,004.00	12,625,200	貸付株式数 1,800株
大和工業	11,200	3,040.00	34,048,000	
東京鐵鋼	3,700	1,931.00	7,144,700	
大阪製鐵	3,900	2,361.00	9,207,900	
淀川製鋼所	8,000	3,340.00	26,720,000	
東洋鋼鈑	14,900	458.00	6,824,200	
丸一鋼管	19,000	3,170.00	60,230,000	
大同特殊鋼	9,600	6,790.00	65,184,000	
日本高周波	5,700	918.00	5,232,600	
日本冶金工	49,900	222.00	11,077,800	貸付株式数 13,800株
山陽特殊製鋼	6,300	2,850.00	17,955,000	
愛知製鋼	2,800	4,395.00	12,306,000	

日立金属	58,300	1,485.00	86,575,500		
日本金属	1,900	2,539.00	4,824,100		
大平洋金属	3,700	2,937.00	10,866,900	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
新日本電工	34,200	444.00	15,184,800	貸付株式数	10,000株
栗本鉄工所	3,600	2,292.00	8,251,200		
日本製鋼所	18,100	3,600.00	65,160,000		
三菱製鋼	3,800	2,699.00	10,256,200		
日本精線	1,400	5,530.00	7,742,000		
大紀アルミニウム	10,400	795.00	8,268,000		
日本軽金属ＨＤ	156,100	300.00	46,830,000		
三井金属	14,700	6,340.00	93,198,000		
東邦亜鉛	3,200	5,780.00	18,496,000		
三菱マテリアル	35,800	3,750.00	134,250,000	貸付株式数	10,000株
住友鉱山	70,100	4,355.00	305,285,500		
ＤＯＷＡホールディングス	13,800	4,270.00	58,926,000		
古河機金	9,000	2,262.00	20,358,000		
大阪チタニウム	6,300	1,860.00	11,718,000	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
東邦チタニウム	10,800	1,015.00	10,962,000	貸付株式数	3,100株 (200株)
ＵＡＣＪ	8,200	2,910.00	23,862,000	貸付株式数	2,200株
古河電工	18,200	5,940.00	108,108,000	貸付株式数	5,000株
住友電工	203,700	1,958.50	398,946,450		
フジクラ	64,800	1,047.00	67,845,600		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	8,500	998.00	8,483,000		
タツタ電線	11,500	852.00	9,798,000		
リョービ	6,700	2,906.00	19,470,200		
アーレステイ	8,600	921.00	7,920,600		
アサヒＨＤ	9,300	1,981.00	18,423,300		
東洋製罐グループＨＤ	36,400	1,851.00	67,376,400		
ホッカンホールディングス	18,000	458.00	8,244,000		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	10,200	2,375.00	24,225,000		
ＯＳＪＢ　ＨＤ	31,300	329.00	10,297,700	貸付株式数	7,400株
駒井ハルテック	3,100	2,699.00	8,366,900		
三和ホールディングス	52,500	1,481.00	77,752,500		
文化シヤツター	17,600	1,165.00	20,504,000		
三協立山	8,200	1,586.00	13,005,200		
アルインコ	7,500	1,235.00	9,262,500		
ＬＩＸＩＬグループ	80,700	2,955.00	238,468,500		

日本フイルコン	11,700	747.00	8,739,900	
ノーリツ	12,200	2,173.00	26,510,600	
長府製作所	6,600	2,693.00	17,773,800	
リンナイ	9,700	10,070.00	97,679,000	
ユニプレス	10,400	2,972.00	30,908,800	
岡　部	11,700	1,053.00	12,320,100	
ジーテクト	6,200	2,366.00	14,669,200	
東　プ　レ	9,800	3,220.00	31,556,000	
高周波熱錬	11,200	1,170.00	13,104,000	
東京製綱	5,000	1,606.00	8,030,000	貸付株式数　1,300株
パイオラックス	8,400	3,430.00	28,812,000	
エイチワン	4,000	1,595.00	6,380,000	
日本発条	53,000	1,250.00	66,250,000	
三浦工業	23,700	2,872.00	68,066,400	
タ　ク　マ	18,700	1,631.00	30,499,700	
テクノプロ・ホールディング	9,500	5,630.00	53,485,000	
イー・ガーディアン	3,300	2,310.00	7,623,000	貸付株式数　900株
ジャパンマテリアル	5,100	3,330.00	16,983,000	貸付株式数　1,400株 (600株)
ベクトル	7,000	1,566.00	10,962,000	貸付株式数　1,800株
アサンテ	4,300	1,948.00	8,376,400	
Ｎ・フィールド	3,700	1,480.00	5,476,000	貸付株式数　1,200株
Ｍ＆Ａキャピタルパートナー	1,200	7,040.00	8,448,000	
エスクローＡＪ	8,500	602.00	5,117,000	
日本ビューホテル	5,300	1,391.00	7,372,300	
リクルートホールディングス	408,300	2,647.00	1,080,770,100	貸付株式数　107,500株
ツ　ガ　ミ	15,000	1,169.00	17,535,000	貸付株式数　4,000株
オークマ	6,200	7,160.00	44,392,000	
東芝機械	31,000	793.00	24,583,000	
アマダホールディングス	82,900	1,491.00	123,603,900	
アイダエンジニア	13,600	1,365.00	18,564,000	
滝澤鉄工所	4,700	2,125.00	9,987,500	
富士機械製造	16,100	2,187.00	35,210,700	貸付株式数　4,900株
牧野フライス	25,000	1,113.00	27,825,000	貸付株式数　6,000株
オーエスジー	23,900	2,296.00	54,874,400	貸付株式数　7,600株 (7,600株)
旭ダイヤモンド	16,700	1,211.00	20,223,700	

ＤＭＧ森精機	29,800	2,247.00	66,960,600	
ソデイツク	12,200	1,482.00	18,080,400	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
ディスコ	7,400	24,860.00	183,964,000	
日東工器	4,000	2,836.00	11,344,000	
パンチ工業	3,200	2,446.00	7,827,200	
日本郵政	298,000	1,292.00	385,016,000	
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	9,200	1,392.00	12,806,400	貸付株式数 2,800株
ソラスト	3,700	2,687.00	9,941,900	貸付株式数 900株
豊田自動織機	44,700	6,970.00	311,559,000	
豊和工業	3,500	1,550.00	5,425,000	貸付株式数 900株 (900株)
ＯＫＫ	5,100	1,259.00	6,420,900	
石川製作所	1,700	2,930.00	4,981,000	貸付株式数 400株
東洋機械金属	7,000	864.00	6,048,000	
島精機製作所	7,000	7,220.00	50,540,000	
ヤマシンフィルタ	8,500	1,375.00	11,687,500	
日阪製作所	10,300	1,181.00	12,164,300	
やまびこ	10,600	1,694.00	17,956,400	
平田機工	1,600	12,370.00	19,792,000	貸付株式数 400株 (400株)
ナブテスコ	29,800	4,385.00	130,673,000	
三井海洋開発	5,500	2,690.00	14,795,000	
レオン自動機	5,400	1,699.00	9,174,600	
ＳＭＣ	17,300	45,470.00	786,631,000	
ホソカワミクロン	2,100	7,350.00	15,435,000	
ユニオンツール	2,700	4,205.00	11,353,500	
オイレス工業	7,100	2,373.00	16,848,300	
日精エーエスビー	2,000	6,470.00	12,940,000	貸付株式数 500株 (500株)
サトーホールディングス	7,400	3,150.00	23,310,000	
技研製作所	3,000	3,100.00	9,300,000	
日精樹脂工業	5,700	1,711.00	9,752,700	
小松製作所	267,100	3,480.00	929,508,000	
住友重機械	31,200	4,565.00	142,428,000	
日立建機	25,800	3,715.00	95,847,000	
巴工業	4,500	2,166.00	9,747,000	
井関農機	5,500	2,743.00	15,086,500	
ＴＯＷＡ	4,700	2,241.00	10,532,700	

丸山製作所	5,000	2,096.00	10,480,000		
北川鉄工所	3,400	2,903.00	9,870,200		
シンニッタン	9,700	758.00	7,352,600		
ローツェ	3,000	2,681.00	8,043,000	貸付株式数	800株 (200株)
クボタ	297,800	2,120.00	631,336,000		
東洋エンジニア	7,700	1,272.00	9,794,400	貸付株式数	2,100株
三菱化工機	3,200	2,298.00	7,353,600	貸付株式数	100株
月島機械	11,300	1,250.00	14,125,000	貸付株式数	1,400株
帝国電機製作所	6,300	1,443.00	9,090,900		
新東工業	13,400	1,375.00	18,425,000		
渋谷工業	5,000	4,125.00	20,625,000		
アイチ　コーポレーション	9,600	797.00	7,651,200	貸付株式数	2,600株
小森コーポレーション	13,800	1,573.00	21,707,400		
鶴見製作所	4,900	1,820.00	8,918,000		
住友精密	27,000	375.00	10,125,000		
酒井重工業	1,800	4,305.00	7,749,000		
荏原製作所	22,500	4,385.00	98,662,500		
酉島製作所	6,900	1,136.00	7,838,400		
北越工業	7,700	1,191.00	9,170,700		
千代田化工建	38,900	736.00	28,630,400	貸付株式数	12,200株
ダイキン工業	75,600	12,920.00	976,752,000		
オルガノ	2,800	2,931.00	8,206,800		
トーヨーカネツ	2,500	4,190.00	10,475,000	貸付株式数	700株 (700株)
栗田工業	30,000	3,515.00	105,450,000		
椿本チエイン	31,000	891.00	27,621,000		
日　機　装	19,100	1,107.00	21,143,700	貸付株式数	1,000株
新興プランテック	13,000	1,137.00	14,781,000		
アネスト岩田	10,300	1,223.00	12,596,900		
ダイフク	27,500	6,120.00	168,300,000	貸付株式数	7,700株
加藤製作所	2,800	3,095.00	8,666,000		
油研工業	3,500	2,795.00	9,782,500		
タダノ	25,800	1,706.00	44,014,800		
フジテック	17,200	1,699.00	29,222,800		
ＣＫＤ	15,500	2,439.00	37,804,500		
キトー	5,300	1,712.00	9,073,600	貸付株式数	2,200株
平和	16,800	1,938.00	32,558,400	貸付株式数	4,700株 (4,700株)
理想科学工業	5,700	2,143.00	12,215,100		

ＳＡＮＫＹＯ	13,400	3,625.00	48,575,000	
日本金銭機械	6,500	1,129.00	7,338,500	貸付株式数 1,800株
マースエンジニアリング	4,100	2,356.00	9,659,600	
福島工業	3,600	5,250.00	18,900,000	
ダイコク電機	4,200	1,844.00	7,744,800	
竹内製作所	9,100	2,365.00	21,521,500	
ア　マ　ノ	17,000	2,932.00	49,844,000	
ＪＵＫＩ	8,500	1,953.00	16,600,500	
サンデンホールディングス	7,100	2,123.00	15,073,300	
ブラザー工業	67,300	2,776.00	186,824,800	
マックス	8,800	1,573.00	13,842,400	
モリタホールディングス	9,200	2,090.00	19,228,000	
グローリー	16,400	3,990.00	65,436,000	
新晃工業	6,100	2,203.00	13,438,300	
大和冷機工業	10,000	1,251.00	12,510,000	
セガサミーホールディングス	54,700	1,358.00	74,282,600	
日本ピストンリング	3,600	2,246.00	8,085,600	
リ　ケ　ン	2,700	6,040.00	16,308,000	
ＴＰＲ	6,200	3,835.00	23,777,000	
ツバキ・ナカシマ	5,600	2,498.00	13,988,800	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,500	10,690.00	187,075,000	貸付株式数 1,500株
大豊工業	5,100	1,730.00	8,823,000	
日本精工	113,000	1,691.00	191,083,000	貸付株式数 33,100株 (33,100株)
Ｎ　Ｔ　Ｎ	123,100	551.00	67,828,100	
ジェイテクト	57,200	1,929.00	110,338,800	
不　二　越	49,000	706.00	34,594,000	
ミネベアミツミ	102,500	2,215.00	227,037,500	
日本トムソン	19,100	734.00	14,019,400	
Ｔ　Ｈ　Ｋ	34,200	4,105.00	140,391,000	
ユーシン精機	2,900	3,340.00	9,686,000	貸付株式数 800株 (800株)
イーグル工業	6,800	2,027.00	13,783,600	
日本ピラー工業	6,300	1,554.00	9,790,200	
キッツ	24,900	829.00	20,642,100	
日　立	1,324,000	834.20	1,104,480,800	
三菱電機	552,800	1,852.50	1,024,062,000	
富士電機	165,000	792.00	130,680,000	

東洋電機製造	3,500	1,854.00	6,489,000	貸付株式数	900株
安川電機	64,100	4,950.00	317,295,000	貸付株式数	18,200株
シンフォニア　テクノロジー	37,000	433.00	16,021,000		
明　電　舎	47,000	464.00	21,808,000	貸付株式数	14,000株
オリジン電気	4,000	1,731.00	6,924,000		
山洋電気	2,800	8,150.00	22,820,000		
デンヨー	5,400	1,936.00	10,454,400		
三桜工業	9,700	842.00	8,167,400		
マキタ	71,800	4,640.00	333,152,000		
東芝テック	39,000	708.00	27,612,000	貸付株式数	10,000株
マブチモーター	15,200	5,980.00	90,896,000		
日本電産	66,500	15,270.00	1,015,455,000		
東光高岳	3,300	1,841.00	6,075,300		
ダブル・スコープ	8,100	2,226.00	18,030,600	貸付株式数	2,300株 (100株)
ダイヘン	30,000	1,004.00	30,120,000		
ヤーマン	7,400	2,037.00	15,073,800	貸付株式数	2,000株
ＪＶＣケンウッド	43,600	345.00	15,042,000		
第一精工	2,900	2,991.00	8,673,900		
日新電機	13,000	1,352.00	17,576,000		
大崎電気	12,800	794.00	10,163,200		
オムロン	58,700	6,630.00	389,181,000	貸付株式数	100株 (100株)
日東工業	8,900	1,849.00	16,456,100		
ＩＤＥＣ	7,400	2,854.00	21,119,600		
ジーエス・ユアサ　コーポ	97,000	580.00	56,260,000	貸付株式数	27,000株
メルコホールディングス	2,700	3,695.00	9,976,500	貸付株式数	1,000株
日本電気	71,100	3,000.00	213,300,000		
富　士　通	569,000	834.90	475,058,100		
沖　電　気	22,100	1,617.00	35,735,700		
電気興業	3,800	2,890.00	10,982,000		
サンケン電気	33,000	671.00	22,143,000		
アイホン	4,900	1,917.00	9,393,300		
ルネサスエレクトロニクス	29,900	1,373.00	41,052,700		
セイコーエプソン	82,100	2,720.00	223,312,000		
ワコム	43,900	607.00	26,647,300	貸付株式数	15,100株 (15,100株)
アルバック	9,300	7,530.00	70,029,000		
ＥＩＺＯ	5,100	4,785.00	24,403,500		

ジャパンディスプレイ	115,700	199.00	23,024,300	貸付株式数	32,000株 (31,700株)
日本信号	15,200	1,208.00	18,361,600		
京三製作所	17,000	624.00	10,608,000		
能美防災	7,600	2,084.00	15,838,400		
ホーチキ	4,600	2,555.00	11,753,000		
エレコム	4,900	2,553.00	12,509,700		
パナソニック	630,400	1,668.00	1,051,507,200		
アンリツ	40,400	1,070.00	43,228,000		
富士通ゼネラル	17,100	2,381.00	40,715,100		
日立国際電気	10,900	3,190.00	34,771,000	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
ソ　ニ　ー	368,700	5,201.00	1,917,608,700		
Ｔ　Ｄ　Ｋ	28,600	9,170.00	262,262,000		
帝国通信工業	7,100	1,273.00	9,038,300		
タムラ製作所	22,800	809.00	18,445,200		
アルプス電気	47,400	3,575.00	169,455,000		
池上通信機	40,000	181.00	7,240,000		
パイオニア	92,200	218.00	20,099,600	貸付株式数	25,600株
日本電波工業	8,100	784.00	6,350,400	貸付株式数	2,000株
日本トリム	1,400	5,540.00	7,756,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド　ディー. ジー.	3,300	3,180.00	10,494,000		
フオスター電機	6,800	2,935.00	19,958,000		
クラリオン	30,000	436.00	13,080,000		
Ｓ　Ｍ　Ｋ	16,000	514.00	8,224,000		
ヨコオ	4,700	1,434.00	6,739,800	貸付株式数	1,500株
ホシデン	14,100	1,769.00	24,942,900	貸付株式数	3,800株
ヒロセ電機	8,800	16,740.00	147,312,000		
日本航空電子	14,000	2,015.00	28,210,000		
Ｔ　Ｏ　Ａ	7,100	1,383.00	9,819,300		
マクセルホールディングス	11,100	2,290.00	25,419,000		
古野電気	9,600	819.00	7,862,400		
ユニデンホールディングス	22,000	303.00	6,666,000		
アルパイン	13,300	2,591.00	34,460,300		
スミダコーポレーション	5,900	1,982.00	11,693,800	貸付株式数	1,700株 (1,700株)

アイコム	3,600	2,524.00	9,086,400	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
リオン	3,600	2,377.00	8,557,200		
本多通信工業	6,200	1,163.00	7,210,600		
船井電機	7,200	863.00	6,213,600	貸付株式数	1,900株 (1,800株)
横河電機	54,700	2,070.00	113,229,000		
新電元工業	2,100	7,770.00	16,317,000		
アズビル	16,300	4,860.00	79,218,000		
日本光電工業	23,000	2,575.00	59,225,000		
共和電業	19,500	456.00	8,892,000		
堀場製作所	10,800	7,000.00	75,600,000		
アドバンテスト	31,000	2,235.00	69,285,000	貸付株式数	8,500株
エスペック	5,100	2,755.00	14,050,500		
キーエンス	27,100	64,910.00	1,759,061,000		
日置電機	3,600	2,564.00	9,230,400		
シスメックス	43,100	8,520.00	367,212,000		
日本マイクロニクス	10,600	1,088.00	11,532,800	貸付株式数	3,100株
メガチップス	4,500	3,415.00	15,367,500	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,300	7,880.00	26,004,000		
デンソー	122,800	6,305.00	774,254,000		
コーセル	8,200	1,555.00	12,751,000		
イリソ電子工業	4,700	6,670.00	31,349,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
オプテックスグループ	4,700	4,815.00	22,630,500		
千代田インテグレ	3,000	2,699.00	8,097,000		
レーザーテック	12,400	2,730.00	33,852,000		
スタンレー電気	42,100	4,485.00	188,818,500		
岩崎電気	3,800	1,685.00	6,403,000		
ウシオ電機	32,900	1,618.00	53,232,200		
ヘリオステクノＨ	8,700	1,100.00	9,570,000		
日本セラミック	5,700	3,045.00	17,356,500		
古河電池	5,300	1,063.00	5,633,900	貸付株式数	1,400株 (1,000株)
山一電機	4,400	2,130.00	9,372,000	貸付株式数	1,600株
図　研	4,700	1,835.00	8,624,500		
日本電子	21,000	656.00	13,776,000	貸付株式数	2,000株
カ　シ　オ	44,000	1,642.00	72,248,000		
ファナック	52,500	27,945.00	1,467,112,500		

日本シイエムケイ	10,100	1,061.00	10,716,100	貸付株式数 2,700株
エンプラス	2,600	4,635.00	12,051,000	
大真空	3,700	1,676.00	6,201,200	
ロ　ー　ム	24,800	11,500.00	285,200,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
浜松ホトニクス	39,500	3,850.00	152,075,000	
三井ハイテック	7,500	2,342.00	17,565,000	貸付株式数 2,100株
新光電気工業	21,500	860.00	18,490,000	
京　セ　ラ	90,500	7,901.00	715,040,500	
太陽誘電	24,200	1,876.00	45,399,200	
村田製作所	57,900	15,165.00	878,053,500	
ユーシン	13,200	768.00	10,137,600	貸付株式数 3,900株 (3,500株)
双葉電子工業	8,700	2,337.00	20,331,900	
日東電工	41,700	11,030.00	459,951,000	
北陸電気工業	4,500	1,823.00	8,203,500	
東海理化電機	14,000	2,333.00	32,662,000	
ニチコン	17,000	1,486.00	25,262,000	
日本ケミコン	4,600	3,745.00	17,227,000	
Ｋ　Ｏ　Ａ	8,100	2,271.00	18,395,100	
三井造船	17,900	1,627.00	29,123,300	貸付株式数 5,000株
日立造船	41,800	582.00	24,327,600	
三菱重工業	92,100	4,150.00	382,215,000	
川崎重工業	42,300	3,710.00	156,933,000	
ＩＨＩ	42,300	3,465.00	146,569,500	
名村造船所	18,200	687.00	12,503,400	
日本車輌	25,000	350.00	8,750,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
三菱ロジスネクスト	7,200	944.00	6,796,800	
ＦＰＧ	19,800	1,383.00	27,383,400	貸付株式数 5,400株
じもとホールディングス	54,500	189.00	10,300,500	
全国保証	15,500	4,835.00	74,942,500	
めぶきフィナンシャルＧ	281,100	471.00	132,398,100	
東京ＴＹフィナンシャルＧ	7,400	3,000.00	22,200,000	
九州フィナンシャルＧ	88,100	664.00	58,498,400	
かんぽ生命保険	20,600	2,446.00	50,387,600	
ゆうちょ銀行	155,400	1,427.00	221,755,800	
富山第一銀行	19,100	508.00	9,702,800	
コンコルディア・フィナンシャル	329,700	615.00	202,765,500	

西日本フィナンシャルＨＤ	36,000	1,257.00	45,252,000	
日産自動車	649,900	1,088.00	707,091,200	
いすゞ自動車	160,400	1,771.00	284,068,400	
トヨタ自動車 ※	671,400	7,044.00	4,729,341,600	
日野自動車	79,000	1,374.00	108,546,000	
三菱自動車工業	204,800	785.00	160,768,000	
エフテック	4,600	1,852.00	8,519,200	
武蔵精密工業	6,000	3,375.00	20,250,000	貸付株式数 1,600株
日産車体	21,600	1,147.00	24,775,200	
新明和工業	23,500	1,077.00	25,309,500	
極東開発工業	10,300	1,933.00	19,909,900	
日信工業	11,200	2,193.00	24,561,600	
トピー工業	4,700	3,405.00	16,003,500	
ティラド	2,300	3,870.00	8,901,000	
曙ブレーキ	27,200	342.00	9,302,400	貸付株式数 7,500株
タチエス	9,500	2,103.00	19,978,500	
Ｎ　Ｏ　Ｋ	29,400	2,732.00	80,320,800	
フタバ産業	17,200	1,048.00	18,025,600	
ＫＹＢ	5,800	6,620.00	38,396,000	
市光工業	9,400	1,090.00	10,246,000	
大同メタル工業	8,000	1,004.00	8,032,000	
プレス工業	29,800	669.00	19,936,200	
太平洋工業	11,700	1,613.00	18,872,100	
ケーヒン	12,600	2,204.00	27,770,400	
河西工業	7,100	1,957.00	13,894,700	
アイシン精機	45,500	6,010.00	273,455,000	
マ　ツ　ダ	172,300	1,503.00	258,966,900	
今仙電機製作所	7,300	1,336.00	9,752,800	
本田技研	496,500	3,744.00	1,858,896,000	
スズキ	109,600	6,040.00	661,984,000	
ＳＵＢＡＲＵ	171,400	3,669.00	628,866,600	
安永	2,800	2,662.00	7,453,600	貸付株式数 700株
ヤマハ発動機	77,800	3,520.00	273,856,000	
ショーワ	14,700	1,363.00	20,036,100	貸付株式数 4,000株
小糸製作所	33,200	7,750.00	257,300,000	貸付株式数 9,400株
ＴＢＫ	22,400	532.00	11,916,800	
エクセディ	6,200	3,345.00	20,739,000	
ミツバ	10,500	1,532.00	16,086,000	
豊田合成	19,600	2,807.00	55,017,200	貸付株式数 4,500株
愛三工業	10,000	1,279.00	12,790,000	

ヨ　ロ　ズ	5,700	2,484.00	14,158,800		
エフ・シー・シー	8,900	2,837.00	25,249,300		
シマノ	22,400	15,520.00	347,648,000		
テイ・エス　テック	12,800	4,595.00	58,816,000		
ジャムコ	2,900	2,890.00	8,381,000	貸付株式数	900株 (900株)
小　野　建	5,300	2,035.00	10,785,500	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
ノ　ジ　マ	9,900	2,576.00	25,502,400		
佐鳥電機	8,700	992.00	8,630,400		
伯東	3,900	1,916.00	7,472,400		
コンドーテック	8,000	1,096.00	8,768,000		
ライトオン	6,400	910.00	5,824,000	貸付株式数	1,700株 (1,400株)
ナガイレーベン	7,200	2,687.00	19,346,400		
三菱食品	5,900	3,420.00	20,178,000		
良品計画	7,200	35,050.00	252,360,000		
松田産業	5,800	1,870.00	10,846,000		
第一興商	8,000	5,380.00	43,040,000		
メディパルＨＤ	54,400	2,179.00	118,537,600		
アドヴァン	6,600	1,037.00	6,844,200	貸付株式数	600株 (600株)
萩原電気	2,500	3,425.00	8,562,500		
アルビス	1,600	4,300.00	6,880,000	貸付株式数	400株 (100株)
アズワン	4,300	6,440.00	27,692,000		
ドウシシャ	6,000	2,305.00	13,830,000		
小津産業	4,900	2,186.00	10,711,400		
コ　ジ　マ	16,900	365.00	6,168,500		
コーナン商事	7,900	2,340.00	18,486,000		
黒田電気	6,600	2,713.00	17,905,800		
ネットワンシステムズ	22,900	1,610.00	36,869,000		
ワタミ	7,300	1,575.00	11,497,500	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	35,500	5,370.00	190,635,000		
丸文	7,300	1,036.00	7,562,800		
西松屋チェーン	12,200	1,358.00	16,567,600	貸付株式数	3,400株
ゼンショーホールディングス	28,400	1,900.00	53,960,000	貸付株式数	8,000株

ハピネット	4,300	1,988.00	8,548,400		
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,771.00	12,928,300	貸付株式数	1,900株 (1,600株)
日本ライフライン	7,800	4,980.00	38,844,000	貸付株式数	2,100株 (100株)
サイゼリヤ	8,300	3,510.00	29,133,000		
エクセル	3,100	2,488.00	7,712,800	貸付株式数	900株
ＶＴホールディングス	19,300	552.00	10,653,600	貸付株式数	5,400株
マルカキカイ	3,400	2,159.00	7,340,600	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	3,200	3,535.00	11,312,000		
ＩＤＯＭ	17,700	836.00	14,797,200	貸付株式数	4,700株 (100株)
ポプラ	11,600	718.00	8,328,800		
ユナイテッドアローズ	6,700	4,240.00	28,408,000		
進和	4,700	2,564.00	12,050,800		
ダイトロン	3,800	2,297.00	8,728,600		
ハイデイ日高	6,100	3,385.00	20,648,500		
シークス	3,300	4,750.00	15,675,000	貸付株式数	900株
コロワイド	18,200	2,157.00	39,257,400	貸付株式数	5,100株
ピーシーデポコーポ	8,900	926.00	8,241,400	貸付株式数	1,900株
壱番屋	3,800	4,405.00	16,739,000	貸付株式数	900株
スギホールディングス	11,800	6,020.00	71,036,000		
島津製作所	65,500	2,677.00	175,343,500		
長野計器	7,500	1,349.00	10,117,500		
ブイ・テクノロジー	1,300	18,730.00	24,349,000	貸付株式数	300株
スター精密	8,600	1,839.00	15,815,400	貸付株式数	2,700株
東京計器	4,800	1,390.00	6,672,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
東京精密	9,800	4,655.00	45,619,000		
マニー	6,900	3,220.00	22,218,000		
ニコン	96,100	2,227.00	214,014,700		
トプコン	29,700	2,491.00	73,982,700		
オリンパス	82,300	4,610.00	379,403,000	貸付株式数	25,300株 (25,300株)
理研計器	5,900	2,525.00	14,897,500		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	10,500	10,060.00	105,630,000		
キヤノン電子	5,600	2,480.00	13,888,000		
タムロン	4,600	2,433.00	11,191,800	貸付株式数	100株
ＨＯＹＡ	113,600	5,448.00	618,892,800		

ノーリツ鋼機	6,100	2,132.00	13,005,200	貸付株式数	1,600株
エー・アンド・デイ	13,400	764.00	10,237,600		
キヤノン	297,200	4,298.00	1,277,365,600		
リ　コ　ー	165,700	996.00	165,037,200		
シチズン時計	63,700	815.00	51,915,500		
リズム時計	4,000	2,360.00	9,440,000		
メニコン	4,000	5,850.00	23,400,000		
パラマウントベッドＨＤ	5,800	5,330.00	30,914,000	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ＳＨＯ‐ＢＩ	13,300	423.00	5,625,900	貸付株式数	3,000株
ニホンフラッシュ	4,400	2,378.00	10,463,200	貸付株式数	1,200株
前田工繊	6,500	1,994.00	12,961,000		
アートネイチャー	9,000	807.00	7,263,000		
ダンロップスポーツ	4,400	1,589.00	6,991,600		
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	57,200	3,650.00	208,780,000		
ＳＨＯＥＩ	2,800	4,270.00	11,956,000		
マーベラス	9,900	1,032.00	10,216,800	貸付株式数	2,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	9,600	5,410.00	51,936,000		
萩原工業	4,500	1,975.00	8,887,500	貸付株式数	1,200株
エイベックス	10,200	1,549.00	15,799,800		
トッパン・フォームズ	12,200	1,220.00	14,884,000		
フジシールインターナショナル	12,300	3,820.00	46,986,000		
タカラトミー	23,600	1,599.00	37,736,400		
レック	3,600	2,724.00	9,806,400	貸付株式数	1,100株
大建工業	4,700	2,878.00	13,526,600		
凸版印刷	153,000	1,046.00	160,038,000		
大日本印刷	71,600	2,455.00	175,778,000		
共同印刷	2,300	3,580.00	8,234,000		
ＮＩＳＳＨＡ	11,100	3,615.00	40,126,500	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
藤森工業	4,800	3,955.00	18,984,000		
ヴィア・ホールディングス	10,600	753.00	7,981,800	貸付株式数	2,900株
宝印刷	6,900	1,742.00	12,019,800		
アシックス	54,600	1,656.00	90,417,600	貸付株式数	15,200株
ジェイ　エス　ピー	3,500	3,785.00	13,247,500		
ニ　チ　ハ	8,500	4,360.00	37,060,000		
エフピコ	4,600	6,230.00	28,658,000	貸付株式数	1,400株

ヤマハ	37,400	4,130.00	154,462,000	
河合楽器	3,800	2,529.00	9,610,200	
クリナップ	8,300	858.00	7,121,400	
ピジョン	33,400	4,295.00	143,453,000	
天馬	4,500	2,105.00	9,472,500	
キングジム	10,100	1,001.00	10,110,100	
リンテック	12,300	3,090.00	38,007,000	
信越ポリマー	11,400	1,184.00	13,497,600	
東　リ	22,300	406.00	9,053,800	
イトーキ	13,300	836.00	11,118,800	貸付株式数　1,300株
任　天　堂	34,000	45,200.00	1,536,800,000	
三菱鉛筆	9,000	2,433.00	21,897,000	
タカラスタンダード	11,300	1,787.00	20,193,100	
コ　ク　ヨ	26,200	2,130.00	55,806,000	貸付株式数　2,500株
ナカバヤシ	12,800	708.00	9,062,400	
ニ　フ　コ	10,000	7,530.00	75,300,000	
立川ブラインド	5,200	1,387.00	7,212,400	
グローブライド	4,100	1,996.00	8,183,600	
岡村製作所	18,900	1,472.00	27,820,800	
日本バルカー	4,900	2,649.00	12,980,100	
伊　藤　忠	399,200	1,946.00	776,843,200	
丸　紅	444,300	745.80	331,358,940	
スクロール	16,500	485.00	8,002,500	
高　島	3,300	2,192.00	7,233,600	
ヨンドシーホールディングス	5,600	3,045.00	17,052,000	貸付株式数　1,500株
三陽商会	4,900	2,113.00	10,353,700	貸付株式数　1,200株
長瀬産業	31,400	2,053.00	64,464,200	
蝶　理	4,100	2,081.00	8,532,100	
豊田通商	60,600	4,220.00	255,732,000	
オンワードホールディングス	35,000	916.00	32,060,000	
兼　松	23,300	1,346.00	31,361,800	
美　津　濃	5,700	3,335.00	19,009,500	
ツカモトコーポレーション	6,800	1,265.00	8,602,000	
ユニー・ファミリーマートＨＤ	17,600	7,570.00	133,232,000	貸付株式数　6,800株
三井物産	460,800	1,705.00	785,664,000	
日本紙パルプ	2,800	4,295.00	12,026,000	
東京エレクトロン	36,900	20,760.00	766,044,000	

日立ハイテクノロジーズ	18,900	4,645.00	87,790,500	
カメイ	7,200	1,810.00	13,032,000	
スターゼン	2,400	5,410.00	12,984,000	
セイコーＨＤ	8,100	3,045.00	24,664,500	貸付株式数　2,200株
山　善	20,900	1,277.00	26,689,300	
住友商事	341,300	1,743.50	595,056,550	
日本ユニシス	15,000	2,203.00	33,045,000	
内田洋行	3,100	3,210.00	9,951,000	
三菱商事	381,800	2,813.00	1,074,003,400	
第一実業	3,100	3,395.00	10,524,500	
キヤノンマーケティングＪＰＮ	15,800	2,870.00	45,346,000	
西華産業	3,700	2,724.00	10,078,800	
菱洋エレクトロ	5,600	1,920.00	10,752,000	
ユアサ商事	5,100	3,940.00	20,094,000	
神鋼商事	2,000	3,040.00	6,080,000	
阪和興業	10,100	4,525.00	45,702,500	
正栄食品	3,200	4,750.00	15,200,000	貸付株式数　800株
カナデン	8,400	1,387.00	11,650,800	
菱電商事	5,000	1,737.00	8,685,000	
ニプロ	38,000	1,624.00	61,712,000	
岩谷産業	11,500	3,390.00	38,985,000	
すてきナイスグループ	6,100	1,543.00	9,412,300	
極東貿易	20,000	445.00	8,900,000	
イ　ワ　キ	14,000	489.00	6,846,000	
兼松エレクトロニクス	3,700	3,295.00	12,191,500	
三愛石油	14,400	1,608.00	23,155,200	
稲畑産業	12,900	1,739.00	22,433,100	
ゴールドウイン	1,800	8,200.00	14,760,000	貸付株式数　700株 (700株)
ユニ・チャーム	117,000	2,943.00	344,331,000	
デサント	13,000	1,656.00	21,528,000	貸付株式数　3,500株
ワ　キ　タ	12,300	1,328.00	16,334,400	
東邦ホールディングス	15,400	2,333.00	35,928,200	貸付株式数　4,700株
サンゲツ	17,900	2,049.00	36,677,100	
ミツウロコグループ	8,900	822.00	7,315,800	
シナネンホールディングス	3,200	2,510.00	8,032,000	
伊藤忠エネクス	11,300	1,125.00	12,712,500	
サンリオ	15,100	1,865.00	28,161,500	貸付株式数　4,600株
サンワ　テクノス	4,200	2,035.00	8,547,000	

リョーサン	6,700	4,345.00	29,111,500		
新光商事	6,600	1,972.00	13,015,200		
トーホー	4,100	2,742.00	11,242,200		
三信電気	5,200	1,695.00	8,814,000		
東陽テクニカ	10,000	958.00	9,580,000		
モスフード　サービス	7,300	3,445.00	25,148,500	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
加賀電子	5,000	3,145.00	15,725,000		
三益半導体	5,400	2,070.00	11,178,000		
木曽路	7,500	2,721.00	20,407,500		
千　趣　会	15,200	676.00	10,275,200	貸付株式数	2,600株
タカキユー	33,400	231.00	7,715,400		
ケーヨー	13,700	713.00	9,768,100		
上新電機	6,500	4,385.00	28,502,500		
日本瓦斯	10,100	3,970.00	40,097,000		
ロイヤルホールディングス	9,900	3,085.00	30,541,500	貸付株式数	1,000株
いなげや	6,900	1,842.00	12,709,800		
島　忠	14,000	3,230.00	45,220,000	貸付株式数	3,600株
チヨダ	6,300	2,925.00	18,427,500		
ライフコーポレーション	4,300	3,005.00	12,921,500		
リンガーハツト	7,100	2,580.00	18,318,000	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ＭｒＭａｘＨＤ	9,700	850.00	8,245,000		
ＡＯＫＩホールディングス	10,500	1,640.00	17,220,000		
オークワ	9,000	1,134.00	10,206,000		
コメリ	8,100	3,200.00	25,920,000		
青山商事	10,200	4,280.00	43,656,000	貸付株式数	3,000株
しまむら	6,300	13,530.00	85,239,000		
高　島　屋	85,000	1,107.00	94,095,000		
松　屋	12,500	1,331.00	16,637,500	貸付株式数	3,400株
エイチ・ツー・オーリテイリング	25,700	2,188.00	56,231,600		
丸井グループ	52,300	1,986.00	103,867,800		
クレディセゾン	41,000	2,159.00	88,519,000		
アクシアル　リテイリング	4,700	4,230.00	19,881,000		
イオン	209,400	1,824.00	381,945,600	貸付株式数	48,000株
イ　ズ　ミ	10,000	6,590.00	65,900,000		
平　和　堂	10,900	2,422.00	26,399,800	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
フ　ジ	6,300	2,466.00	15,535,800		

ヤオコー	6,400	5,290.00	33,856,000	
ゼビオホールディングス	7,200	2,067.00	14,882,400	
ケーズホールディングス	22,800	2,896.00	66,028,800	貸付株式数 6,600株 (3,000株)
ＰＡＬＴＡＣ	7,600	4,980.00	37,848,000	
新生銀行	47,000	1,793.00	84,271,000	
あおぞら銀行	32,000	4,355.00	139,360,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	3,848,600	792.10	3,048,476,060	
りそなホールディングス	597,800	595.90	356,229,020	
三井住友トラストＨＤ	107,000	4,164.00	445,548,000	
三井住友フィナンシャルＧ	412,100	4,547.00	1,873,818,700	
第四銀行	6,500	4,905.00	31,882,500	
北越銀行	5,900	2,496.00	14,726,400	
千葉銀行	194,000	859.00	166,646,000	
群馬銀行	106,900	666.00	71,195,400	
武蔵野銀行	8,400	3,570.00	29,988,000	
千葉興業銀行	19,100	597.00	11,402,700	
筑波銀行	33,000	386.00	12,738,000	
七十七銀行	16,300	2,648.00	43,162,400	
青森銀行	4,200	3,585.00	15,057,000	
秋田銀行	3,500	3,045.00	10,657,500	
山形銀行	6,000	2,471.00	14,826,000	
岩手銀行	3,600	4,485.00	16,146,000	貸付株式数 600株
東邦銀行	45,900	398.00	18,268,200	
東北銀行	8,300	1,507.00	12,508,100	
ふくおかフィナンシャルＧ	218,000	582.00	126,876,000	
静岡銀行	141,000	1,108.00	156,228,000	
十六銀行	6,700	3,330.00	22,311,000	
スルガ銀行	55,700	2,411.00	134,292,700	
八十二銀行	93,800	640.00	60,032,000	
山梨中央銀行	34,000	478.00	16,252,000	
大垣共立銀行	8,300	2,881.00	23,912,300	
福井銀行	4,900	2,733.00	13,391,700	
北國銀行	6,000	4,355.00	26,130,000	
清水銀行	2,700	3,225.00	8,707,500	
滋賀銀行	46,000	580.00	26,680,000	
南都銀行	6,300	3,035.00	19,120,500	
百五銀行	49,500	518.00	25,641,000	
京都銀行	20,500	5,720.00	117,260,000	

紀陽銀行	19,800	1,877.00	37,164,600		
三重銀行	3,800	2,534.00	9,629,200		
ほくほくフィナンシャルG	34,700	1,675.00	58,122,500		
広島銀行	78,100	883.00	68,962,300	貸付株式数	21,600株
山陰合同銀行	31,200	1,014.00	31,636,800		
中国銀行	36,700	1,463.00	53,692,100	貸付株式数	10,200株
伊予銀行	76,000	877.00	66,652,000	貸付株式数	15,700株
百十四銀行	58,000	370.00	21,460,000		
四国銀行	8,400	1,583.00	13,297,200		
阿波銀行	41,000	691.00	28,331,000		
大分銀行	2,900	4,450.00	12,905,000	貸付株式数	800株
宮崎銀行	3,600	3,585.00	12,906,000		
佐賀銀行	3,800	2,550.00	9,690,000		
十八銀行	38,000	293.00	11,134,000		
沖縄銀行	5,100	4,395.00	22,414,500	貸付株式数	100株
琉球銀行	10,800	1,622.00	17,517,600		
セブン銀行	203,400	376.00	76,478,400	貸付株式数	58,500株
みずほフィナンシャルG	7,394,200	203.90	1,507,677,380		
高知銀行	8,600	1,281.00	11,016,600		
山口フィナンシャルG	48,000	1,341.00	64,368,000		
芙蓉総合リース	6,200	7,450.00	46,190,000		
興銀リース	10,000	2,867.00	28,670,000		
東京センチュリー	10,900	5,090.00	55,481,000		
ＳＢＩホールディングス	60,800	1,995.00	121,296,000		
日本証券金融	23,700	610.00	14,457,000		
アイフル	94,500	384.00	36,288,000	貸付株式数	27,400株 (300株)
名古屋銀行	4,100	4,300.00	17,630,000	貸付株式数	1,200株
北洋銀行	78,200	360.00	28,152,000		
愛知銀行	1,900	6,310.00	11,989,000		
第三銀行	5,100	1,825.00	9,307,500		
中京銀行	3,100	2,330.00	7,223,000		
大光銀行	3,200	2,494.00	7,980,800		
愛媛銀行	7,700	1,415.00	10,895,500	貸付株式数	1,900株
トマト銀行	8,300	1,543.00	12,806,900		
みなと銀行	5,200	2,071.00	10,769,200		
京葉銀行	45,000	511.00	22,995,000	貸付株式数	12,000株 (12,000株)
関西アーバン銀行	7,300	1,411.00	10,300,300		
栃木銀行	27,800	480.00	13,344,000		

北日本銀行	3,400	3,005.00	10,217,000	
東和銀行	10,400	1,311.00	13,634,400	
福島銀行	10,900	910.00	9,919,000	
大東銀行	5,400	1,670.00	9,018,000	
リコーリース	4,300	3,855.00	16,576,500	
イオンフィナンシャルサービス	38,600	2,491.00	96,152,600	
ア　コ　ム	114,800	467.00	53,611,600	貸付株式数　32,900株
ジャックス	6,900	2,589.00	17,864,100	
オ　リ　コ	116,900	184.00	21,509,600	貸付株式数　35,700株
日立キャピタル	14,800	2,766.00	40,936,800	
アプラスフィナンシャル	58,100	110.00	6,391,000	
オリックス	363,300	1,934.00	702,622,200	
三菱ＵＦＪリース	136,200	639.00	87,031,800	
ジャフコ	7,700	5,890.00	45,353,000	
トモニホールディングス	43,900	544.00	23,881,600	
大和証券Ｇ本社	464,000	698.00	323,872,000	
野村ホールディングス	980,600	670.50	657,492,300	
岡三証券グループ	45,000	686.00	30,870,000	
丸三証券	19,400	1,051.00	20,389,400	貸付株式数　4,500株
東洋証券	32,000	324.00	10,368,000	貸付株式数　8,000株
東海東京ＨＤ	58,700	726.00	42,616,200	
水戸証券	26,200	429.00	11,239,800	
いちよし証券	13,600	1,280.00	17,408,000	
松井証券	24,500	983.00	24,083,500	
ＳＯＭＰＯホールディングス	106,600	4,532.00	483,111,200	
日本取引所グループ	160,700	2,062.00	331,363,400	
マネックスＧ	58,800	327.00	19,227,600	貸付株式数　16,200株
カブドットコム証券	35,600	342.00	12,175,200	
極東証券	8,200	1,645.00	13,489,000	
岩井コスモホールディング	7,900	1,441.00	11,383,900	
藍澤證券	14,100	752.00	10,603,200	
フィデアホール	63,500	204.00	12,954,000	
池田泉州ＨＤ	50,500	404.00	20,402,000	
アニコム　ホールディングス	4,000	3,230.00	12,920,000	貸付株式数　1,100株
ＭＳ＆ＡＤ	142,100	3,655.00	519,375,500	
ＳＯＮＹ　ＦＨ	44,100	1,898.00	83,701,800	貸付株式数　100株
第一生命ＨＬＤＧＳ	307,700	2,296.00	706,479,200	

東京海上ＨＤ	205,200	4,960.00	1,017,792,000	
イー・ギャランティ	2,400	3,300.00	7,920,000	貸付株式数 700株 (700株)
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,300	2,317.00	7,646,100	
Ｔ＆Ｄホールディングス	167,700	1,845.50	309,490,350	
アドバンスクリエイト	3,600	1,961.00	7,059,600	
三井不動産	273,000	2,536.00	692,328,000	
三菱地所	406,600	2,002.50	814,216,500	
平和不動産	9,900	2,098.00	20,770,200	
東京建物	58,300	1,556.00	90,714,800	
ダイビル	14,300	1,259.00	18,003,700	
京阪神ビルディング	12,200	833.00	10,162,600	
住友不動産	131,000	3,696.00	484,176,000	
大京	8,700	2,187.00	19,026,900	
テーオーシー	18,500	940.00	17,390,000	
レオパレス２１	67,500	900.00	60,750,000	
スターツコーポレーション	7,400	2,741.00	20,283,400	
フジ住宅	10,900	840.00	9,156,000	
空港施設	11,100	653.00	7,248,300	
ゴールドクレスト	4,300	2,309.00	9,928,700	
リログループ	29,200	2,988.00	87,249,600	
日本エスリード	3,400	2,340.00	7,956,000	
日神不動産	9,100	836.00	7,607,600	
日本エスコン	11,800	627.00	7,398,600	貸付株式数 3,100株
タカラレーベン	25,900	509.00	13,183,100	貸付株式数 7,200株
サンヨーハウジ　名古屋	8,000	1,197.00	9,576,000	
イオンモール	34,500	2,054.00	70,863,000	
東祥	3,700	3,460.00	12,802,000	貸付株式数 1,000株
トーセイ	8,300	1,095.00	9,088,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	33,700	1,235.00	41,619,500	
サンフロンティア不動産	6,500	1,502.00	9,763,000	貸付株式数 1,700株 (100株)
エフ・ジェー・ネクスト	6,200	994.00	6,162,800	
グランディハウス	19,200	530.00	10,176,000	
東武鉄道	58,900	3,575.00	210,567,500	
相鉄ホールディングス	17,400	2,923.00	50,860,200	
東京急行	150,300	1,791.00	269,187,300	
京浜急行	76,200	2,167.00	165,125,400	貸付株式数 21,200株
小田急電鉄	82,300	2,385.00	196,285,500	

京王電鉄	30,800	4,960.00	152,768,000	
京成電鉄	38,500	3,600.00	138,600,000	
富士急行	7,700	3,070.00	23,639,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
東日本旅客鉄道	99,400	10,865.00	1,079,981,000	
西日本旅客鉄道	49,900	8,257.00	412,024,300	
東海旅客鉄道	49,600	20,775.00	1,030,440,000	
西武ホールディングス	70,200	2,029.00	142,435,800	
鴻池運輸	8,000	1,855.00	14,840,000	
西日本鉄道	15,200	2,920.00	44,384,000	
ハマキョウレックス	4,200	3,125.00	13,125,000	
サカイ引越センター	3,100	5,670.00	17,577,000	貸付株式数 800株 (200株)
近鉄グループＨＬＤＧＳ	52,200	4,395.00	229,419,000	
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	70,000	4,350.00	304,500,000	
南海電鉄	25,000	2,803.00	70,075,000	
京阪ホールディングス	23,100	3,325.00	76,807,500	
名古屋鉄道	40,200	2,741.00	110,188,200	
山陽電鉄	4,900	2,868.00	14,053,200	
トランコム	1,700	7,320.00	12,444,000	
日本通運	20,400	7,130.00	145,452,000	
ヤマトホールディングス	91,900	2,275.50	209,118,450	
山　九	13,300	4,780.00	63,574,000	
日　新	4,900	3,095.00	15,165,500	
丸全昭和運輸	22,000	500.00	11,000,000	
センコーグループＨＬＤＧＳ	31,700	802.00	25,423,400	
トナミホールディングス	1,500	4,795.00	7,192,500	
ニッコンホールディングス	19,500	3,025.00	58,987,500	
福山通運	7,500	4,040.00	30,300,000	
セイノーホールディングス	38,700	1,773.00	68,615,100	貸付株式数 10,600株
日立物流	11,700	2,793.00	32,678,100	
丸和運輸機関	3,200	3,060.00	9,792,000	貸付株式数 900株 (900株)
日本郵船	43,200	2,618.00	113,097,600	貸付株式数 13,000株
商船三井	32,600	3,600.00	117,360,000	
川崎汽船	24,000	2,894.00	69,456,000	貸付株式数 6,700株
ＮＳユナイテッド海運	2,600	2,663.00	6,923,800	
飯野海運	27,800	620.00	17,236,000	
九州旅客鉄道	43,900	3,470.00	152,333,000	

日本航空	96,700	4,116.00	398,017,200	
ＡＮＡホールディングス	102,500	4,480.00	459,200,000	
三菱倉庫	17,700	3,000.00	53,100,000	
三井倉庫ＨＯＬＤ	37,000	360.00	13,320,000	
住友倉庫	36,000	796.00	28,656,000	
渋沢倉庫	6,700	1,916.00	12,837,200	
ヤマタネ	5,600	2,186.00	12,241,600	
東陽倉庫	29,200	327.00	9,548,400	
日本トランスシティ	19,000	459.00	8,721,000	
東洋埠頭	6,200	1,832.00	11,358,400	
上　組	33,000	2,474.00	81,642,000	
キユーソー流通システム	2,200	3,190.00	7,018,000	貸付株式数　600株
郵船ロジスティクス	6,400	1,497.00	9,580,800	
近鉄エクスプレス	10,100	2,223.00	22,452,300	
内外トランスライン	5,500	1,848.00	10,164,000	貸付株式数　1,500株
東京放送ＨＤ	32,800	2,753.00	90,298,400	貸付株式数　9,200株
日本テレビＨＬＤＳ	49,500	2,031.00	100,534,500	貸付株式数　13,800株
テレビ朝日ＨＤ	14,900	2,388.00	35,581,200	
スカパーＪＳＡＴＨＤ	40,700	500.00	20,350,000	
テレビ東京ＨＤ	4,900	2,446.00	11,985,400	貸付株式数　1,500株 (1,500株)
日本ＢＳ放送	5,500	1,278.00	7,029,000	
ワイヤレスゲート	4,600	1,289.00	5,929,400	貸付株式数　1,300株 (800株)
コネクシオ	4,000	2,185.00	8,740,000	
日本通信	64,700	121.00	7,828,700	貸付株式数　17,100株
日本電信電話	388,900	5,879.00	2,286,343,100	
ＫＤＤＩ	487,600	3,215.00	1,567,634,000	
光通信	6,600	16,180.00	106,788,000	
ＮＴＴドコモ	401,300	2,907.50	1,166,779,750	
エムティーアイ	10,000	652.00	6,520,000	貸付株式数　100株
ＧＭＯインターネット	20,600	1,879.00	38,707,400	貸付株式数　5,800株
カドカワ	16,200	1,287.00	20,849,400	貸付株式数　4,400株
ゼンリン	6,800	3,795.00	25,806,000	
東京電力ＨＤ	438,500	450.00	197,325,000	
中部電力	168,600	1,419.00	239,243,400	
関西電力	225,600	1,484.00	334,790,400	
中国電力	74,800	1,240.00	92,752,000	貸付株式数　21,600株
北陸電力	53,900	990.00	53,361,000	貸付株式数　14,900株
東北電力	128,900	1,482.00	191,029,800	

四国電力	49,500	1,508.00	74,646,000	
九州電力	121,700	1,283.00	156,141,100	
北海道電力	54,900	807.00	44,304,300	
沖縄電力	9,100	2,931.00	26,672,100	
電源開発	43,800	3,120.00	136,656,000	
イーレックス	9,200	1,100.00	10,120,000	貸付株式数 2,200株
東京瓦斯	118,100	2,635.00	311,193,500	
大阪瓦斯	107,000	2,157.00	230,799,000	
東邦瓦斯	27,300	3,190.00	87,087,000	貸付株式数 7,500株
北海道瓦斯	33,000	289.00	9,537,000	貸付株式数 5,000株
西部瓦斯	7,500	2,657.00	19,927,500	
静岡ガス	16,300	974.00	15,876,200	
メタウォーター	3,200	2,857.00	9,142,400	貸付株式数 800株 (800株)
松　竹	3,600	18,420.00	66,312,000	
東　宝	35,500	3,795.00	134,722,500	
エイチ・アイ・エス	8,400	4,225.00	35,490,000	貸付株式数 2,300株
東　映	2,000	11,660.00	23,320,000	
ＮＴＴデータ	170,300	1,321.00	224,966,300	
共立メンテナンス	9,500	4,040.00	38,380,000	貸付株式数 2,600株
イチネンホールディングス	7,300	1,598.00	11,665,400	
建設技術研究所	7,900	1,134.00	8,958,600	
アインホールディングス	7,800	7,650.00	59,670,000	
スバル興業	1,100	7,980.00	8,778,000	
東京テアトル	5,400	1,500.00	8,100,000	
よみうりランド	1,600	4,945.00	7,912,000	
東京都競馬	4,200	3,880.00	16,296,000	
常磐興産	6,500	1,856.00	12,064,000	
カナモト	8,200	3,875.00	31,775,000	
東京ドーム	21,500	1,110.00	23,865,000	
ＤＴＳ	6,200	3,715.00	23,033,000	貸付株式数 2,000株
スクウェア・エニックス・ＨＤ	25,400	5,110.00	129,794,000	
シーイーシー	3,700	2,549.00	9,431,300	
カプコン	11,700	3,200.00	37,440,000	
西尾レントオール	4,600	3,835.00	17,641,000	
日本空港ビルデング	16,000	4,190.00	67,040,000	貸付株式数 4,400株
トランス・コスモス	5,900	2,741.00	16,171,900	
乃村工藝社	12,500	2,566.00	32,075,000	
ジャステック	6,000	1,260.00	7,560,000	

ＳＣＳＫ	13,300	4,915.00	65,369,500	
藤田観光	2,300	3,675.00	8,452,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	3,800	1,708.00	6,490,400	
日本管財	6,100	2,035.00	12,413,500	
トーカイ	2,700	4,685.00	12,649,500	
セコム	56,000	8,414.00	471,184,000	
セントラル警備保障	3,500	2,041.00	7,143,500	貸付株式数 900株 (100株)
アイネス	10,800	1,086.00	11,728,800	
丹青社	11,300	1,430.00	16,159,000	
メイテツク	6,000	5,900.00	35,400,000	
ＴＫＣ	5,300	3,855.00	20,431,500	
アサツー　ディ・ケイ	10,000	3,660.00	36,600,000	
富士ソフト	7,500	3,465.00	25,987,500	
応用地質	6,700	1,520.00	10,184,000	
船井総研ホールディン	7,600	3,735.00	28,386,000	
ＮＳＤ	9,100	2,309.00	21,011,900	
オ　オ　バ	18,800	511.00	9,606,800	
コナミホールディングス	22,300	5,930.00	132,239,000	
学　究　社	5,500	1,604.00	8,822,000	
ベネッセホールディングス	19,200	3,960.00	76,032,000	
イオンディライト	6,400	4,250.00	27,200,000	
ニチイ学館	10,500	1,380.00	14,490,000	
ダイセキ	9,400	2,965.00	27,871,000	
日鉄住金物産	3,900	5,920.00	23,088,000	
元気寿司	3,500	4,470.00	15,645,000	貸付株式数 800株 (100株)
トラスコ中山	11,500	3,140.00	36,110,000	貸付株式数 2,500株
ヤマダ電機	179,200	610.00	109,312,000	貸付株式数 50,300株
オートバックスセブン	21,100	2,152.00	45,407,200	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	9,500	1,871.00	17,774,500	
ニトリホールディングス	21,700	18,335.00	397,869,500	
吉野家ホールディングス	18,000	1,863.00	33,534,000	貸付株式数 5,700株
加藤産業	8,500	4,045.00	34,382,500	
イノテック	7,200	1,010.00	7,272,000	
イエローハット	5,300	3,275.00	17,357,500	
松屋フーズ	2,900	4,115.00	11,933,500	
ＪＢＣＣホールディングス	10,400	1,031.00	10,722,400	

サガミチェーン	10,900	1,394.00	15,194,600	貸付株式数 3,000株 (2,300株)
日　伝	5,300	2,324.00	12,317,200	
関西スーパーマーケット	5,300	1,262.00	6,688,600	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ミロク情報サービス	5,100	2,936.00	14,973,600	
北沢産業	33,100	287.00	9,499,700	
因幡電機産業	6,800	5,260.00	35,768,000	
王将フードサービス	3,900	4,980.00	19,422,000	
プレナス	6,200	2,346.00	14,545,200	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,600	2,334.00	10,736,400	
アークス	9,900	2,594.00	25,680,600	
バローホールディングス	12,500	2,617.00	32,712,500	
バイテックホールディングス	3,700	1,713.00	6,338,100	
ミスミグループ本社	63,000	3,275.00	206,325,000	
ベ　ル　ク	2,700	6,290.00	16,983,000	
ファーストリテイリング	9,100	43,510.00	395,941,000	貸付株式数 2,500株
ソフトバンクグループ	245,400	9,485.00	2,327,619,000	
スズケン	24,600	4,440.00	109,224,000	
サンドラッグ	23,200	5,170.00	119,944,000	
サックスバーホールディング	6,000	1,398.00	8,388,000	貸付株式数 1,800株
ジェコス	5,100	1,406.00	7,170,600	
ベルーナ	14,200	1,227.00	17,423,400	
合計			141,293,259,400	

（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28年11月30日現在	平成29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	281,934,187	328,217,271
国債証券	40,657,453,270	56,883,147,780
地方債証券	3,811,406,400	4,405,150,700
特殊債券	3,372,562,661	3,211,257,800
社債券	3,308,223,600	3,212,890,300
未収入金	411,031,640	―
未収利息	157,572,707	181,873,953
前払費用	3,873,580	5,395,389
流動資産合計	52,004,058,045	68,227,933,193
資産合計	52,004,058,045	68,227,933,193
負債の部		
流動負債		
未払金	91,609,550	―
未払解約金	6,752,875	88,741,204
流動負債合計	98,362,425	88,741,204
負債合計	98,362,425	88,741,204
純資産の部		
元本等		
元本　※1	37,053,043,176	48,889,824,254
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	14,852,652,444	19,249,367,735
元本等合計	51,905,695,620	68,139,191,989
純資産合計	51,905,695,620	68,139,191,989
負債純資産合計	52,004,058,045	68,227,933,193

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28年12月1日 至　平成29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28年11月30日現在	平成29年11月30日現在
1.　※1　期首	平成27年12月1日	平成28年12月1日
期首元本額	40,077,387,149円	37,053,043,176円
期中追加設定元本額	4,724,277,547円	16,475,959,702円
期中一部解約元本額	7,748,621,520円	4,639,178,624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)	216,435,072円	158,413,208円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,435,119,843円	1,115,777,521円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	154,601,241円	129,471,630円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	2,029,554,751円	1,544,820,823円

Ｄ－Ｉ'ｓ 日本債券インデックス	765,717円	761,060円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	4,520,031,855円	5,048,119,641円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	15,037,977,112円	14,793,606,425円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,380,007,134円	2,332,093,501円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	316,684,776円	315,508,234円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	432,222,563円	427,330,074円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	31,913,378円	56,164,883円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	2,148,394,984円	13,311,941,351円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	－円	17,276,903円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	－円	988,470,113円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	881,186,341円	1,245,052,313円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,545,146,286円	6,339,363,709円
ダイワライフスタイル２５	420,509,022円	451,259,183円
ダイワライフスタイル５０	398,353,270円	481,361,512円
ダイワライフスタイル７５	104,139,831円	133,032,170円
計	37,053,043,176円	48,889,824,254円
2. 期末日における受益権の総数	37,053,043,176口	48,889,824,254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28年12月1日 至 平成29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29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28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29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	1,434,218,480	△674,418,240
地方債証券	△6,403,150	△36,738,700
特殊債券	875,996	△28,244,960
社債券	△17,015,300	△17,765,100
合計	1,411,676,026	△757,167,000

（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12月1日から平成28年11月30日まで、及び平成28年12月1日から平成29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28年11月30日現在	平成29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28年11月30日現在	平成29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）	1.4008円 (14,008円)	1.3937円 (13,937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	３７１　２年国債	200,000,000	200,546,000	
	３７２　２年国債	130,000,000	130,384,800	
	３７３　２年国債	300,000,000	300,954,000	
	３７４　２年国債	320,000,000	321,084,800	
	３７５　２年国債	60,000,000	60,216,600	
	３７６　２年国債	250,000,000	250,957,500	
	３７７　２年国債	150,000,000	150,609,000	
	３８０　２年国債	330,000,000	331,560,900	
	１１６　５年国債	500,000,000	501,880,000	
	１１７　５年国債	730,000,000	733,299,600	
	１１８　５年国債	270,000,000	271,460,700	
	１１９　５年国債	480,000,000	481,852,800	
	１２０　５年国債	180,000,000	181,132,200	
	１２１　５年国債	550,000,000	552,469,500	
	１２２　５年国債	630,000,000	633,162,600	
	１２３　５年国債	580,000,000	583,265,400	
	１２４　５年国債	550,000,000	553,366,000	
	１２５　５年国債	640,000,000	644,396,800	
	１２６　５年国債	750,000,000	755,385,000	
	１２７　５年国債	680,000,000	685,276,800	

１２８　５年国債	605,000,000	609,948,900	
１２９　５年国債	830,000,000	837,279,100	
１３０　５年国債	700,000,000	706,538,000	
１３１　５年国債	750,000,000	757,275,000	
１３２　５年国債	310,000,000	313,112,400	
１３３　５年国債	200,000,000	202,120,000	
１　４０年国債	85,000,000	120,660,050	
２　４０年国債	116,000,000	159,029,040	
３　４０年国債	74,000,000	101,892,080	
４　４０年国債	107,000,000	147,740,250	
５　４０年国債	125,000,000	165,585,000	
６　４０年国債	105,000,000	136,223,850	
７　４０年国債	121,000,000	149,732,660	
８　４０年国債	150,000,000	171,418,500	
９　４０年国債	258,000,000	211,621,920	
１０　４０年国債	165,000,000	160,571,400	
２９７　１０年国債	70,000,000	71,141,700	
２９８　１０年国債	125,000,000	126,907,500	
２９９　１０年国債	250,000,000	254,685,000	
３００　１０年国債	286,000,000	292,100,380	
３０１　１０年国債	120,000,000	123,060,000	
３０２　１０年国債	240,000,000	245,750,400	
３０３　１０年国債	60,000,000	61,673,400	
３０４　１０年国債	110,000,000	112,869,900	
３０５　１０年国債	500,000,000	514,810,000	
３０６　１０年国債	255,000,000	264,021,900	
３０７　１０年国債	400,000,000	413,232,000	
３０８　１０年国債	200,000,000	207,322,000	
３０９　１０年国債	90,000,000	92,835,000	
３１０　１０年国債	130,000,000	134,119,700	
３１１　１０年国債	150,000,000	153,912,000	
３１２　１０年国債	395,000,000	411,052,800	
３１３　１０年国債	200,000,000	209,450,000	
３１４　１０年国債	260,000,000	270,566,400	
３１５　１０年国債	221,000,000	231,417,940	
３１６　１０年国債	250,000,000	260,895,000	
３１７　１０年国債	214,000,000	223,993,800	
３１８　１０年国債	200,000,000	208,578,000	
３１９　１０年国債	100,000,000	104,957,000	

３２０　１０年国債	230,000,000	240,467,300	
３２１　１０年国債	175,000,000	183,491,000	
３２２　１０年国債	130,000,000	135,747,300	
３２４　１０年国債	410,000,000	427,129,800	
３２５　１０年国債	310,000,000	323,596,600	
３２７　１０年国債	300,000,000	313,764,000	
３２８　１０年国債	330,000,000	342,282,600	
３２９　１０年国債	355,000,000	372,700,300	
３３０　１０年国債	262,000,000	275,582,080	
３３１　１０年国債	265,000,000	275,650,350	
３３２　１０年国債	310,000,000	322,899,100	
３３３　１０年国債	540,000,000	563,214,600	
３３４　１０年国債	600,000,000	626,622,000	
３３５　１０年国債	630,000,000	654,733,800	
３３６　１０年国債	175,000,000	182,124,250	
３３７　１０年国債	300,000,000	307,857,000	
３３８　１０年国債	390,000,000	403,283,400	
３３９　１０年国債	440,000,000	454,986,400	
３４０　１０年国債	680,000,000	703,392,000	
３４１　１０年国債	420,000,000	431,172,000	
３４２　１０年国債	700,000,000	707,266,000	
３４３　１０年国債	700,000,000	706,881,000	
３４４　１０年国債	540,000,000	544,984,200	
３４５　１０年国債	550,000,000	554,719,000	
３４６　１０年国債	750,000,000	755,910,000	
３４７　１０年国債	570,000,000	574,337,700	
３４８　１０年国債	180,000,000	181,229,400	
１　３０年国債	16,000,000	20,986,880	
２　３０年国債	24,000,000	30,531,600	
３　３０年国債	30,000,000	37,887,600	
４　３０年国債	36,000,000	48,463,920	
５　３０年国債	28,000,000	35,361,760	
６　３０年国債	24,000,000	31,086,960	
７　３０年国債	55,000,000	70,830,650	
８　３０年国債	27,000,000	32,942,700	
９　３０年国債	43,000,000	49,952,240	
１０　３０年国債	45,000,000	50,262,750	
１１　３０年国債	40,000,000	48,316,000	
１２　３０年国債	60,000,000	76,171,200	

１３　３０年国債	75,000,000	94,155,750	
１４　３０年国債	82,000,000	108,240,000	
１５　３０年国債	100,000,000	133,829,000	
１６　３０年国債	100,000,000	133,997,000	
１７　３０年国債	80,000,000	106,121,600	
１８　３０年国債	80,000,000	104,835,200	
１９　３０年国債	57,000,000	74,813,640	
２０　３０年国債	60,000,000	80,863,800	
２１　３０年国債	60,000,000	78,919,200	
２２　３０年国債	70,000,000	94,650,500	
２３　３０年国債	60,000,000	81,189,600	
２４　３０年国債	92,000,000	124,682,080	
２５　３０年国債	150,000,000	197,980,500	
２６　３０年国債	150,000,000	200,847,000	
２７　３０年国債	150,000,000	204,219,000	
２８　３０年国債	150,000,000	204,886,500	
２９　３０年国債	200,000,000	270,050,000	
３０　３０年国債	177,000,000	236,257,830	
３１　３０年国債	165,000,000	217,560,750	
３２　３０年国債	200,000,000	268,430,000	
３３　３０年国債	261,000,000	334,604,610	
３４　３０年国債	213,000,000	282,640,350	
３５　３０年国債	250,000,000	321,535,000	
３６　３０年国債	226,000,000	291,225,860	
３７　３０年国債	290,000,000	367,795,400	
３８　３０年国債	159,000,000	198,284,130	
３９　３０年国債	152,000,000	193,196,560	
４０　３０年国債	140,000,000	174,792,800	
４１　３０年国債	140,000,000	171,593,800	
４２　３０年国債	146,000,000	179,013,520	
４３　３０年国債	160,000,000	196,252,800	
４４　３０年国債	140,000,000	171,781,400	
４５　３０年国債	168,000,000	198,110,640	
４６　３０年国債	180,000,000	212,508,000	
４７　３０年国債	167,000,000	201,240,010	
４８　３０年国債	190,000,000	219,413,900	
４９　３０年国債	173,000,000	199,749,260	
５０　３０年国債	185,000,000	185,212,750	
５１　３０年国債	190,000,000	165,805,400	

５２　３０年国債	205,000,000	189,057,150	
５３　３０年国債	195,000,000	184,719,600	
５４　３０年国債	188,000,000	187,332,600	
５５　３０年国債	190,000,000	189,319,800	
５６　３０年国債	130,000,000	129,377,300	
４１　２０年国債	136,000,000	138,909,040	
４２　２０年国債	87,000,000	90,092,850	
４３　２０年国債	100,000,000	105,488,000	
４４　２０年国債	85,000,000	90,156,100	
４５　２０年国債	78,000,000	82,552,080	
４６　２０年国債	73,000,000	77,357,370	
４７　２０年国債	89,000,000	94,821,490	
４８　２０年国債	54,000,000	58,352,400	
４９　２０年国債	64,000,000	68,735,360	
５０　２０年国債	107,000,000	114,208,590	
５１　２０年国債	82,000,000	88,204,940	
５２　２０年国債	52,000,000	56,414,280	
５３　２０年国債	66,000,000	71,953,860	
５４　２０年国債	65,000,000	71,127,550	
５５　２０年国債	140,000,000	152,807,200	
５６　２０年国債	70,000,000	76,759,900	
５９　２０年国債	45,000,000	49,118,400	
６０　２０年国債	10,000,000	10,763,100	
６１　２０年国債	100,000,000	105,878,000	
６２　２０年国債	95,000,000	99,765,200	
６３　２０年国債	130,000,000	143,765,700	
６４　２０年国債	90,000,000	100,431,900	
６５　２０年国債	175,000,000	196,101,500	
６６　２０年国債	135,000,000	150,458,850	
６７　２０年国債	55,000,000	61,884,900	
６８　２０年国債	120,000,000	137,296,800	
６９　２０年国債	110,000,000	125,160,200	
７０　２０年国債	83,000,000	96,505,760	
７１　２０年国債	125,000,000	143,696,250	
７２　２０年国債	175,000,000	200,924,500	
７３　２０年国債	120,000,000	137,534,400	
７４　２０年国債	73,000,000	84,183,600	
７５　２０年国債	80,000,000	92,619,200	
７６　２０年国債	51,000,000	58,298,100	

７７　２０年国債	130,000,000	149,554,600	
７８　２０年国債	61,000,000	69,979,200	
７９　２０年国債	50,000,000	57,738,000	
８０　２０年国債	53,000,000	61,603,490	
８１　２０年国債	76,000,000	88,087,800	
８２　２０年国債	87,000,000	101,516,820	
８３　２０年国債	93,000,000	108,928,110	
８４　２０年国債	100,000,000	116,321,000	
８５　２０年国債	58,000,000	68,182,480	
８６　２０年国債	80,000,000	95,372,800	
８７　２０年国債	55,000,000	65,112,300	
８８　２０年国債	100,000,000	119,749,000	
８９　２０年国債	78,000,000	92,737,320	
９０　２０年国債	120,000,000	143,216,400	
９１　２０年国債	60,000,000	72,136,200	
９２　２０年国債	280,000,000	332,724,000	
９３　２０年国債	100,000,000	118,360,000	
９４　２０年国債	130,000,000	155,074,400	
９５　２０年国債	50,000,000	60,799,500	
９６　２０年国債	155,000,000	185,528,800	
９７　２０年国債	40,000,000	48,452,800	
９８　２０年国債	120,000,000	144,187,200	
９９　２０年国債	200,000,000	241,214,000	
１００　２０年国債	55,000,000	67,106,050	
１０１　２０年国債	75,000,000	93,043,500	
１０２　２０年国債	80,000,000	99,559,200	
１０３　２０年国債	70,000,000	86,381,400	
１０４　２０年国債	110,000,000	133,437,700	
１０５　２０年国債	126,000,000	153,320,580	
１０６　２０年国債	150,000,000	184,131,000	
１０７　２０年国債	107,000,000	130,589,220	
１０８　２０年国債	177,000,000	212,031,840	
１０９　２０年国債	35,000,000	42,056,700	
１１０　２０年国債	130,000,000	159,116,100	
１１１　２０年国債	100,000,000	123,891,000	
１１２　２０年国債	170,000,000	208,676,700	
１１３　２０年国債	230,000,000	282,962,100	
１１４　２０年国債	130,000,000	160,368,000	
１１５　２０年国債	160,000,000	199,273,600	

１１６　２０年国債	89,000,000	111,151,210	
１１７　２０年国債	215,000,000	265,914,150	
１１８　２０年国債	95,000,000	116,564,050	
１１９　２０年国債	93,000,000	111,752,520	
１２０　２０年国債	210,000,000	247,180,500	
１２１　２０年国債	135,000,000	164,245,050	
１２２　２０年国債	160,000,000	192,657,600	
１２３　２０年国債	140,000,000	174,256,600	
１２４　２０年国債	143,000,000	176,168,850	
１２５　２０年国債	85,000,000	107,146,750	
１２６　２０年国債	70,000,000	86,368,100	
１２７　２０年国債	165,000,000	201,443,550	
１２８　２０年国債	119,000,000	145,577,460	
１２９　２０年国債	160,000,000	193,625,600	
１３０　２０年国債	140,000,000	169,727,600	
１３１　２０年国債	130,000,000	155,758,200	
１３２　２０年国債	120,000,000	143,997,600	
１３３　２０年国債	210,000,000	254,851,800	
１３４　２０年国債	50,000,000	60,776,500	
１３５　２０年国債	92,000,000	110,481,880	
１３６　２０年国債	155,000,000	183,997,400	
１３７　２０年国債	85,000,000	102,222,700	
１３８　２０年国債	87,000,000	102,116,250	
１３９　２０年国債	125,000,000	148,575,000	
１４０　２０年国債	335,000,000	403,437,150	
１４１　２０年国債	170,000,000	204,846,600	
１４２　２０年国債	150,000,000	183,045,000	
１４３　２０年国債	210,000,000	250,275,900	
１４４　２０年国債	120,000,000	141,154,800	
１４５　２０年国債	285,000,000	343,995,000	
１４６　２０年国債	275,000,000	332,304,500	
１４７　２０年国債	170,000,000	202,896,700	
１４８　２０年国債	245,000,000	288,644,300	
１４９　２０年国債	232,000,000	273,291,360	
１５０　２０年国債	250,000,000	290,485,000	
１５１　２０年国債	300,000,000	338,562,000	
１５２　２０年国債	280,000,000	315,714,000	
１５３　２０年国債	315,000,000	360,290,700	
１５４　２０年国債	300,000,000	337,902,000	

	１５５　２０年国債	240,000,000	261,808,800	
	１５６　２０年国債	273,000,000	268,874,970	
	１５７　２０年国債	323,000,000	305,777,640	
	１５８　２０年国債	153,000,000	152,605,260	
	１５９　２０年国債	230,000,000	232,985,400	
	１６０　２０年国債	220,000,000	226,347,000	
	１６１　２０年国債	250,000,000	251,982,500	
	１６２　２０年国債	200,000,000	201,246,000	
国債証券　合計			56,883,147,780	
地方債証券	６６５　東京都公債	100,000,000	101,485,800	
	６８８　東京都公債	100,000,000	102,512,000	
	６９９　東京都公債	100,000,000	103,758,900	
	７１３　東京都公債	100,000,000	103,481,400	
	７５１　東京都公債	100,000,000	102,001,800	
	２４－１　北海道公債	100,000,000	104,123,300	
	２４－６　北海道公債	100,000,000	103,695,400	
	１６３　神奈川県公債	100,000,000	102,120,800	
	３１　神奈川県２０年	100,000,000	106,966,800	
	３６１　大阪府公債	100,000,000	103,955,300	
	４２０　大阪府公債	200,000,000	199,496,800	
	２２－５　京都府公債	100,000,000	103,716,100	
	２４－５　京都府公債	100,000,000	103,701,200	
	２６－１７　兵庫県公債	100,000,000	102,573,300	
	３　兵庫県公債１２年	200,000,000	206,608,400	
	１９兵庫県公債２０年	100,000,000	116,231,400	
	２６－１０　静岡県公債	100,000,000	102,982,000	
	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	103,633,300	
	２１－３　埼玉県公債	100,000,000	102,510,600	
	２９－１　福岡県公債	100,000,000	100,122,100	
	２１－２　千葉県公債	100,000,000	102,270,300	
	２１－６　千葉県公債	100,000,000	102,498,400	
	１６　千葉県２０年	100,000,000	116,411,000	
	７６　共同発行地方	50,000,000	51,125,000	
	８１　共同発行地方	100,000,000	102,655,600	
	９０　共同発行地方	100,000,000	103,018,000	
	１０８　共同発行地方	100,000,000	104,175,200	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	103,391,700	
	１２６　共同発行地方	100,000,000	104,299,600	
	１３１　共同発行地方	100,000,000	103,608,000	

	２３－２　島根県公債	100,000,000	103,941,800	
	２５－６　大阪市公債	200,000,000	207,313,400	
	４７１　名古屋市債	100,000,000	103,134,100	
	２１－５　京都市公債	100,000,000	103,156,200	
	２４－１０　神戸市公債	100,000,000	103,628,200	
	２４－３　横浜市公債	100,000,000	103,431,900	
	２４－５　札幌市公債	100,000,000	103,585,900	
	２１－３　広島市公債	100,000,000	102,697,000	
	２４－４　福井県公債	100,000,000	102,115,600	
	２２－１　岡山県公債	100,000,000	103,017,100	
地方債証券　合計			4,405,150,700	
特殊債券	１９　政保政策投資Ｃ	100,000,000	103,435,300	
	６１　道路機構	100,000,000	103,015,700	
	８１　道路機構	100,000,000	103,789,200	
	８６　政保道路機構	100,000,000	120,509,900	
	１１０　政保道路機構	100,000,000	103,313,700	
	１６８　政保道路機構	100,000,000	103,865,900	
	１７３　政保道路機構	100,000,000	103,900,800	
	１７５　政保道路機構	100,000,000	103,840,400	
	１８６　政保道路機構	100,000,000	103,449,300	
	１９０　政保道路機構	100,000,000	103,191,000	
	２３６　政保道路機構	100,000,000	102,021,500	
	２６１　政保道路機構	200,000,000	204,847,200	
	２８４　政保道路機構	200,000,000	184,952,200	
	３　公営企業１５年	100,000,000	107,589,600	
	１３　地方公共団体	100,000,000	103,153,500	
	２９　地方公共団体	100,000,000	103,792,200	
	３３　地方公共団体	100,000,000	104,147,500	
	３９政保地方公共団	100,000,000	103,721,300	
	Ｆ１４３地方公共団体	100,000,000	110,958,300	
	１　地方公共団１５年	100,000,000	111,039,400	
	４８　地方公共団体	100,000,000	103,982,400	
	５１　地方公共団体	100,000,000	104,313,000	
	１４政保地方公共６	100,000,000	100,468,300	
	６５　地方公共団体	100,000,000	102,941,200	
	７１　地方公共団体	100,000,000	102,562,600	
	２５　日本政策金融	100,000,000	104,006,500	
	２５　政保日本政策	100,000,000	104,181,900	
	１９　利付商工債	100,000,000	98,784,900	

	２４　政保中日本道	100,000,000	101,483,100	
特殊債券　合計			3,211,257,800	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	99,126,000	
	１７　シテイグループ・インク	100,000,000	105,128,800	
	８ドイツ銀行ＡＧロンドン	100,000,000	100,217,700	
	９　ＡＵＳＴ・ＮＺ銀行	100,000,000	100,392,800	
	２９　東日本高速道	100,000,000	100,257,200	
	２１　西日本高速道	100,000,000	103,586,800	
	１１　セブンアンドアイ	100,000,000	101,830,400	
	１４　武田薬品	100,000,000	100,783,000	
	４　ＪＸホールデイングス	100,000,000	104,842,900	
	２４　太平洋セメント	100,000,000	100,442,300	
	１　三菱ＵＦＪＦＧ　劣後	100,000,000	103,503,200	
	２０　東京三菱銀行	100,000,000	106,723,600	
	４　りそな銀行劣後	100,000,000	104,117,200	
	９三菱ＵＦＪ信託ＢＫ劣	100,000,000	105,128,100	
	１１三菱ＵＦＪ信託ＢＫ	100,000,000	105,283,300	
	２０　三井住友ＢＫ劣	100,000,000	103,487,200	
	４６　ＮＴＴフアイナンス	100,000,000	100,333,800	
	１５　トヨタフアイナンス	100,000,000	104,724,200	
	２　イオンＦＳ	100,000,000	100,638,000	
	１６４　オリックス	100,000,000	101,821,100	
	１７５　オリックス	100,000,000	104,500,000	
	４４　野村ホールデイング	100,000,000	101,656,500	
	６２東日本旅客鉄道	100,000,000	102,529,800	
	７２東日本旅客鉄道	100,000,000	103,695,000	
	１０７東日本旅客鉄	100,000,000	110,697,900	
	１８　西日本旅客鉄	100,000,000	101,725,000	
	４１　東海旅客鉄道	100,000,000	120,258,900	
	３７２　中国電力	100,000,000	104,967,000	
	２６０　北陸電力	100,000,000	105,627,700	
	４２３　九州電力	100,000,000	101,650,800	
	３０　大阪瓦斯	100,000,000	103,214,100	
社債券　合計			3,212,890,300	
合計			67,712,446,580	

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28年11月30日現在	平成29年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	―	348,838,841
コール・ローン	834,273,175	591,680,576
株式	75,856,759,279	90,681,988,461
投資証券	1,984,502,691	2,483,442,333
派生商品評価勘定	17,422,289	50,894,023
未収入金	321,945,202	910,881
未収配当金	162,157,303	160,250,126
差入委託証拠金	513,155,030	683,871,590
流動資産合計	79,690,214,969	95,001,876,831
資産合計	79,690,214,969	95,001,876,831
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	―	79,836
前受金	59,223,699	―
未払解約金	624,937,800	74,468,800
流動負債合計	684,161,499	74,548,636
負債合計	684,161,499	74,548,636
純資産の部		
元本等		
元本　※1	40,539,431,105	39,734,106,968
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	38,466,622,365	55,193,221,227
元本等合計	79,006,053,470	94,927,328,195
純資産合計	79,006,053,470	94,927,328,195
負債純資産合計	79,690,214,969	95,001,876,831

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　平成28年12月1日 至　平成29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28年11月30日現在	平成29年11月30日現在
1．※1　期首	平成27年12月1日	平成28年12月1日
期首元本額	38,848,551,378円	40,539,431,105円
期中追加設定元本額	5,066,388,246円	5,901,304,959円
期中一部解約元本額	3,375,508,519円	6,706,629,096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	725,982,741円	565,889,975円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	32,240,774円	18,626,936円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	463,206,991円	281,422,814円

ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	50,975,833円	32,623,332円	
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,543,587,080円	908,478,453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）	88,958,951円	399,976,869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）	147,732,667円	900,220,105円	
ダイワファンドラップオンライン 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	305,036,599円	
Ｄ－Ｉ'ｓ 外国株式インデックス	1,957,148円	992,761円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	182,021円	175,432円	
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	184,046,036円	391,225,801円	
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	31,235,406円	291,084,495円	
ＤＣダイワ外国株式インデックス	22,444,872,014円	24,052,269,212円	
ダイワ・ライフ・バランス３０	550,340,778円	500,509,712円	
ダイワ・ライフ・バランス５０	735,584,538円	709,804,567円	
ダイワ・ライフ・バランス７０	553,544,620円	564,304,287円	
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,470,526,931円	1,438,818,935円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	7,625,022円	5,379,290円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	15,729,186円	14,469,810円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	3,621,406円	3,513,286円	
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	100,000円	81,383円	

ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	197,107円	162,594円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	19,292,523円	2,143,628円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	163,931,206円	8,975,878円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	1,955,664,069円	506,282,561円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	519,301,921円	392,714,678円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	5,011,815,577円	3,809,894,746円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	231,056,464円	179,797,597円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	399,881,832円	498,683,806円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	17,952,452円	44,190,165円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	－円	464,730円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,006,649,223円	2,755,474,027円
ダイワライフスタイル２５	23,902,625円	20,423,108円
ダイワライフスタイル５０	78,118,426円	71,323,850円
ダイワライフスタイル７５	59,617,537円	58,671,546円
計	40,539,431,105円	39,734,106,968円
2. 期末日における受益権の総数	40,539,431,105口	39,734,106,968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28年12月1日 至　平成29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29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28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29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	2,054,830,722	13,300,631,037
投資証券	△33,857,099	212,840,757
合計	2,020,973,623	13,513,471,794

（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12月1日から平成28年11月30日まで、及び平成28年12月1日から平成29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

1．株式関連

種　類	平成28年11月30日 現在				平成29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	1,097,458,092	－	1,114,880,381	17,422,289	1,687,670,488	－	1,735,374,375	47,703,887
合計	1,097,458,092	－	1,114,880,381	17,422,289	1,687,670,488	－	1,735,374,375	47,703,887

（注）　1．　時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種　類	平成28年11月30日 現在				平成29年11月30日 現在			
	契約額等（円）	うち	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち	時価（円）	評価損益（円）

		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	－	－	－	－	500,889,700	－	504,000,000	3,110,300
アメリカ・ドル	－	－	－	－	500,889,700	－	504,000,000	3,110,300
合計	－	－	－	－	500,889,700	－	504,000,000	3,110,300

（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28年11月30日現在	平成29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）	1.9489円 (19,489円)	2.3891円 (23,891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	89.120	240,624.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,100	144.900	304,290.000	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,350	137.870	186,124.500	
SYNCHRONY FINANCIAL	18,800	35.350	664,580.000	
ABBOTT LABORATORIES	39,616	55.580	2,201,857.280	
ARCONIC INC	8,933	24.070	215,017.310	
VERISK ANALYTICS INC	3,500	94.980	332,430.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	9,200	67.560	621,552.000	
AMPHENOL CORP-CL A	6,950	89.770	623,901.500	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,579	92.720	702,724.880	
QORVO INC	2,900	76.690	222,401.000	
AFLAC INC	9,200	87.190	802,148.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	2,750	84.810	233,227.500	
ADOBE SYSTEMS INC	11,350	176.850	2,007,247.500	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,500	36.850	202,675.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,500	66.870	167,175.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	8,000	19.260	154,080.000	
GARMIN LTD	2,900	62.400	180,960.000	
AETNA INC	7,579	179.570	1,360,961.030	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,050	162.620	821,231.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16,500	153.240	2,528,460.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,751	72.330	271,309.830	
WR BERKLEY CORP	2,300	68.500	157,550.000	
AUTOZONE INC	630	688.920	434,019.600	
DOLLAR TREE INC	5,321	104.140	554,128.940	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,900	15.070	314,963.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,650	91.010	241,176.500	
CELANESE CORP-SERIES A	3,300	106.880	352,704.000	
DR HORTON INC	8,316	50.660	421,288.560	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,100	46.050	96,705.000	
DENTSPLY SIRONA INC	5,200	68.360	355,472.000	
AUTODESK INC	4,550	109.340	497,497.000	
MOODY'S CORP	4,000	149.840	599,360.000	
DEVON ENERGY CORP	11,750	37.100	435,925.000	
ALBEMARLE CORP	2,600	131.950	343,070.000	
ATMOS ENERGY CORP	2,500	90.510	226,275.000	

ALLIANT ENERGY CORP	5,400	44.900	242,460.000	
CITIGROUP INC	62,823	75.040	4,714,237.920	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,300	113.330	1,167,299.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	11,400	77.140	879,396.000	
ALLEGHANY CORP	350	584.240	204,484.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	179.170	197,087.000	
HESS CORP	6,500	44.810	291,265.000	
DAVITA INC	3,500	60.640	212,240.000	
DANAHER CORP	14,200	93.940	1,333,948.000	
FORTIVE CORP	7,200	73.420	528,624.000	
AVNET INC	2,800	41.240	115,472.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	13,500	69.800	942,300.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,000	13.570	54,280.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,028	12.180	49,061.040	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,900	39.770	513,033.000	
BUNGE LTD	3,100	66.420	205,902.000	
TE CONNECTIVITY LTD	8,225	94.250	775,206.250	
APPLE INC	118,900	169.480	20,151,172.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8,600	69.010	593,486.000	
BOEING CO/THE	13,050	269.300	3,514,365.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,465	74.870	259,424.550	
BECTON DICKINSON AND CO	5,187	226.880	1,176,826.560	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,000	25.850	155,100.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,300	62.390	205,887.000	
CDK GLOBAL INC	2,900	69.010	200,129.000	
NISOURCE INC	7,300	27.170	198,341.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,350	84.490	283,041.500	
CR BARD INC	1,680	336.810	565,840.800	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	23,671	54.410	1,287,939.110	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	93,404	49.900	4,660,859.600	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	28,550	189.850	5,420,217.500	
ANSYS INC	1,900	146.580	278,502.000	
H&R BLOCK INC	5,100	25.870	131,937.000	
BB&T CORP	18,750	49.120	921,000.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	37,850	62.900	2,380,765.000	
JPMORGAN CHASE & CO	81,320	103.730	8,435,323.600	
T ROWE PRICE GROUP INC	5,600	101.270	567,112.000	

CIGNA CORP	5,900	205.830	1,214,397.000	
LKQ CORP	7,200	39.500	284,400.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,000	136.440	136,440.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,550	59.200	269,360.000	
CADENCE DESIGN SYS INC	6,400	43.160	276,224.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,460	163.560	565,917.600	
DOLLAR GENERAL CORP	6,200	88.680	549,816.000	
SERVICENOW INC	3,950	120.590	476,330.500	
CATERPILLAR INC	13,500	138.060	1,863,810.000	
CMS ENERGY CORP	6,400	49.610	317,504.000	
MOSAIC CO/THE	7,550	24.390	184,144.500	
DELTA AIR LINES INC	4,400	52.100	229,240.000	
CORNING INC	21,300	32.480	691,824.000	
CISCO SYSTEMS INC	114,100	37.480	4,276,468.000	
MORGAN STANLEY	31,800	51.320	1,631,976.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,250	149.830	187,287.500	
MSCI INC	2,150	127.730	274,619.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	900	203.830	183,447.000	
MIDDLEBY CORP	1,300	125.320	162,916.000	
COTY INC-CL A	11,139	17.090	190,365.510	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,100	40.990	168,059.000	
BROADCOM LTD	9,152	271.500	2,484,768.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,050	129.120	135,576.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,000	29.460	58,920.000	
ACUITY BRANDS INC	1,000	170.450	170,450.000	
ARAMARK	5,850	42.580	249,093.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,900	37.550	183,995.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,150	114.560	475,424.000	
CENTENE CORP	4,000	99.010	396,040.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,400	120.930	290,232.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	11,600	40.670	471,772.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,050	66.420	269,001.000	
GARTNER INC	2,100	119.310	250,551.000	
SPLUNK INC	3,200	79.490	254,368.000	
AGCO CORP	1,450	70.900	102,805.000	
DOMINION ENERGY INC	14,300	84.000	1,201,200.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,300	61.890	575,577.000	
SMITH (A.O.) CORP	3,400	62.500	212,500.000	
DEERE & CO	6,150	148.440	912,906.000	

GLOBAL PAYMENTS INC	3,600	98.960	356,256.000	
TIME WARNER INC	17,633	90.920	1,603,192.360	
VMWARE INC-CLASS A	1,650	119.420	197,043.000	
NASDAQ INC	2,700	78.560	212,112.000	
VAIL RESORTS INC	950	223.830	212,638.500	
EAST WEST BANCORP INC	3,400	61.560	209,304.000	
TARGA RESOURCES CORP	5,050	41.730	210,736.500	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,500	164.170	246,255.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,800	105.270	189,486.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	7,000	88.400	618,800.000	
MEDNAX INC	2,200	50.180	110,396.000	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,400	112.270	269,448.000	
TELEFLEX INC	1,000	264.410	264,410.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,100	108.640	228,144.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,500	58.880	147,200.000	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	1,750	65.860	115,255.000	
IDEX CORP	1,800	132.500	238,500.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	19,150	72.010	1,378,991.500	
ROLLINS INC	2,200	46.110	101,442.000	
AMETEK INC	5,225	71.680	374,528.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,800	46.790	271,382.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,200	41.750	133,600.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,950	105.010	834,829.500	
COSTCO WHOLESALE CORP	10,050	177.530	1,784,176.500	
SCANA CORP	3,100	43.740	135,594.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,350	198.630	268,150.500	
WR GRACE & CO	1,600	73.800	118,080.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	600	301.990	181,194.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,600	26.630	202,388.000	
UGI CORP	3,900	47.990	187,161.000	
CUMMINS INC	3,700	164.520	608,724.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	16,300	62.010	1,010,763.000	
SABRE CORP	4,600	19.820	91,172.000	
CDW CORP/DE	3,750	68.910	258,412.500	
SIGNATURE BANK	1,300	138.730	180,349.000	
COSTAR GROUP INC	850	301.860	256,581.000	

SVB FINANCIAL GROUP	1,200	226.980	272,376.000	
AMERCO	170	367.580	62,488.600	
MERCADOLIBRE INC	1,000	267.700	267,700.000	
HANESBRANDS INC	8,500	20.310	172,635.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,800	113.900	205,020.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,566	76.560	349,572.960	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,600	36.440	167,624.000	
DEXCOM INC	1,900	59.380	112,822.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,050	108.150	221,707.500	
SEATTLE GENETICS INC	2,250	59.140	133,065.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,770	258.370	457,314.900	
TRANSDIGM GROUP INC	1,200	279.320	335,184.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	8,000	36.320	290,560.000	
KINDER MORGAN INC	46,081	16.760	772,317.560	
HCA HEALTHCARE INC	6,800	80.140	544,952.000	
CABOT OIL & GAS CORP	10,550	29.170	307,743.500	
T-MOBILE US INC	6,850	61.830	423,535.500	
ZILLOW GROUP INC - C	2,500	40.870	102,175.000	
COCA-COLA CO/THE	92,950	45.500	4,229,225.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,000	64.410	257,640.000	
EATON VANCE CORP	2,500	54.630	136,575.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	7,600	43.130	327,788.000	
CSX CORP	20,950	54.440	1,140,518.000	
FLUOR CORP	3,300	48.200	159,060.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,350	157.020	368,997.000	
EXPEDIA INC	2,875	122.020	350,807.500	
AUTOLIV INC	2,000	126.820	253,640.000	
AMAZON.COM INC	9,300	1,161.270	10,799,811.000	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	5,000	26.360	131,800.000	
FLOWSERVE CORP	2,900	41.510	120,379.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,900	116.370	570,213.000	
EXXON MOBIL CORP	97,105	82.270	7,988,828.350	
FLIR SYSTEMS INC	3,100	46.560	144,336.000	
AES CORP	15,600	10.610	165,516.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	1,800	196.450	353,610.000	
EVEREST RE GROUP LTD	900	222.740	200,466.000	
EOG RESOURCES INC	13,250	100.500	1,331,625.000	

EQT CORP	4,050	58.110	235,345.500	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,900	55.340	215,826.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,800	84.660	321,708.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,290	68.690	500,750.100	
FORD MOTOR CO	85,323	12.560	1,071,656.880	
TESARO INC	900	83.050	74,745.000	
MACY'S INC	6,898	23.980	165,414.040	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,440	18.870	64,912.800	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	32.280	157,752.360	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,120	17.780	91,033.600	
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	300	110.180	33,054.000	
AERCAP HOLDINGS NV	3,800	51.740	196,612.000	
FORTINET INC	3,500	41.440	145,040.000	
MARKEL CORP	320	1,103.740	353,196.800	
NEXTERA ENERGY INC	10,700	157.770	1,688,139.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	31,808	14.010	445,630.080	
US BANCORP	38,700	54.760	2,119,212.000	
UNITED RENTALS INC	1,900	157.840	299,896.000	
F5 NETWORKS INC	1,450	129.860	188,297.000	
FASTENAL CO	6,500	51.240	333,060.000	
FISERV INC	4,950	128.720	637,164.000	
GENERAL ELECTRIC CO	199,100	18.480	3,679,368.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4,350	55.290	240,511.500	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,650	32.140	181,591.000	
GENERAL MOTORS CO	31,100	43.810	1,362,491.000	
TRIPADVISOR INC	2,750	34.570	95,067.500	
GENERAL DYNAMICS CORP	5,900	204.170	1,204,603.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,160	241.360	1,969,497.600	
ALPHABET INC-CL A	6,810	1,037.380	7,064,557.800	
ALPHABET INC-CL C	7,147	1,021.660	7,301,804.020	
GENERAL MILLS INC	13,000	56.340	732,420.000	
FIRSTENERGY CORP	9,968	33.670	335,622.560	
GENUINE PARTS CO	3,500	91.500	320,250.000	
IHS MARKIT LTD	9,534	44.160	421,021.440	
FIFTH THIRD BANCORP	17,500	30.460	533,050.000	
HARRIS CORP	2,750	143.220	393,855.000	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	49.250	147,750.000	
HALLIBURTON CO	19,850	41.300	819,805.000	

HOME DEPOT INC	27,350	177.250	4,847,787.500	
ASSURANT INC	1,250	101.710	127,137.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,600	14.480	356,208.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,100	239.680	263,648.000	
HERSHEY CO/THE	3,300	110.500	364,650.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,000	48.980	195,920.000	
HUMANA INC	3,300	250.130	825,429.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,200	113.000	926,600.000	
HELMERICH & PAYNE	2,600	57.040	148,304.000	
HENRY SCHEIN INC	3,600	70.300	253,080.000	
HP INC	38,900	21.430	833,627.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	37,700	13.970	526,669.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,000	40.900	163,600.000	
HOLLYFRONTIER CORP	3,900	44.330	172,887.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,100	40.810	85,701.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,900	96.230	279,067.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	13,853	81.090	1,123,339.770	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,450	153.550	3,140,097.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	9,100	55.520	505,232.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,600	66.870	240,732.000	
ZOETIS INC	11,400	71.610	816,354.000	
INGERSOLL-RAND PLC	5,779	86.070	497,398.530	
CHENIERE ENERGY INC	4,700	48.000	225,600.000	
ALLEGION PLC	2,200	82.940	182,468.000	
LEGGETT & PLATT INC	3,100	48.100	149,110.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	13,023	31.270	407,229.210	
WASTE CONNECTIONS INC	6,157	69.100	425,448.700	
JUNIPER NETWORKS INC	8,900	29.610	263,529.000	
JM SMUCKER CO/THE	2,720	117.660	320,035.200	
JOHNSON & JOHNSON	61,400	139.810	8,584,334.000	
ABBVIE INC	36,429	95.820	3,490,626.780	
HOLOGIC INC	6,550	42.270	276,868.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	8,150	119.140	970,991.000	
KROGER CO	20,600	24.380	502,228.000	
KLA-TENCOR CORP	3,650	100.350	366,277.500	

LOCKHEED MARTIN CORP	6,000	320.760	1,924,560.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,100	179.520	376,992.000	
L BRANDS INC	5,600	52.530	294,168.000	
LOWE'S COS INC	19,700	83.300	1,641,010.000	
ELI LILLY & CO	22,550	84.960	1,915,848.000	
LAM RESEARCH CORP	3,700	194.640	720,168.000	
RANGE RESOURCES CORP	5,700	18.000	102,600.000	
JONES LANG LASALLE INC	1,000	151.660	151,660.000	
LOEWS CORP	6,500	50.330	327,145.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,149	76.550	394,155.950	
MCDONALD'S CORP	18,550	170.430	3,161,476.500	
3M CO	13,700	238.010	3,260,737.000	
FACEBOOK INC-A	54,150	175.130	9,483,289.500	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,804	77.990	374,663.960	
MANPOWERGROUP INC	1,500	129.810	194,715.000	
S&P GLOBAL INC	5,950	164.730	980,143.500	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,400	208.510	291,914.000	
CONCHO RESOURCES INC	3,450	137.510	474,409.500	
ENVISION HEALTHCARE CORP	2,636	31.830	83,903.880	
FIRST DATA CORP- CLASS A	10,300	16.170	166,551.000	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	4,300	35.350	152,005.000	
PHILLIPS 66	9,950	94.910	944,354.500	
MURPHY OIL CORP	3,600	28.120	101,232.000	
TECHNIPFMC PLC	10,000	27.570	275,700.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	10,750	33.650	361,737.500	
MATTEL INC	7,800	18.240	142,272.000	
DXC TECHNOLOGY CO	6,538	95.520	624,509.760	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,650	102.120	270,618.000	
MYLAN NV	10,450	36.860	385,187.000	
METLIFE INC	20,850	53.550	1,116,517.500	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,100	22.210	202,111.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,100	234.210	257,631.000	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,500	49.780	124,450.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,828	94.170	360,482.760	
MONSANTO CO	10,056	117.710	1,183,691.760	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	625.440	375,264.000	
BAKER HUGHES A GE CO	9,173	29.980	275,006.540	

ROCKWELL AUTOMATION INC	2,950	190.130	560,883.500	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1,940	59.440	115,313.600	
MERCK & CO. INC.	62,771	55.360	3,475,002.560	
DOWDUPONT INC	53,505	71.780	3,840,588.900	
MASCO CORP	7,400	42.030	311,022.000	
M & T BANK CORP	3,169	169.110	535,909.590	
MARSH & MCLENNAN COS	11,750	83.600	982,300.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,472	126.490	945,133.280	
WORKDAY INC-CLASS A	2,950	106.540	314,293.000	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,550	58.650	208,207.500	
VANTIV INC - CL A	3,850	72.250	278,162.500	
NETAPP INC	6,150	56.230	345,814.500	
NIKE INC -CL B	30,050	60.360	1,813,818.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,700	136.410	913,947.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,350	86.580	463,203.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,000	88.400	265,200.000	
ALLY FINANCIAL INC	10,200	26.660	271,932.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,830	306.690	1,174,622.700	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,200	102.050	632,710.000	
NEWMONT MINING CORP	12,000	36.600	439,200.000	
MCKESSON CORP	4,900	148.120	725,788.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,400	52.110	333,504.000	
XYLEM INC	4,200	68.200	286,440.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	35,600	102.680	3,655,408.000	
NUCOR CORP	7,400	57.360	424,464.000	
WESTERN UNION CO	11,346	19.700	223,516.200	
NEWELL BRANDS INC	10,892	30.510	332,314.920	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,400	69.900	1,216,260.000	
LIBERTY BROADBAND-C	2,550	87.820	223,941.000	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	600	115.080	69,048.000	
PAYCHEX INC	7,550	66.580	502,679.000	
PATTERSON COS INC	1,900	36.950	70,205.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,120	236.320	500,998.400	
ALTRIA GROUP INC	44,250	67.370	2,981,122.500	
P G & E CORP	11,600	55.060	638,696.000	
PFIZER INC	136,363	36.210	4,937,704.230	
ALKERMES PLC	3,600	51.450	185,220.000	

XCEL ENERGY INC	11,500	51.260	589,490.000	
STRYKER CORP	7,650	154.100	1,178,865.000	
PARKER HANNIFIN CORP	3,050	184.320	562,176.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,900	151.160	589,524.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,400	129.060	180,684.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	58,617	89.380	5,239,187.460	
EXELON CORP	21,222	41.690	884,745.180	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,100	107.370	547,587.000	
NVR INC	80	3,468.400	277,472.000	
CONOCOPHILLIPS	28,250	50.730	1,433,122.500	
PEPSICO INC	32,600	116.840	3,808,984.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,900	115.870	1,147,113.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,050	90.350	365,917.500	
ACCENTURE PLC-CL A	14,200	146.950	2,086,690.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,950	53.560	104,442.000	
PENTAIR PLC	4,005	69.320	277,626.600	
QUALCOMM INC	33,600	66.520	2,235,072.000	
INVESCO LTD	9,150	36.100	330,315.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,700	99.950	169,915.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,600	71.540	472,164.000	
RAYTHEON COMPANY	6,700	188.580	1,263,486.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,050	81.370	166,808.500	
RED HAT INC	4,000	124.490	497,960.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,810	358.630	649,120.300	
REPUBLIC SERVICES INC	5,350	64.310	344,058.500	
PRICELINE GROUP INC/THE	1,120	1,734.450	1,942,584.000	
ROSS STORES INC	9,000	75.950	683,550.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,100	115.090	241,689.000	
RESMED INC	3,250	85.250	277,062.500	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,100	97.330	301,723.000	
ROBERT HALF INTL INC	2,800	56.820	159,096.000	
RALPH LAUREN CORP	1,300	94.650	123,045.000	
AUTONATION INC	1,700	55.360	94,112.000	
ROCKWELL COLLINS INC	3,663	131.980	483,442.740	
REGIONS FINANCIAL CORP	27,435	16.570	454,597.950	
CHEVRON CORP	43,218	117.180	5,064,285.240	
EDISON INTERNATIONAL	7,500	81.410	610,575.000	
TESLA INC	3,040	307.540	934,921.600	

SYMANTEC CORP	13,900	28.570	397,123.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,472	167.610	581,941.920	
SYNOPSYS INC	3,400	86.770	295,018.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,905	331.670	1,626,841.350	
CBRE GROUP INC - A	7,100	42.990	305,229.000	
TWITTER INC	14,400	20.790	299,376.000	
NAVIENT CORP	7,100	12.830	91,093.000	
SOUTHERN CO/THE	22,550	51.090	1,152,079.500	
SYSCO CORP	11,800	57.700	680,860.000	
TRAVELERS COS INC/THE	6,473	134.530	870,812.690	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,200	69.780	223,296.000	
STERICYCLE INC	1,950	65.290	127,315.500	
STEEL DYNAMICS INC	5,700	37.870	215,859.000	
SCHLUMBERGER LTD	31,652	62.150	1,967,171.800	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,900	50.160	195,624.000	
AT&T INC	140,291	36.480	5,117,815.680	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	58.880	200,192.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,930	393.960	760,342.800	
SEMPRA ENERGY	5,400	120.260	649,404.000	
TIFFANY & CO	2,800	92.550	259,140.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,100	38.750	275,125.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	22,750	96.880	2,204,020.000	
SALESFORCE.COM INC	15,450	103.530	1,599,538.500	
SIGNET JEWELERS LTD	1,300	52.380	68,094.000	
WESTROCK CO	5,930	60.260	357,341.800	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	21,584	38.090	822,134.560	
ANDEAVOR	3,450	105.150	362,767.500	
UNION PACIFIC CORP	18,600	122.940	2,286,684.000	
MARATHON OIL CORP	19,000	14.750	280,250.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	11,900	61.400	730,660.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,450	118.160	2,061,892.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,700	119.040	1,868,928.000	
UNUM GROUP	5,400	56.420	304,668.000	
SPRINT CORP	17,765	6.070	107,833.550	
ANTERO RESOURCES CORP	5,100	18.760	95,676.000	
IQVIA HOLDINGS INC	3,194	101.310	323,584.140	

VOYA FINANCIAL INC	4,500	43.930	197,685.000	
AMEREN CORPORATION	5,500	63.680	350,240.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	22,076	222.880	4,920,298.880	
VERISIGN INC	2,200	114.740	252,428.000	
VALERO ENERGY CORP	10,342	83.340	861,902.280	
ULTA BEAUTY INC	1,310	223.100	292,261.000	
FNF GROUP	5,738	40.210	230,724.980	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,000	107.470	214,940.000	
ANTHEM INC	6,050	227.310	1,375,225.500	
WALT DISNEY CO/THE	35,850	105.240	3,772,854.000	
WELLS FARGO & CO	108,472	56.680	6,148,192.960	
FOOT LOCKER INC	3,200	42.590	136,288.000	
WASTE MANAGEMENT INC	10,000	82.620	826,200.000	
WILLIAMS COS INC	18,700	28.320	529,584.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,100	69.360	215,016.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	168.990	287,283.000	
WAL-MART STORES INC	34,650	97.560	3,380,454.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,600	116.520	535,992.000	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	22,100	3.220	71,162.000	
WYNN RESORTS LTD	1,950	156.070	304,336.500	
XEROX CORP	4,811	29.300	140,962.300	
WABTEC CORP	1,900	77.000	146,300.000	
TJX COMPANIES INC	14,850	74.780	1,110,483.000	
WATERS CORP	1,800	195.680	352,224.000	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,800	62.090	111,762.000	
ALLERGAN PLC	7,657	175.690	1,345,258.330	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,100	71.920	1,517,512.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,983	159.070	474,505.810	
WESTERN DIGITAL CORP	6,750	81.000	546,750.000	
WEC ENERGY GROUP INC	7,130	69.260	493,823.800	
WESTAR ENERGY INC	3,200	56.290	180,128.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,750	52.700	619,225.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	42,300	109.860	4,647,078.000	
PPL CORP	15,400	36.610	563,794.000	
PULTEGROUP INC	6,700	33.810	226,527.000	
PPG INDUSTRIES INC	5,950	117.010	696,209.500	

NORTHERN TRUST CORP	4,900	98.240	481,376.000	
NVIDIA CORP	13,650	196.420	2,681,133.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,093	139.730	1,550,024.890	
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	9,550	24.470	233,688.500	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4,700	36.540	171,738.000	
TYSON FOODS INC-CL A	6,500	82.020	533,130.000	
NETFLIX INC	9,900	188.150	1,862,685.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,950	192.620	1,723,949.000	
TORCHMARK CORP	2,675	89.090	238,315.750	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,700	96.480	356,976.000	
TEXTRON INC	6,350	54.840	348,234.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	23,950	32.100	768,795.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,300	31.300	322,390.000	
NEWS CORP - CLASS A	8,337	16.350	136,309.950	
OGE ENERGY CORP	4,700	35.280	165,816.000	
OMNICOM GROUP	5,400	72.930	393,822.000	
ORACLE CORP	70,733	48.520	3,431,965.160	
MASTERCARD INC - A	21,750	148.350	3,226,612.500	
ONEOK INC	8,800	50.430	443,784.000	
CENTURYLINK INC	22,652	14.540	329,360.080	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,300	262.240	603,152.000	
YUM! BRANDS INC	7,500	81.810	613,575.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,150	233.210	268,191.500	
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,350	76.520	332,862.000	
NOBLE ENERGY INC	10,900	25.910	282,419.000	
BANK OF AMERICA CORP	228,001	28.280	6,447,868.280	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,100	83.270	341,407.000	
NORDSTROM INC	3,000	45.760	137,280.000	
AMERICAN EXPRESS CO	17,350	96.600	1,676,010.000	
ANALOG DEVICES INC	8,299	85.660	710,892.340	
ADVANCED MICRO DEVICES	18,000	10.830	194,940.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	6,000	50.870	305,220.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	21,022	60.300	1,267,626.600	
ANADARKO PETROLEUM CORP	12,700	47.880	608,076.000	

SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,150	105.330	437,119.500	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,000	124.700	498,800.000	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,500	30.100	135,450.000	
MALLINCKRODT PLC	2,500	22.130	55,325.000	
AVERY DENNISON CORP	2,100	111.880	234,948.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,600	72.110	980,696.000	
EMERSON ELECTRIC CO	14,900	63.870	951,663.000	
AON PLC	6,000	140.470	842,820.000	
AMGEN INC	16,850	172.230	2,902,075.500	
CORE LABORATORIES N.V.	1,000	99.590	99,590.000	
TAPESTRY INC	6,400	41.510	265,664.000	
EATON CORP PLC	10,136	76.840	778,850.240	
CELGENE CORP	17,800	103.120	1,835,536.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,880	214.360	831,716.800	
APPLIED MATERIALS INC	24,500	52.910	1,296,295.000	
CIT GROUP INC	3,300	49.720	164,076.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,250	114.230	257,017.500	
CME GROUP INC	7,800	147.830	1,153,074.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,844	32.610	288,402.840	
ECOLAB INC	5,900	135.000	796,500.000	
EQUIFAX INC	2,750	112.650	309,787.500	
GAP INC/THE	5,800	32.500	188,500.000	
GILEAD SCIENCES INC	30,000	73.670	2,210,100.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,148	89.460	371,080.080	
HORMEL FOODS CORP	6,850	35.990	246,531.500	
STATE STREET CORP	8,743	94.680	827,787.240	
SUNTRUST BANKS INC	11,198	61.300	686,437.400	
SCHWAB (CHARLES) CORP	27,700	48.420	1,341,234.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,350	65.180	739,793.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,100	48.990	200,859.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,100	59.220	183,582.000	
CARDINAL HEALTH INC	7,150	59.110	422,636.500	
FEDEX CORP	5,850	225.930	1,321,690.500	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,954	90.970	996,485.380	
FMC CORP	3,150	93.210	293,611.500	
FLEX LTD	12,200	18.110	220,942.000	
CERNER CORP	6,700	69.770	467,459.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,800	154.560	278,208.000	
CITRIX SYSTEMS INC	3,500	87.000	304,500.000	

INTEL CORP	107,900	43.950	4,742,205.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,800	20.050	176,440.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,250	57.650	475,612.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	7,050	165.880	1,169,454.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,500	5.480	210,980.000	
ILLUMINA INC	3,350	227.480	762,058.000	
SEALED AIR CORP	4,400	47.340	208,296.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,520	394.300	993,636.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,900	102.060	295,974.000	
SNAP-ON INC	1,300	167.220	217,386.000	
CARMAX INC	4,250	68.500	291,125.000	
COMERICA INC	4,000	83.490	333,960.000	
INGREDION INC	1,600	139.750	223,600.000	
DUKE ENERGY CORP	16,078	89.000	1,430,942.000	
TARGET CORP	11,950	61.680	737,076.000	
DOVER CORP	3,500	95.860	335,510.000	
WW GRAINGER INC	1,300	216.770	281,801.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,900	64.830	188,007.000	
CINTAS CORP	2,100	153.730	322,833.000	
CA INC	7,105	32.580	231,480.900	
CONAGRA BRANDS INC	9,500	37.200	353,400.000	
CLOROX COMPANY	2,950	139.220	410,699.000	
ENTERGY CORP	4,200	86.150	361,830.000	
MICROSOFT CORP	167,550	83.340	13,963,617.000	
INCYTE CORP	4,050	95.960	388,638.000	
CVS HEALTH CORP	23,174	73.400	1,700,971.600	
MEDTRONIC PLC	31,438	82.110	2,581,374.180	
MICRON TECHNOLOGY INC	24,100	43.740	1,054,134.000	
BLACKROCK INC	2,750	500.820	1,377,255.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	9,100	29.670	269,997.000	
HASBRO INC	2,600	92.840	241,384.000	
KELLOGG CO	6,100	66.800	407,480.000	
KEYCORP	24,700	19.010	469,547.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,400	110.120	264,288.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	35,011	42.940	1,503,372.340	
KOHLS CORP	3,900	47.700	186,030.000	

COOPER COS INC/THE	1,100	242.590	266,849.000	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	11,100	13.480	149,628.000	
APACHE CORP	8,760	40.740	356,882.400	
CHUBB LTD	10,649	152.640	1,625,463.360	
ARROW ELECTRONICS INC	2,000	80.320	160,640.000	
ALLSTATE CORP	8,350	101.960	851,366.000	
EBAY INC	23,400	34.380	804,492.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	26,150	73.250	1,915,487.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	3,250	91.410	297,082.500	
XILINX INC	5,600	69.380	388,528.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	13,510	62.860	849,238.600	
DISH NETWORK CORP-A	5,300	51.280	271,784.000	
ZIONS BANCORPORATION	4,800	49.490	237,552.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,150	123.930	638,239.500	
TOLL BROTHERS INC	3,800	50.090	190,342.000	
TRIMBLE INC	5,900	41.440	244,496.000	
LENNAR CORP-A	4,800	62.180	298,464.000	
LEAR CORP	1,550	179.100	277,605.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	6,500	47.780	310,570.000	
PROGRESSIVE CORP	13,400	52.450	702,830.000	
PRAXAIR INC	6,500	155.170	1,008,605.000	
PACCAR INC	7,987	69.010	551,182.870	
PVH CORP	1,750	137.140	239,995.000	
BIOGEN INC	4,880	319.960	1,561,404.800	
IDEXX LABORATORIES INC	2,000	154.000	308,000.000	
STARBUCKS CORP	33,100	57.510	1,903,581.000	
PERRIGO CO PLC	3,050	87.720	267,546.000	
EVERSOURCE ENERGY	7,130	64.610	460,669.300	
INTUIT INC	5,600	154.220	863,632.000	
BORGWARNER INC	4,800	54.860	263,328.000	
BEST BUY CO INC	6,500	58.830	382,395.000	
BALL CORP	7,584	39.560	300,023.040	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	31,047	25.950	805,669.650	
BED BATH & BEYOND INC	3,600	23.060	83,016.000	
XL GROUP LTD	6,100	39.540	241,194.000	
ELECTRONIC ARTS INC	7,100	105.490	748,979.000	
VULCAN MATERIALS CO	3,050	124.860	380,823.000	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,650	143.750	812,187.500	
VF CORP	7,750	74.130	574,507.500	

	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	8,371	56.540	473,296.340	
	VIACOM INC-CLASS B	8,171	28.420	232,219.820	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,470	279.100	410,277.000	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,300	16.370	103,131.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,200	111.220	244,684.000	
	CARNIVAL CORP	8,050	65.700	528,885.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	108,440	37.190	4,032,883.600	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	5,200	42.630	221,676.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,800	64.790	310,992.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	26,500	7.230	191,595.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 525,149,435.990 (58,842,994,303)	
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	3.559	58,011.700	
	TUI AG-DI	10,247	13.460	137,924.620	
	BP PLC	460,700	4.945	2,278,161.500	
	UNILEVER PLC	30,110	42.160	1,269,437.600	
	BARCLAYS PLC	395,500	1.942	768,258.750	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	38,400	8.610	330,624.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	38,100	3.124	119,024.400	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,150	69.150	148,672.500	
	PRUDENTIAL PLC	60,200	19.000	1,143,800.000	
	INMARSAT PLC	10,300	4.839	49,841.700	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	83,891	2.816	236,237.050	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,564	30.590	139,612.760	
	BAE SYSTEMS PLC	74,800	5.440	406,912.000	
	AVIVA PLC	96,066	5.090	488,975.940	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	114,502	13.075	1,497,113.650	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	10,000	24.980	249,800.000	
	WORLDPAY GROUP PLC	47,100	4.180	196,878.000	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	8,000	5.400	43,200.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	22,400	3.375	75,600.000	
	DCC PLC	2,000	72.400	144,800.000	
	CONVATEC GROUP PLC	33,000	1.911	63,063.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	1,766,400	0.001	1,766.400	

ROYAL MAIL PLC	22,400	4.368	97,843.200	
RELX PLC	24,846	17.500	434,805.000	
DIAGEO PLC	58,600	25.935	1,519,791.000	
RIO TINTO PLC	28,700	35.180	1,009,666.000	
STANDARD CHARTERED PLC	77,900	7.490	583,471.000	
TESCO PLC	191,100	1.980	378,378.000	
FRESNILLO PLC	5,000	13.030	65,150.000	
SMITH & NEPHEW PLC	20,300	13.110	266,133.000	
GLENCORE PLC	285,125	3.425	976,553.120	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	16,200	7.130	115,506.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	6,500	15.980	103,870.000	
SMITHS GROUP PLC	9,333	14.980	139,808.340	
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	6.985	42,608.500	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	31,083	3.642	113,204.280	
DIXONS CARPHONE PLC	24,800	1.646	40,820.800	
PEARSON PLC	18,863	7.080	133,550.040	
SAINSBURY (J) PLC	38,125	2.356	89,822.500	
NEXT PLC	3,300	45.030	148,599.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	73,900	1.962	144,991.800	
WHITBREAD PLC	4,311	36.340	156,661.740	
IMI PLC	6,650	12.750	84,787.500	
BUNZL PLC	7,755	21.080	163,475.400	
GKN PLC	40,600	3.113	126,387.800	
VODAFONE GROUP PLC	623,683	2.252	1,404,845.950	
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,993	42.960	128,579.280	
KINGFISHER PLC	51,911	3.365	174,680.510	
WPP PLC	29,800	13.100	390,380.000	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	15,927	8.100	129,008.700	
SEVERN TRENT PLC	5,733	21.290	122,055.570	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	15,700	65.180	1,023,326.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	11,900	12.120	144,228.000	
SCHRODERS PLC	2,800	34.550	96,740.000	
TATE & LYLE PLC	11,400	6.680	76,152.000	
SSE PLC	23,900	13.620	325,518.000	
WEIR GROUP PLC/THE	5,400	20.040	108,216.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,700	6.090	138,243.000	
ASTRAZENECA PLC	29,750	49.000	1,457,750.000	
FERGUSON PLC	5,965	53.550	319,425.750	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	138,100	2.684	370,660.400	

3I GROUP PLC	22,991	9.155	210,482.600	
SKY PLC	24,500	9.350	229,075.000	
ASHTEAD GROUP PLC	11,400	19.290	219,906.000	
SAGE GROUP PLC/THE	25,614	7.790	199,533.060	
NATIONAL GRID PLC	80,234	8.800	706,059.200	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,672,965	0.671	1,122,559.510	
RSA INSURANCE GROUP PLC	24,260	6.075	147,379.500	
IMPERIAL BRANDS PLC	22,650	30.460	689,919.000	
CENTRICA PLC	128,360	1.428	183,298.080	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,000	38.420	115,260.000	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	3,650	8.850	32,302.500	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	53,660	48.020	2,576,753.200	
BHP BILLITON PLC	49,577	13.500	669,289.500	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,100	30.120	243,972.000	
HSBC HOLDINGS PLC	469,500	7.432	3,489,324.000	
SHIRE PLC	20,974	37.165	779,498.710	
OLD MUTUAL PLC	117,025	2.005	234,635.120	
ANGLO AMERICAN PLC	30,683	13.760	422,198.080	
MONDI PLC	8,300	17.690	146,827.000	
WM MORRISON SUPERMARKETS	50,900	2.184	111,165.600	
CARNIVAL PLC	4,511	48.590	219,189.490	
EASYJET PLC	3,500	14.070	49,245.000	
COMPASS GROUP PLC	37,389	15.150	566,443.350	
PERSIMMON PLC	7,050	25.910	182,665.500	
BT GROUP PLC	196,600	2.554	502,116.400	
COCA-COLA HBC AG-DI	4,400	23.870	105,028.000	
BURBERRY GROUP PLC	10,489	17.240	180,830.360	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,286	43.770	187,598.220	
CAPITA PLC	15,090	4.948	74,665.320	
TRAVIS PERKINS PLC	5,900	15.860	93,574.000	
INTERTEK GROUP PLC	3,800	52.250	198,550.000	
ITV PLC	86,800	1.584	137,491.200	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	7,199	38.050	273,921.950	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	104,300	23.660	2,467,738.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	87,218	24.150	2,106,314.700	
MEGGITT PLC	17,700	4.872	86,234.400	

	G4S PLC	34,600	2.565	88,749.000	
	COBHAM PLC	55,600	1.288	71,612.800	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,300	10.280	33,924.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	4,500	19.210	86,445.000	
	INVESTEC PLC	16,000	5.175	82,800.000	
	ANTOFAGASTA PLC	9,800	9.210	90,258.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	63,357	4.262	270,027.530	
	EXPERIAN PLC	22,054	15.580	343,601.320	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 44,221,869.950 (6,647,873,710)	
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	186.700	186,700.000	
	FRUTAROM	900	300.900	270,810.000	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,300	5.123	247,440.900	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	14.000	196,000.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	493.500	296,100.000	
	BANK HAPOALIM BM	24,500	23.900	585,550.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	33,400	19.600	654,640.000	
	NICE LTD	1,400	305.200	427,280.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,000	63.200	189,600.000	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 3,054,120.900 (97,670,786)	
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	1.965	73,687.500	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	61,700	3.230	199,291.000	
	BHP BILLITON LIMITED	74,700	27.640	2,064,708.000	
	SOUTH32 LTD	120,700	3.350	404,345.000	
	ALUMINA LTD	56,900	2.310	131,439.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	17,600	31.150	548,240.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	35,500	4.620	164,010.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	11.440	134,992.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	62,600	29.580	1,851,708.000	
	WESTPAC BANKING CORP	78,848	31.480	2,482,135.040	
	SANTOS LTD	42,800	5.150	220,420.000	
	AUSNET SERVICES	41,000	1.860	76,260.000	

AUST AND NZ BANKING GROUP	68,400	28.770	1,967,868.000	
RIO TINTO LTD	10,000	71.700	717,000.000	
ORIGIN ENERGY LTD	41,400	9.040	374,256.000	
AMCOR LIMITED	26,800	15.560	417,008.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	46,800	5.200	243,360.000	
OIL SEARCH LTD	32,900	7.070	232,603.000	
SEEK LTD	7,500	18.700	140,250.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	17,100	15.500	265,050.000	
NEWCREST MINING LTD	17,600	24.060	423,456.000	
INCITEC PIVOT LTD	38,200	3.980	152,036.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	40,550	80.980	3,283,739.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,000	34.060	204,360.000	
ORICA LTD	8,300	17.200	142,760.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	32,300	10.670	344,641.000	
CIMIC GROUP LTD	2,100	52.090	109,389.000	
WOOLWORTHS LTD	30,000	26.960	808,800.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	7.760	106,312.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	20,500	4.850	99,425.000	
CROWN RESORTS LTD	9,600	12.520	120,192.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	10,254	5.650	57,935.100	
TELSTRA CORP LTD	98,600	3.390	334,254.000	
AMP LTD	66,800	5.180	346,024.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	10,300	21.570	222,171.000	
MACQUARIE GROUP LTD	7,684	99.770	766,632.680	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,600	23.600	297,360.000	
BANK OF QUEENSLAND LTD	9,100	13.030	118,573.000	
CSL LTD	10,600	145.970	1,547,282.000	
WESFARMERS LTD	26,495	43.670	1,157,036.650	
COCHLEAR LTD	1,400	183.700	257,180.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	13,400	13.930	186,662.000	
SUNCORP GROUP LTD	29,700	14.280	424,116.000	
BORAL LTD	27,700	7.590	210,243.000	
ASX LTD	4,700	57.330	269,451.000	
COMPUTERSHARE LTD	10,400	16.540	172,016.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	4.020	56,280.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	54,900	7.230	396,927.000	
SONIC HEALTHCARE LTD	9,500	22.350	212,325.000	
CHALLENGER LTD	13,900	14.000	194,600.000	

	TATTS GROUP LTD	30,500	4.340	132,370.000	
	AGL ENERGY LTD	15,500	25.330	392,615.000	
	BRAMBLES LTD	37,300	10.250	382,325.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	44.950	62,930.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,300	69.700	230,010.000	
	TPG TELECOM LTD	8,700	5.890	51,243.000	
	REA GROUP LTD	1,200	80.130	96,156.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,400	46.890	65,646.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 27,144,103.970 (2,303,720,104)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	6,700	39.540	264,918.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	440	755.090	332,239.600	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,696	32.370	152,009.520	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	5,187	82.860	429,794.820	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	10,700	26.560	284,192.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,150	108.480	341,712.000	
	BCE INC	3,430	61.690	211,596.700	
	FRANCO-NEVADA CORP	4,300	106.650	458,595.000	
	SUNCOR ENERGY INC	38,830	44.380	1,723,275.400	
	METRO INC	5,500	40.320	221,760.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	8,100	63.780	516,618.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	27,900	81.700	2,279,430.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	10,150	114.800	1,165,220.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	43,200	75.050	3,242,160.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	6,700	35.470	237,649.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	34,050	101.380	3,451,989.000	
	TOURMALINE OIL CORP	5,400	22.810	123,174.000	
	VERMILION ENERGY INC	2,800	44.540	124,712.000	
	TRANSCANADA CORP	20,550	61.940	1,272,867.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	11,629	43.640	507,489.560	
	BOMBARDIER INC-B	45,400	2.950	133,930.000	
	BARRICK GOLD CORP	27,300	18.050	492,765.000	
	CAE INC	5,800	22.550	130,790.000	
	THOMSON REUTERS CORP	6,704	57.000	382,128.000	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	19,400	25.080	486,552.000	

EMPIRE CO LTD 'A'	3,900	24.800	96,720.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	79.020	126,432.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,450	59.900	206,655.000	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	9,700	9.720	94,284.000	
LINAMAR CORP	1,100	68.080	74,888.000	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	5,400	17.160	92,664.000	
HYDRO ONE LTD	7,200	22.690	163,368.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,160	68.180	351,808.800	
EMERA INC	1,300	48.380	62,894.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,800	38.610	108,108.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,600	67.400	579,640.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,500	56.050	308,275.000	
KINROSS GOLD CORP	29,500	5.380	158,710.000	
BANK OF MONTREAL	15,300	99.440	1,521,432.000	
POWER CORP OF CANADA	8,100	32.830	265,923.000	
METHANEX CORP	2,200	66.980	147,356.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,900	133.400	253,460.000	
CAMECO CORP	9,200	11.750	108,100.000	
TELUS CORP	5,400	48.050	259,470.000	
POWER FINANCIAL CORP	5,700	35.520	202,464.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,400	29.130	390,342.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,600	162.910	260,656.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	24,800	3.800	94,240.000	
AGRIUM INC	3,300	139.630	460,779.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	26,100	42.790	1,116,819.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	640	697.720	446,540.800	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,400	70.940	595,896.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,100	109.380	120,318.000	
BLACKBERRY LTD	11,900	13.700	163,030.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	14,250	50.890	725,182.500	
ENBRIDGE INC	38,100	45.750	1,743,075.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	20,750	53.180	1,103,485.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	46,000	27.090	1,246,140.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	7,100	21.230	150,733.000	

	GOLDCORP INC	19,959	16.260	324,533.340	
	ENCANA CORP	23,100	14.830	342,573.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,400	222.790	757,486.000	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,500	59.140	147,850.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,200	40.820	212,264.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,550	98.200	1,723,410.000	
	CGI GROUP INC - CLASS A	5,000	68.010	340,050.000	
	HUSKY ENERGY INC	8,458	15.270	129,153.660	
	ONEX CORPORATION	2,000	91.880	183,760.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,100	29.020	293,102.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	3,900	30.350	118,365.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	4,200	55.460	232,932.000	
	IGM FINANCIAL INC	1,900	44.630	84,797.000	
	OPEN TEXT CORP	6,200	41.980	260,276.000	
	CI FINANCIAL CORP	6,400	28.610	183,104.000	
	SAPUTO INC	4,800	43.790	210,192.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	15,800	14.510	229,258.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,800	65.580	642,684.000	
	YAMANA GOLD INC	23,300	3.400	79,220.000	
	FORTIS INC	9,900	47.430	469,557.000	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	13,300	9.140	121,562.000	
	CENOVUS ENERGY INC	24,000	11.820	283,680.000	
	DOLLARAMA INC	2,500	161.100	402,750.000	
	ATCO LTD -CLASS I	1,700	45.650	77,605.000	
	ALTAGAS LTD	3,900	29.030	113,217.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	3,800	20.840	79,192.000	
	KEYERA CORP	4,400	35.770	157,388.000	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,900	15.450	60,255.000	
	INTER PIPELINE LTD	8,800	26.910	236,808.000	
	ARC RESOURCES LTD	8,300	15.900	131,970.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 41,396,448.700 (3,605,630,682)	
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	31,300	26.020	814,426.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	41,500	24.660	1,023,390.000	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,470	10.550	131,558.500	
	KEPPEL CORP LTD	34,500	7.710	265,995.000	
	UOL GROUP LTD	13,200	8.790	116,028.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	11,200	12.030	134,736.000	
	CAPITALAND LTD	59,000	3.520	207,680.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	42,000	1.530	64,260.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	2.730	111,930.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,300	39.960	91,908.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	74,200	12.300	912,660.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	153,000	1.360	208,080.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	188,650	3.740	705,551.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	35,000	3.250	113,750.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	22,700	3.060	69,462.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.380	62,472.000	
	SATS LTD	16,000	5.200	83,200.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	19,000	7.470	141,930.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,800	2.040	95,472.000	
	STARHUB LTD	16,000	2.880	46,080.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	37,200	3.160	117,552.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	63,000	3.340	210,420.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 5,728,540.500 (476,557,284)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFRY AG-REG	850	141.800	120,530.000	
	UBS GROUP AG-REG	85,500	17.010	1,454,355.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	200	647.000	129,400.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,900	74.150	289,185.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	16,480	247.800	4,083,744.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	950	83.700	79,515.000	
	SIKA AG-BR	50	7,575.000	378,750.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	67,725.000	135,450.000	
	ABB LTD-REG	46,400	25.120	1,165,568.000	
	SWISS RE AG	7,550	92.850	701,017.500	

	NESTLE SA-REG	72,550	84.950	6,163,122.500	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	420	670.000	281,400.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	970	222.500	215,825.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	56,120	16.340	917,000.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,200	57.100	296,920.000	
	SGS SA-REG	130	2,402.000	312,260.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	500	217.300	108,650.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,200	123.900	148,680.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	740	358.100	264,994.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,522	295.600	1,041,103.200	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,200	151.100	181,320.000	
	NOVARTIS AG-REG	51,750	83.700	4,331,475.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	50	1,804.000	90,200.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	12,200	84.200	1,027,240.000	
	SWISSCOM AG-REG	620	515.500	319,610.000	
	GEBERIT AG-REG	850	426.500	362,525.000	
	GIVAUDAN-REG	220	2,215.000	487,300.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	220	727.500	160,050.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,200	154.300	185,160.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,750	254.600	445,550.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,300	69.300	90,090.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	10,540	54.000	569,160.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	770	329.800	253,946.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,250	171.100	213,875.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,650	84.750	139,837.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	5,710.000	131,330.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 27,276,138.500 (3,104,842,845)	
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	301.600	573,040.000	
	ERICSSON LM-B SHS	71,030	53.200	3,778,796.000	
	VOLVO AB-B SHS	36,600	158.300	5,793,780.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,500	536.000	804,000.000	
	SKF AB-B SHARES	8,750	193.100	1,689,625.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	5,450	273.600	1,491,120.000	
	NORDEA BANK AB	70,850	98.100	6,950,385.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,150	314.800	1,306,420.000	

	TELE2 AB-B SHS	8,950	107.200	959,440.000	
	GETINGE AB-B SHS	5,600	152.600	854,560.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	35,050	98.800	3,462,940.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	35,200	114.400	4,026,880.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	20,900	199.300	4,165,370.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	22,600	194.800	4,402,480.000	
	SKANSKA AB-B SHS	7,650	182.300	1,394,595.000	
	SANDVIK AB	26,250	145.400	3,816,750.000	
	INVESTOR AB-B SHS	10,550	394.000	4,156,700.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,700	364.700	5,725,790.000	
	SECURITAS AB-B SHS	7,400	145.900	1,079,660.000	
	TELIA CO AB	60,000	36.700	2,202,000.000	
	ALFA LAVAL AB	7,000	199.900	1,399,300.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	326.800	2,973,880.000	
	ASSA ABLOY AB-B	23,300	171.300	3,991,290.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	900	620.500	558,450.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	4,200	194.500	816,900.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	14,100	242.500	3,419,250.000	
	BOLIDEN AB	6,500	268.700	1,746,550.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	9,750	76.750	748,312.500	
	KINNEVIK AB - B	5,300	268.700	1,424,110.000	
	HEXAGON AB-B SHS	6,200	411.000	2,548,200.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,000	204.200	816,800.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 79,077,373.500 (1,058,055,257)	
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	43,400	322.000	13,974,800.000	
	DANSKE BANK A/S	17,550	237.700	4,171,635.000	
	ISS A/S	3,900	233.100	909,090.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	85	10,480.000	890,800.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	309.600	526,320.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,000	391.900	1,959,500.000	
	TDC A/S	19,300	37.640	726,452.000	
	CARLSBERG AS-B	2,450	733.000	1,795,850.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,200	332.800	1,730,560.000	
	COLOPLAST-B	2,800	491.000	1,374,800.000	

	DSV A/S	4,500	478.000	2,151,000.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,675	172.900	462,507.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	150	10,900.000	1,635,000.000	
	TRYG A/S	2,500	155.000	387,500.000	
	PANDORA A/S	2,550	608.000	1,550,400.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,350	552.000	1,297,200.000	
	GENMAB A/S	1,300	1,200.000	1,560,000.000	
	ORSTED A/S	4,450	355.700	1,582,865.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 38,686,279.500 (690,163,226)	
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	2.850	74,100.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.590	189,153.510	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	6.520	152,568.000	
	CONTACT ENERGY LTD	13,000	5.520	71,760.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	6.850	137,685.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,800	10.400	91,520.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 716,786.510 (54,963,190)	
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	30,600	59.200	1,811,520.000	
	DNB ASA	22,550	151.600	3,418,580.000	
	ORKLA ASA	19,050	83.000	1,581,150.000	
	TELENOR ASA	18,000	184.000	3,312,000.000	
	STATOIL ASA	26,073	166.500	4,341,154.500	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,500	225.600	338,400.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,160	372.600	1,550,016.000	
	MARINE HARVEST	9,900	141.700	1,402,830.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,850	152.300	738,655.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,800	209.500	377,100.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 18,871,405.500 (256,273,687)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	19,350	108.050	2,090,767.500	

EVONIK INDUSTRIES AG	3,800	31.085	118,123.000	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	48,650	16.070	781,805.500	
COMMERZBANK AG	24,685	12.135	299,552.470	
VOLKSWAGEN AG	800	171.900	137,520.000	
VOLKSWAGEN AG-PREF	4,300	176.700	759,810.000	
MAN SE	850	94.700	80,495.000	
SIEMENS AG-REG	17,950	114.500	2,055,275.000	
E.ON SE	51,700	9.849	509,193.300	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,800	84.730	660,894.000	
GEA GROUP AG	4,200	40.230	168,966.000	
OSRAM LICHT AG	2,360	70.100	165,436.000	
CONTINENTAL AG	2,550	219.650	560,107.500	
BASF SE	21,350	93.630	1,999,000.500	
K+S AG-REG	4,400	19.720	86,768.000	
ALLIANZ SE-REG	10,650	200.100	2,131,065.000	
THYSSENKRUPP AG	10,200	23.175	236,385.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,200	113.750	477,750.000	
RWE AG	11,900	19.630	233,597.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	5,650	28.690	162,098.500	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	900	84.000	75,600.000	
BRENNTAG AG	3,650	52.210	190,566.500	
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,650	60.580	584,597.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,000	55.100	165,300.000	
HOCHTIEF AG	500	146.600	73,300.000	
SAP SE	22,992	95.340	2,192,057.280	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,620	192.200	695,764.000	
SCHAEFFLER AG	3,800	14.575	55,385.000	
ZALANDO SE	2,600	43.000	111,800.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,500	89.190	312,165.000	
KION GROUP AG	1,650	69.100	114,015.000	
COVESTRO AG	2,600	86.990	226,174.000	
INNOGY SE	3,400	39.300	133,620.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,550	70.900	251,695.000	
METRO AG	4,100	16.315	66,891.500	
LINDE AG - TENDER	4,300	196.300	844,090.000	
BEIERSDORF AG	2,300	98.380	226,274.000	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,500	43.800	65,700.000	

MERCK KGAA	3,100	90.480	280,488.000	
ADIDAS AG	4,410	177.650	783,436.500	
HENKEL AG & CO KGAA	2,400	102.450	245,880.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	75,800	14.810	1,122,598.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,050	82.880	418,544.000	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	22,500	70.130	1,577,925.000	
QIAGEN N.V.	5,248	26.845	140,882.560	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	26,200	23.220	608,364.000	
HANNOVER RUECK SE	1,400	110.950	155,330.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	22,600	39.845	900,497.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	4,450	94.430	420,213.500	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	5,550	27.080	150,294.000	
LANXESS AG	2,200	63.240	139,128.000	
AXEL SPRINGER SE	1,200	65.920	79,104.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	8,400	36.755	308,742.000	
SYMRISE AG	3,000	70.420	211,260.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,500	3.980	65,670.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,200	72.900	87,480.000	
HUGO BOSS AG -ORD	1,450	68.860	99,847.000	
RTL GROUP	1,000	65.570	65,570.000	
VONOVIA SE	10,900	39.025	425,372.500	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,476	32.435	696,574.060	
NN GROUP NV	7,500	35.910	269,325.000	
ARCELORMITTAL	15,600	25.705	400,998.000	
UNILEVER NV-CVA	37,950	48.860	1,854,237.000	
HEINEKEN NV	6,100	85.490	521,489.000	
RELX NV	22,719	19.450	441,884.550	
AEGON NV	40,744	5.259	214,272.690	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	29,483	17.460	514,773.180	
AKZO NOBEL	5,800	75.670	438,886.000	
KONINKLIJKE DSM NV	4,350	78.540	341,649.000	
WOLTERS KLUWER	6,900	43.390	299,391.000	
BOSKALIS WESTMINSTER	2,100	30.925	64,942.500	
ING GROEP NV	90,350	15.350	1,386,872.500	
KONINKLIJKE KPN NV	78,250	3.052	238,819.000	

ASML HOLDING NV	8,750	147.950	1,294,562.500	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	8,800	24.775	218,020.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,200	32.370	168,324.000	
VOPAK	1,600	35.090	56,144.000	
RANDSTAD HOLDING NV	2,850	51.240	146,034.000	
HEINEKEN HOLDING NV	2,600	80.710	209,846.000	
GEMALTO	2,000	31.680	63,360.000	
ALTICE NV - A	11,500	7.030	80,845.000	
ALTICE NV - B	2,100	7.051	14,807.100	
JCDECAUX SA	1,600	34.570	55,312.000	
TOTAL SA	54,750	47.705	2,611,848.750	
MICHELIN (CGDE)	3,950	122.300	483,085.000	
AIR LIQUIDE SA	9,952	105.400	1,048,940.800	
KERING	1,790	375.900	672,861.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	13,200	72.490	956,868.000	
BOUYGUES SA	5,000	43.195	215,975.000	
BNP PARIBAS	26,050	64.290	1,674,754.500	
PEUGEOT SA	12,350	17.295	213,593.250	
NATIXIS	22,950	6.686	153,443.700	
THALES SA	2,550	84.000	214,200.000	
DANONE	13,850	71.430	989,305.500	
CARREFOUR SA	12,800	17.780	227,584.000	
SUEZ	8,875	15.610	138,538.750	
VIVENDI	23,741	22.710	539,158.110	
L'OREAL	5,850	186.950	1,093,657.500	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	11,500	48.515	557,922.500	
LEGRAND SA	6,317	62.610	395,507.370	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,300	51.190	66,547.000	
PERNOD RICARD SA	4,917	130.600	642,160.200	
SOCIETE BIC SA	700	95.240	66,668.000	
EURAZEO SA	1,116	72.880	81,334.080	
REXEL SA	7,050	15.530	109,486.500	
SOCIETE GENERALE SA	18,000	42.895	772,110.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,560	245.100	1,607,856.000	
ACCOR SA	4,400	42.170	185,548.000	
CAPGEMINI SE	3,750	97.400	365,250.000	
VALEO SA	5,650	60.750	343,237.500	
PUBLICIS GROUPE	4,750	56.000	266,000.000	

BUREAU VERITAS SA	6,050	22.255	134,642.750	
EIFFAGE	1,700	92.490	157,233.000	
SODEXO SA	2,150	109.700	235,855.000	
IPSEN	900	103.500	93,150.000	
INGENICO GROUP	1,350	86.690	117,031.500	
ZODIAC AEROSPACE	4,800	24.680	118,464.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	270	506.800	136,836.000	
SEB SA	500	156.950	78,475.000	
ESSILOR INTERNATIONAL	4,850	106.700	517,495.000	
DASSAULT AVIATION SA	60	1,297.850	77,871.000	
AXA SA	45,500	25.520	1,161,160.000	
LAGARDERE SCA	2,650	27.280	72,292.000	
EDENRED	5,350	24.255	129,764.250	
RENAULT SA	4,100	85.790	351,739.000	
HERMES INTERNATIONAL	730	436.800	318,864.000	
STMICROELECTRONICS NV	14,600	18.845	275,137.000	
REMY COINTREAU	550	110.550	60,802.500	
ATOS SE	2,150	123.550	265,632.500	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,050	89.090	271,724.500	
WENDEL	680	140.400	95,472.000	
ORANGE	46,800	14.460	676,728.000	
ALSTOM	3,650	34.620	126,363.000	
CNP ASSURANCES	3,750	18.930	70,987.500	
SANOFI	26,325	76.980	2,026,498.500	
VINCI SA	11,650	86.900	1,012,385.000	
AIRBUS SE	13,550	87.290	1,182,779.500	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,450	21.305	243,942.250	
CREDIT AGRICOLE SA	27,000	14.180	382,860.000	
ENGIE	42,873	14.800	634,520.400	
IMERYS SA	900	76.900	69,210.000	
EDF	12,750	11.300	144,075.000	
SES	8,350	13.415	112,015.250	
SAFRAN SA	7,400	90.430	669,182.000	
ILIAD SA	600	197.100	118,260.000	
ARKEMA	1,550	102.450	158,797.500	
ADP	750	158.800	119,100.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	18.950	76,747.500	
SCOR SE	4,150	34.515	143,237.250	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	10,450	11.015	115,106.750	

BOLLORE	19,000	4.450	84,550.000	
UCB SA	3,000	64.510	193,530.000	
KBC GROEP NV	5,800	68.800	399,040.000	
COLRUYT SA	1,600	44.150	70,640.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,850	89.790	166,111.500	
SOLVAY SA	1,700	117.650	200,005.000	
UMICORE	4,500	38.965	175,342.500	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	17,810	97.850	1,742,708.500	
AGEAS	4,140	41.080	170,071.200	
PROXIMUS	3,500	28.570	99,995.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,200	58.230	69,876.000	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	21,750	1.919	41,738.250	
PRYSMIAN SPA	4,800	27.840	133,632.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	29,043	15.210	441,744.030	
SAIPEM SPA	13,430	3.480	46,736.400	
MEDIOBANCA SPA	13,015	9.510	123,772.650	
TENARIS SA	11,250	12.130	136,462.500	
UNICREDIT SPA	47,306	17.040	806,094.240	
TELECOM ITALIA SPA	266,282	0.700	186,530.540	
TELECOM ITALIA-RSP	134,950	0.573	77,393.820	
INTESA SANPAOLO-RSP	21,000	2.660	55,860.000	
INTESA SANPAOLO	314,397	2.820	886,599.540	
ATLANTIA SPA	10,607	27.700	293,813.900	
POSTE ITALIANE SPA	11,800	6.145	72,511.000	
RECORDATI SPA	2,600	37.620	97,812.000	
ENI SPA	59,100	13.760	813,216.000	
LEONARDO SPA	9,525	10.030	95,535.750	
ENEL SPA	189,634	5.475	1,038,246.150	
SNAM SPA	53,200	4.230	225,036.000	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,850	48.040	184,954.000	
TERNA SPA	32,400	5.185	167,994.000	
EXOR NV	2,500	51.500	128,750.000	
CNH INDUSTRIAL NV	24,300	10.850	263,655.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	25,050	14.460	362,223.000	
FERRARI NV	2,835	92.850	263,229.750	
TELEFONICA SA	104,627	8.662	906,279.070	
ENDESA SA	7,650	18.990	145,273.500	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	155,512	7.279	1,131,971.840	
IBERDROLA SA	135,734	6.675	906,024.450	
BANCO DE SABADELL SA	122,909	1.711	210,297.290	
BANKINTER SA	15,100	8.083	122,053.300	
REPSOL SA	28,700	15.420	442,554.000	
GRIFOLS SA	6,700	24.555	164,518.500	
BANCO SANTANDER SA	378,250	5.704	2,157,538.000	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	15,800	18.620	294,196.000	
AMADEUS IT GROUP SA	10,100	61.030	616,403.000	
GAS NATURAL SDG SA	8,450	18.850	159,282.500	
MAPFRE SA	25,450	2.856	72,685.200	
CAIXABANK S.A	81,600	4.046	330,153.600	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	15,200	6.939	105,472.800	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,376	32.815	176,413.440	
AENA SME SA	1,600	169.400	271,040.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	25,300	29.775	753,307.500	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	5,600	10.560	59,136.000	
ENAGAS SA	5,400	24.445	132,003.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,000	18.935	189,350.000	
FERROVIAL SA	11,700	18.500	216,450.000	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	15,700	3.950	62,015.000	
BANKIA SA	24,105	4.044	97,480.620	
UPM-KYMMENE OYJ	12,400	25.670	318,308.000	
NOKIA OYJ	138,950	4.210	584,979.500	
WARTSILA OYJ ABP	3,350	55.400	185,590.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	13,100	13.060	171,086.000	
METSO OYJ	2,400	29.780	71,472.000	
ELISA OYJ	3,250	33.930	110,272.500	
SAMPO OYJ-A SHS	10,350	44.580	461,403.000	
FORTUM OYJ	10,450	17.530	183,188.500	
KONE OYJ-B	7,850	43.510	341,553.500	
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,650	36.470	96,645.500	
NESTE OYJ	2,950	50.600	149,270.000	
ORION OYJ-CLASS B	2,450	32.320	79,184.000	
OMV AG	3,550	52.120	185,026.000	

	ERSTE GROUP BANK AG	6,650	36.535	242,957.750	
	VOESTALPINE AG	2,850	49.020	139,707.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	30.200	102,680.000	
	ANDRITZ AG	1,600	46.365	74,184.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	22,060	6.580	145,154.800	
	JERONIMO MARTINS	6,000	16.685	100,110.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,500	2.908	143,946.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	11,650	16.005	186,458.250	
	KERRY GROUP PLC-A	3,850	87.610	337,298.500	
	CRH PLC	19,400	29.730	576,762.000	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	1,900	95.720	181,868.000	
ユーロ　小計				ユーロ 93,029,888.730 (12,355,299,522)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	33,000	67.000	2,211,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	55,000	57.950	3,187,250.000	
	MTR CORP	34,500	45.950	1,585,275.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	34,000	128.200	4,358,800.000	
	SINO LAND CO	74,000	13.860	1,025,640.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	63,169	97.350	6,149,502.150	
	WHARF HOLDINGS LTD	28,000	24.550	687,400.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	12,500	75.300	941,250.000	
	FIRST PACIFIC CO	56,000	5.750	322,000.000	
	CLP HOLDINGS LTD	38,000	81.200	3,085,600.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	27,924	51.650	1,442,274.600	
	HANG LUNG GROUP LTD	21,000	27.000	567,000.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	191,256	15.280	2,922,391.680	
	HANG SENG BANK LTD	17,900	189.900	3,399,210.000	
	WHEELOCK & CO LTD	20,000	53.300	1,066,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	133,000	11.260	1,497,580.000	
	WH GROUP LTD	194,500	8.350	1,624,075.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	27,300	240.000	6,552,000.000	
	LI & FUNG LTD	132,000	3.460	456,720.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	18.340	843,640.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	5,800	116.600	676,280.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	16,500	28.050	462,825.000	

	NWS HOLDINGS LTD	35,500	13.840	491,320.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	14,500	34.500	500,250.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	29,040	33.550	974,292.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	14,000	40.000	560,000.000	
	SJM HOLDINGS LTD	47,000	6.340	297,980.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	26,200	26.250	687,750.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	61,669	65.350	4,030,069.150	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	15,000	67.150	1,007,250.000	
	PCCW LTD	95,000	4.610	437,950.000	
	AIA GROUP LTD	281,200	65.950	18,545,140.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	28,000	47.650	1,334,200.000	
	SANDS CHINA LTD	57,200	38.400	2,196,480.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	18.060	541,800.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	31,500	45.000	1,417,500.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	20,000	20.150	403,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	87,500	38.900	3,403,750.000	
	WYNN MACAU LTD	38,000	23.450	891,100.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 82,783,544.580 (1,187,943,865)	
合計				90,681,988,461 [90,681,988,461]	

(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	581,981.880	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,137	1,132,856.010	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,550	443,927.500	
		GGP INC	14,400	336,960.000	
		VORNADO REALTY TRUST	3,827	294,411.110	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,750	466,840.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,500	567,290.000	
		EQUINIX INC	1,808	846,722.560	
		AMERICAN TOWER CORP	9,750	1,426,425.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	17,293	340,153.310	
		KIMCO REALTY CORP	10,000	184,700.000	

	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	12,000	147,600.000	
	VENTAS INC	8,300	531,781.000	
	WEYERHAEUSER CO	16,964	600,016.680	
	AGNC INVESTMENT CORP	9,000	180,630.000	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,900	125,856.000	
	CROWN CASTLE INTL CORP	9,250	1,043,955.000	
	IRON MOUNTAIN INC	5,610	227,317.200	
	VEREIT INC	22,300	175,055.000	
	PROLOGIS INC	12,262	810,886.060	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,100	266,637.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,150	196,918.500	
	DUKE REALTY CORP	8,000	229,200.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,480	366,566.400	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,600	211,360.000	
	WELLTOWER INC	8,400	565,152.000	
	HCP INC	10,700	287,830.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	147,246.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,600	265,850.000	
	MACERICH CO/THE	2,700	173,421.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	26,600	313,082.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3,400	140,658.000	
	REALTY INCOME CORP	6,450	357,781.500	
	PUBLIC STORAGE	3,600	756,936.000	
	REGENCY CENTERS CORP	3,500	238,000.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,250	230,017.500	
	UDR INC	6,300	247,968.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	4,750	555,702.500	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,000	255,180.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 16,270,870.710 (1,823,151,063)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	17,062	158,676.600	
	SEGRO PLC	23,750	130,506.250	
	HAMMERSON PLC	19,200	99,168.000	
	BRITISH LAND CO PLC	22,100	137,904.000	
	INTU PROPERTIES PLC	21,100	41,081.700	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 567,336.550	

			(85,287,704)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	13,300	214,130.000	
	TRANSURBAN GROUP	47,800	601,324.000	
	SYDNEY AIRPORT	25,100	188,250.000	
	APA GROUP	26,700	247,776.000	
	SCENTRE GROUP	124,222	525,459.060	
	DEXUS	23,950	244,529.500	
	GPT GROUP	44,060	235,721.000	
	MIRVAC GROUP	84,400	205,936.000	
	STOCKLAND	57,000	266,760.000	
	WESTFIELD CORP	45,496	380,346.560	
	GOODMAN GROUP	41,700	363,207.000	
	VICINITY CENTRES	76,973	213,984.940	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 3,687,424.060 (312,951,680)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,500	43,740.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,000	62,940.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,900	96,954.000	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 203,634.000 (17,736,521)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	60,100	111,786.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	57,400	150,962.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	63,200	130,192.000	
	SUNTEC REIT	53,000	106,000.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 498,940.000 (41,506,819)	
ユーロ			ユーロ	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,350	510,890.000	
	ICADE	900	70,938.000	
	GECINA SA	1,150	160,080.000	
	KLEPIERRE	5,200	179,972.000	
	FONCIERE DES REGIONS	750	66,975.000	

	ユーロ　小計			ユーロ 988,855.000 (131,329,833)	
	香港・ドル	LINK REIT	52,000	香港・ドル 3,658,200.000	
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	64,500	462,465.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	87,000	860,430.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 4,981,095.000 (71,478,713)	
投資証券　合計				2,483,442,333 [2,483,442,333]	
合計				2,483,442,333 [2,483,442,333]	

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　600銘柄 投資証券　39銘柄	97.0%	3.0%	65.1%
イギリス・ポンド	株式　105銘柄 投資証券　5銘柄	98.7%	1.3%	7.2%
イスラエル・シュケル	株式　9銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式　58銘柄 投資証券　12銘柄	88.0%	12.0%	2.8%
カナダ・ドル	株式　89銘柄 投資証券　3銘柄	99.5%	0.5%	3.9%
シンガポール・ドル	株式　22銘柄 投資証券　4銘柄	92.0%	8.0%	0.6%
スイス・フラン	株式　36銘柄	100%	-%	3.3%
スウェーデン・クローナ	株式　31銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式　18銘柄	100%	-%	0.7%
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　233銘柄 投資証券　5銘柄	98.9%	1.1%	13.4%

香港・ドル	株式 39銘柄 投資証券 3銘柄	94.3%	5.7%	1.4%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「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28年11月30日現在	平成29年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	277,840,378	255,916,193
コール・ローン	1,355,518,736	1,154,879,444
国債証券	152,458,096,613	164,124,972,994
派生商品評価勘定	15,156,110	1,144,512
未収入金	－	5,179,150
未収利息	1,181,963,343	1,273,446,527
前払費用	27,676,065	22,548,735
流動資産合計	155,316,251,245	166,838,087,555
資産合計	155,316,251,245	166,838,087,555
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	138,679	417,993
未払金	－	9,443,661
未払解約金	338,983,307	107,164,056
流動負債合計	339,121,986	117,025,710
負債合計	339,121,986	117,025,710
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	59,006,131,580	59,383,778,765
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	95,970,997,679	107,337,283,080

元本等合計	154,977,129,259	166,721,061,845
純資産合計	154,977,129,259	166,721,061,845
負債純資産合計	155,316,251,245	166,838,087,555

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28年12月1日 至　平成29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28年11月30日現在	平成29年11月30日現在
1.　※1　期首	平成27年12月1日	平成28年12月1日
期首元本額	57,305,049,313円	59,006,131,580円
期中追加設定元本額	5,269,599,218円	6,421,510,499円
期中一部解約元本額	3,568,516,951円	6,043,863,314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	1,426,188,983円	938,947,637円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	47,463,120円	31,434,341円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	340,370,920円	236,831,181円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	85,931,327円	64,229,316円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,134,382,139円	766,547,584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）	45,058,356円	248,867,657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）	79,097,081円	525,569,264円

ダイワファンドラップオンライン 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	400,023,699円	
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	850,783円	880,097円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	17,978円	22,820円	
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	71,282,917円	575,119,716円	
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	23,335,905円	245,604,315円	
ＤＣダイワ外国債券インデックス	38,020,240,928円	40,005,557,043円	
ダイワ・ライフ・バランス３０	588,263,235円	631,956,912円	
ダイワ・ライフ・バランス５０	260,217,655円	299,143,351円	
ダイワ・ライフ・バランス７０	159,536,254円	190,473,853円	
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	251,573,954円	268,358,922円	
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	202,071,895円	217,548,839円	
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	59,946,308円	67,378,321円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	12,384,412円	11,337,304円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	15,705,795円	17,901,368円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	932,613円	1,288,876円	
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	1,705,288,856円	497,823,550円	
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	194,065,438円	166,073,932円	
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	7,200,012,883円	6,394,036,947円	
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	519,885,779円	359,421,809円	
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	335,883,404円	142,269,988円	

ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	396,659,545円	353,656,108円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	103,331,290円	126,558,233円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	7,209,795円	21,849,007円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	－円	374,472円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,614,367,146円	5,466,036,292円
ダイワライフスタイル２５	35,139,131円	34,455,585円
ダイワライフスタイル５０	55,152,766円	59,697,716円
ダイワライフスタイル７５	14,282,989円	16,502,710円
計	59,006,131,580円	59,383,778,765円
2. 期末日における受益権の総数	59,006,131,580口	59,383,778,765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28年12月1日 至　平成29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29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28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29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	△1,064,833,729	△1,109,186,102
合計	△1,064,833,729	△1,109,186,102

（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12月1日から平成28年11月30日まで、及び平成28年12月1日から平成29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28年11月30日 現在			平成29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)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	989,797,739	－	1,004,815,170	15,017,431	1,028,003,581	－	1,028,730,100	726,519
アメリカ・ドル	605,070,604	－	613,008,100	7,937,496	430,810,849	－	431,366,020	555,171
イギリス・ポンド	58,653,622	－	61,094,110	2,440,488	101,665,514	－	101,563,620	△101,894
オーストラリア・ドル	7,293,210	－	7,319,310	26,100	11,529,794	－	11,515,120	△14,674
カナダ・ドル	18,052,034	－	18,742,080	690,046	22,700,658	－	22,708,170	7,512
シンガポール・ドル	2,640,662	－	2,763,250	122,588	8,296,250	－	8,304,000	7,750
スイス・フラン	1,594,900	－	1,666,650	71,750	－	－	－	－
スウェーデン・クローナ	3,064,686	－	3,221,750	157,064	－	－	－	－
デンマーク・クローネ	4,786,255	－	4,968,720	182,465	21,733,295	－	21,769,780	36,485
ノルウェー・クローネ	1,819,517	－	1,883,310	63,793	－	－	－	－
ポーランド・ズロチ	3,945,147	－	3,993,040	47,893	－	－	－	－
マレーシア・リンギット	－	－	－	－	8,149,680	－	8,137,800	△11,880
メキシコ・ペソ	6,193,399	－	6,054,720	△138,679	－	－	－	－
ユーロ	273,223,387	－	276,483,900	3,260,513	423,117,541	－	423,365,590	248,049
南アフリカ・ランド	3,460,316	－	3,616,230	155,914	－	－	－	－
合計	989,797,739	－	1,004,815,170	15,017,431	1,028,003,581	－	1,028,730,100	726,519

（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28年11月30日現在	平成29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）	2.6265円 (26,265円)	2.8075円 (28,075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	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,488,000.000	2,537,262.400	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	3,161,000.000	3,200,733.770	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,096,000.000	3,159,220.320	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,621,000.000	2,704,216.750	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,144,499.400	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	4,280,000.000	4,451,028.800	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,197,456.500	

		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,913,077.800
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,607,792.190
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,294,106.760
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,652,835.920
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,548,139.720
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	1,320,000.000	1,321,386.000
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,154,830.050
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,165,000.000	2,159,154.500
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,861,000.000	1,855,175.070
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,426,000.000	1,418,912.780
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,223,484.160
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20190228	1,843,000.000	1,835,572.710
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190331	300,000.000	299,166.000
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190430	559,000.000	555,394.450
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,429,221.510
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,364,202.800
		1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,352,705.760
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,784,000.000	1,759,113.200
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,494,504.990
		1% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,872,000.000	1,848,150.720

		1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,185,141.800
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	875,637.360
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,099,792.960
		1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,332,962.070
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,868,980.260
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,354,416.320
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,323,465.000
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,944,620.160
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,142,321.600
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,589,426.000
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,427,871.060
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,434,544.250
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,133,898.160
		2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,839,127.830
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	2,768,000.000	2,817,076.640
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	2,008,087.010
		2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,892,935.850
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181031	3,611,000.000	3,598,289.280
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,337,660.150
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,179,864.440

		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,638,000.000	2,627,579.900	
		2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,510,553.820	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20181231	2,026,000.000	2,022,353.200	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,035,769.040	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,388,693.660	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190131	2,185,000.000	2,180,040.050	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,658,578.410	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,373,000.000	2,367,613.290	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,738,872.540	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190331	2,383,000.000	2,380,188.060	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,850,310.190	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,412,000.000	5,495,669.520	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190430	2,975,000.000	2,970,329.250	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,430,877.440	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,241,000.000	2,233,022.040	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,736,890.280	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2,885,000.000	2,880,037.800	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,504,585.700	
		8.875% United States Treasury Note/Bond 20190215	904,000.000	982,991.520	
		8.125% United States Treasury Note/Bond 20190815	724,000.000	801,569.360	

		8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	759,941.820	
		8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,588,568.840	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	798,233.160	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,091,253.600	
		6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	842,228.100	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	944,487.260	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	904,771.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	939,680.640	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	604,347.370	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,358,256.720	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	991,000.000	1,318,684.060	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,626,000.000	2,088,645.780	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	747,634.130	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	696,858.720	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	670,397.490	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	849,000.000	961,356.660	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,405,711.580	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	760,000.000	985,385.600	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,543,693.800	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,254,788.900	

		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,888,145.000	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,898,508.480	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,848,295.800	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,360,901.540	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,750,394.100	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,603,764.400	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,541,074.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,723,788.300	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,406,484.090	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,719,488.850	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,609,854.200	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,026,000.000	2,148,025.980	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,998,000.000	4,054,211.880	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,531,474.480	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,214,657.950	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,175,066.930	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,050,383.490	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,318,716.060	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,861,886.560	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,162,000.000	5,199,889.080	

		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	3,955,909.650
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190831	2,989,000.000	2,982,095.410
		2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,301,598.460
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,403,455.360
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,642,835.000
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,174,145.700
		2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,163,994.980
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	3,921,000.000	3,917,627.940
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,832,862.880
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,873,705.640
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,302,510.000
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,183,577.400
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,196,925.160
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,918,416.250
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,376,542.670
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,636,180.200
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,535,714.800
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,762,183.120
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,788,775.380
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,764,722.160

		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,856,423.640	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,722,885.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	3,974,018.750	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,579,704.710	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,578,932.080	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,806,104.960	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,988,986.390	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,985,754.920	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,828,052.500	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,118,071.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,172,354.050	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,617,343.160	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,615,125.670	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,422,628.250	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,832,350.760	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,433,758.160	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,838,468.200	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,809,398.400	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,072,656.440	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,842,264.370	

		1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,532,010.720	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,138,000.000	2,130,217.680	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,073,244.400	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221130	2,687,000.000	2,675,445.900	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181215	2,151,000.000	2,142,008.820	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,030,158.540	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	2,492,000.000	2,494,118.200	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20190115	2,146,000.000	2,132,823.560	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,075,202.500	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,080,904.420	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	2,065,000.000	2,041,355.750	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,515,158.100	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,213,201.520	
		1% United States Treasury Note/Bond 20190315	2,100,000.000	2,080,869.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,226,771.350	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,262,000.000	2,192,013.720	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,936,556.400	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,055,148.920	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190415	1,905,000.000	1,883,035.350	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,029,000.000	5,695,958.040	

		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,404,234.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,015,331.300	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,206,906.010	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190515	2,507,000.000	2,476,539.950	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,647,458.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,431,825.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190615	2,100,000.000	2,072,847.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,428,125.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,876,460.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20190715	2,500,000.000	2,460,425.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,223,736.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,087,943.200	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,500,000.000	2,458,475.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,585,522.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,589,555.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,644,252.600	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,295,936.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190915	2,600,000.000	2,559,258.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,395,205.850	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,944,534.320	

		1% United States Treasury Note/Bond 20191015	2,147,000.000	2,117,049.350	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	2,326,000.000	2,307,461.780	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,337,145.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,915,850.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,423,425.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,650,000.000	3,689,347.000	
		1% United States Treasury Note/Bond 20191115	1,400,000.000	1,379,588.000	
		1% United States Treasury Note/Bond 20181130	1,000,000.000	993,630.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,481,633.600	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,376,000.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20191215	1,440,000.000	1,428,580.800	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	1,998,280.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,400,000.000	1,393,700.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,506,625.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200115	1,500,000.000	1,487,400.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,700,000.000	1,689,035.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	4,040,000.000	3,996,731.600	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	2,991,187.500	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,484,439.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,875,000.000	4,014,228.750	

		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,130,000.000	2,110,680.900	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,300,000.000	2,283,555.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	2,989,772.800	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,287,235.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315	1,900,000.000	1,892,495.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190331	1,850,000.000	1,838,493.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,250,000.000	4,224,075.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	900,000.000	893,313.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200415	850,000.000	843,888.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,695,953.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,700,000.000	2,796,795.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	2,977,020.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,958,030.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	4,000,000.000	3,970,120.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	2,960,370.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190531	4,000,000.000	3,972,640.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	2,000,000.000	1,971,560.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615	2,700,000.000	2,678,589.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190630	4,000,000.000	3,969,520.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	2,958,030.000	

		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,363,808.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715	2,000,000.000	1,982,800.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,000,000.000	994,100.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,829,436.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815	1,300,000.000	1,288,573.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,873,929.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,977,020.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,800,000.000	2,760,380.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,100,000.000	2,057,328.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190831	600,000.000	594,864.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,953,420.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915	1,000,000.000	987,610.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,475,775.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20190930	1,000,000.000	993,240.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,400,000.000	3,371,032.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015	1,000,000.000	993,470.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,490,225.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 632,164,239.670 (70,834,003,055)	
	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	2,280,000.000	2,365,249.200	
		2% United Kingdom Gilt 20250907	2,121,000.000	2,254,644.210	
		1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,543,111.130	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,332,000.000	1,676,188.800	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,495,105.750	
		0.5% United Kingdom Gilt 20220722	310,000.000	305,381.000	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	460,000.000	419,290.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	200,000.000	195,780.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	600,000.000	599,400.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	510,000.000	503,747.400	
		0.75% United Kingdom Gilt 20230722	500,000.000	493,655.000	
		8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,383,869.560	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,394,650.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,786,354.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,873,723.520	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,803,550.400	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,188,122.600	
		4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,889,141.960	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,878,321.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,169,259.800	

		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,565,872.000	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,596,000.000	2,418,578.400	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,480,000.000	2,033,224.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,400,552.600	
		4.5% United Kingdom Gilt 20190307	873,000.000	917,252.370	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,770,939.800	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,572,439.600	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,870,000.000	2,612,764.000	
		3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,428,000.000	1,510,095.720	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,244,000.000	2,086,561.200	
		3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,952,457.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,268,829.900	
		3.75% United Kingdom Gilt 20210907	1,633,000.000	1,820,158.130	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,352,000.000	2,023,268.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,338,944.080	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,066,000.000	2,626,092.600	
		2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,083,319.340	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,610,134.200	
		1.75% United Kingdom Gilt 20190722	2,251,000.000	2,296,312.630	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,842,000.000	2,045,504.160	

	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	2,828,106.000	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 75,999,952.460 (11,425,072,853)	
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	2,566,555.200	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,420,000.000	2,728,792.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,409,000.000	2,560,261.110	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,513,173.660	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,420,304.480	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,091,395.450	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,547,857.710	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,314,000.000	1,403,430.840	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,548,066.840	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,358,000.000	1,655,619.280	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,249,311.680	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	2,011,000.000	2,049,249.220	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	863,000.000	964,074.560	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	546,322.310	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,187,405.300	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	712,000.000	734,420.880	

	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,142,000.000	2,195,185.860	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,978,000.000	1,931,635.680	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	932,000.000	891,336.840	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	700,000.000	700,056.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,450,000.000	1,480,319.500	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	100,000.000	100,670.000	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 41,065,444.400 (3,485,224,266)	
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	377,165.750	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	590,915.820	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,363,666.750	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,671,803.070	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,608,107.680	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1,524,000.000	1,577,477.160	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,799,923.280	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,876,000.000	1,969,481.080	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	1,011,543.600	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,838,725.100	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	1,965,205.340	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,241,748.060	

		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,471,568.900	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190301	853,000.000	857,555.020	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,627,000.000	1,636,583.030	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,197,000.000	1,335,014.100	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,194,263.600	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,719,000.000	1,720,719.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,831,000.000	1,795,313.810	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,099,973.410	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,237,000.000	1,206,792.460	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,437,154.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,145,450.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20181101	1,470,000.000	1,459,577.700	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840,000.000	802,519.200	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190201	1,620,000.000	1,604,707.200	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190501	900,000.000	892,260.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	700,000.000	680,085.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190801	1,360,000.000	1,345,257.600	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20191101	500,000.000	498,300.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	300,000.000	301,782.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	600,000.000	602,448.000	

カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 40,103,086.720 (3,492,978,853)	
シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	727,876.800	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	862,084.680	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	465,594.000	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	599,000.000	608,404.300	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	503,000.000	536,449.500	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	380,540.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	505,246.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	413,000.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	514,666.200	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	368,000.000	413,407.520	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	133,000.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	415,000.000	416,120.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	124,000.000	127,100.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	226,777.600	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	318,000.000	331,400.520	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	251,625.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	190,000.000	187,188.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	200,394.000	

	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	150,000.000	145,965.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 7,446,840.120 (619,502,630)	
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	499,404.600	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	497,000.000	707,156.450	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	517,000.000	546,365.600	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	407,000.000	439,165.210	
	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	362,000.000	395,195.400	
スイス・フラン　小計			スイス・フラン 2,587,287.260 (294,510,909)	
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	9,095,000.000	10,614,774.500	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	8,385,000.000	8,942,434.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,723,097.000	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,892,791.550	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,624,021.750	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,930,783.800	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	5,932,078.400	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,950,000.000	2,955,428.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 57,615,409.800 (770,894,183)	

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	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	19,533,676.720	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	9,387,389.430	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	8,050,000.000	9,132,805.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,302,687.040	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	8,363,000.000	9,421,504.910	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20181115	3,164,000.000	3,192,602.560	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	2,600,000.000	2,613,234.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	1,500,000.000	1,534,290.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 60,118,190.160 (1,072,508,512)	
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	7,075,000.000	7,491,010.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,691,991.660	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,224,000.000	5,471,042.960	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,539,839.850	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,495,967.300	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,365,918.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	2,450,000.000	2,501,499.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 34,557,269.170 (469,287,715)	

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	2,638,263.400	
	5.5% Poland Government Bond 20191025	1,912,000.000	2,053,296.800	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,478,000.000	2,462,140.800	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,192,109.250	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,115,301.500	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	2,999,438.100	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,820,000.000	1,696,968.000	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,296,104.000	
	Poland Government Bond 20190425	400,000.000	392,180.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	1,300,000.000	1,290,705.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,033,998.100	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,466,710.400	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,224,161.200	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,367,511.250	
	3.25% Poland Government Bond 20190725	1,840,000.000	1,893,728.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,608,489.250	
ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 32,731,105.050 (1,034,302,920)	
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	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	647,000.000	673,514.060	

		3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	537,508.380	
		5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	787,962.600	
		4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,640,606.380	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,174,206.840	
		4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,958,516.040	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,533,454.900	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	650,000.000	632,365.500	
		3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	861,070.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	711,635.810	
		4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	595,004.220	
		3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,044,000.000	1,050,514.560	
		3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	982,081.100	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	477,000.000	444,034.530	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	558,288.060	
		3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	664,659.200	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	601,542.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,068,595.290	
		4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	869,297.950	
		3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	648,000.000	654,363.360	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	729,497.340	

		3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	704,921.000	
		3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,160,698.140	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	789,143.400	
		3.759% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190315	768,000.000	776,440.320	
		3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	697,591.440	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	910,209.600	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	637,916.500	
		3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	352,387.200	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500,000.000	504,335.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	755,707.500	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	350,000.000	348,250.000	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	500,000.000	507,705.000	
	マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 26,874,023.220 (736,885,717)	
	メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
		5% Mexican Bonos 20191211	21,447,000.000	20,619,145.800	
		5.75% Mexican Bonos 20260305	13,290,000.000	12,099,481.800	
		8% Mexican Bonos 20471107	4,000,000.000	4,204,360.000	
		8% Mexican Bonos 20231207	10,633,000.000	11,084,370.850	
		10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	25,601,636.550	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	10,668,000.000	10,846,795.680	
		10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	8,599,992.660	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	9,655,348.560	
		8.5% Mexican Bonos 20181213	22,092,000.000	22,379,416.920	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	10,683,854.340	
		8% Mexican Bonos 20200611	18,928,000.000	19,343,280.320	
		6.5% Mexican Bonos 20210610	27,826,000.000	27,312,053.780	

	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,437,597.050	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	13,099,000.000	12,791,304.490	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	15,654,000.000	16,005,119.220	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	7,142,320.640	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 231,806,078.660 (1,397,790,654)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	443,145.600	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	410,630.040	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	292,241.340	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	416,359.440	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	200,108.000	
	Finland Government Bond 20220415	270,000.000	273,272.400	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	298,653.000	
	0.25% Austria Government Bond 20191018	527,000.000	535,700.770	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	936,816.300	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	926,000.000	950,992.740	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	734,000.000	737,882.860	
	1.5% Austria Government Bond 20861102	150,000.000	131,989.500	
	Austria Government Bond 20230715	300,000.000	301,035.000	
	0.5% Austria Government Bond 20270420	380,000.000	378,939.800	
	2.1% Austria Government Bond 21170920	170,000.000	180,643.700	
	Austria Government Bond 20220920	400,000.000	404,700.000	

		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,453,323.170	
		1% Belgium Government Bond 20310622	924,000.000	927,474.240	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	614,910.420	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,344,122.120	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	744,000.000	738,271.200	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	190,000.000	204,954.900	
		0.2% Belgium Government Bond 20231022	150,000.000	151,929.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,000,000.000	1,018,590.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	650,000.000	664,781.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	260,000.000	291,655.000	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	307,320.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,353,635.980	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,567,000.000	2,481,783.260	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,067,979.080	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,371,581.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,586,287.020	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,336,217.680	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,864,832.250	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,191,804.490	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,006,611.250	

		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,463,023.440	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	2,816,019.540	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,650,477.110	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,248,636.000	
		3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,112,297.520	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	2,169,492.160	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,560,112.040	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,558,904.390	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,903,170.600	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,562,400.550	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	3,089,692.970	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,439,600.460	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,728,000.000	2,272,250.880	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,788,688.440	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,540,030.200	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,987,961.530	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,798,731.090	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,741,576.480	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,959,000.000	2,599,495.050	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,756,269.200	

		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,649,323.200	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,268,025.560	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,283,742.780	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,229,029.200	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,793,199.500	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,591,744.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	700,000.000	707,399.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	300,000.000	302,385.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20181214	950,000.000	957,277.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20190315	1,000,000.000	1,009,800.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20190614	400,000.000	404,744.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20190913	100,000.000	101,298.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190222	1,438,000.000	1,469,477.820	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190412	1,113,000.000	1,132,221.510	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,171,994.240	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,758,349.800	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,484,286.880	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,606,908.960	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,425,228.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	360,000.000	366,033.600	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	400,000.000	405,772.000	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	767,751.690	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,446,521.750	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,225,000.000	3,239,711.250	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	3,994,383.090	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,658,777.900	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,709,000.000	4,254,619.950	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,075,000.000	3,288,927.750	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,364,000.000	2,205,656.200	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,694,183.300	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,824,000.000	4,216,655.600	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,697,000.000	4,641,953.200	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,734,000.000	4,426,865.460	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	3,263,000.000	3,539,343.470	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,380,000.000	3,712,727.200	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	1,936,764.870	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,977,456.340	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,386,694.960	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,550,000.000	4,054,597.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	4,157,656.800	

		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,499,000.000	4,227,421.820	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	3,016,741.200	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,238,000.000	3,075,347.700	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,686,318.860	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181125	1,920,000.000	1,951,872.000	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,526,187.040	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190525	2,264,000.000	2,320,713.200	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,322,800.750	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,799,000.000	3,112,208.100	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2,322,000.000	2,374,546.860	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2,792,000.000	2,848,147.120	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3,070,000.000	3,112,488.800	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,101,000.000	2,217,668.530	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,240,522.310	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	2,720,000.000	2,902,212.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20190225	1,592,000.000	1,605,786.720	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,737,000.000	2,763,795.230	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,079,000.000	1,072,094.400	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	587,000.000	572,976.570	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,170,000.000	2,200,206.400	

		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,400,000.000	2,354,640.000
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	2,000,000.000	2,021,100.000
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	620,000.000	661,713.600
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20200225	700,000.000	709,037.000
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,602,675.000
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,000,000.000	1,077,070.000
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	500,000.000	502,100.000
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	500,000.000	501,860.000
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	765,994.400
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,856,443.260
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,083,041.500
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	953,147.090
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,347,000.000	1,450,705.530
		3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,270,707.720
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,349,000.000	2,112,614.940
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,662,465.420
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,609,021.340
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,445,773.760
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,531,560.700
		1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115	924,000.000	944,771.520

		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,084,000.000	1,490,218.160	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,713,272.680	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,400,119.740	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,297,183.890	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,357,267.200	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,218,000.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	900,000.000	921,807.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	200,000.000	200,142.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,622,291.860	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,633,242.900	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,425,176.560	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,970,947.280	
		1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,482,989.050	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,522,127.930	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,693,166.310	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,704,949.680	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,644,415.200	
		0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,541,673.300	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,591,000.000	1,655,069.570	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,568,897.600	

		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	788,914.980	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,371,902.400	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,388,864.940	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,290,140.920	
		0.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190415	812,000.000	817,001.920	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,693,384.920	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	884,776.200	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,520,364.160	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	690,690.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,363,432.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	448,000.000	405,301.120	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191015	858,000.000	863,379.660	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	700,000.000	706,048.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,060,000.000	1,102,654.400	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	300,000.000	314,340.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	350,000.000	361,697.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	120,000.000	121,346.400	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	600,000.000	650,448.000	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,000,000.000	1,023,400.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	711,998.000	

		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	550,000.000	558,167.500	
		0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015	100,000.000	100,579.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,454,000.000	3,294,347.760	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,119,767.960	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,655,000.000	2,375,735.950	
		4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190201	2,074,000.000	2,187,323.360	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,118,478.800	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,379,519.220	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,396,852.900	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	3,088,435.760	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,734,000.000	2,380,834.020	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,745,634.740	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190301	2,708,000.000	2,873,377.560	
		4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	2,531,000.000	2,734,188.680	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,665,418.280	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,784,343.410	
		4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,817,408.000	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,461,525.200	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,552,330.700	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,399,093.120	

		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,667,561.070	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,404,480.840	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	2,044,522.590	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,365,420.400	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,810,000.000	2,308,021.500	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,270,489.320	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,363,000.000	1,821,267.860	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,655,749.240	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20181201	2,111,000.000	2,194,110.070	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,942,358.600	
		2.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190501	1,100,000.000	1,144,638.000	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,570,195.740	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,230,793.040	
		2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,710,292.590	
		1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	1,246,000.000	1,284,127.600	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,550,350.580	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,751,942.960	
		4% Belgium Government Bond 20220328	1,377,000.000	1,637,542.170	
		4% Belgium Government Bond 20190328	821,000.000	871,532.550	
		3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	1,948,208.640	

		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,636,164.980	
		4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,706,757.180	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,346,004.660	
		4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,603,348.600	
		4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	958,902.000	
		3% Belgium Government Bond 20190928	1,123,000.000	1,197,219.070	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,514,589.240	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	753,000.000	1,130,042.160	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,752,301.600	
		3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	766,207.710	
		4.4% IRISH TREASURY 20190618	684,000.000	737,187.840	
		5.9% IRISH TREASURY 20191018	570,000.000	640,087.200	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,535,490.840	
		5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	888,126.750	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	607,783.680	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	728,302.880	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	879,053.930	
		0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	538,420.200	
		2% IRISH TREASURY 20450218	681,000.000	717,004.470	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,107,808.120	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	350,000.000	360,986.500	
		IRISH TREASURY 20221018	50,000.000	50,145.000	
		4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,035,000.000	1,160,286.750	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,280,804.250	
		3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,394,040.960	
		3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,538,392.310	

		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,073,000.000	1,637,419.460	
		4.35% Austria Government Bond 20190315	989,000.000	1,052,968.520	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,206,082.500	
		3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	936,626.430	
		3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	1,030,852.240	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	536,446.920	
		1.95% Austria Government Bond 20190618	738,000.000	767,852.100	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	870,480.520	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,061,948.650	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	748,646.550	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,030,903.840	
		4.375% Finland Government Bond 20190704	416,000.000	449,770.880	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	857,215.060	
		3.375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	691,907.280	
		3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	520,662.060	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	476,221.580	
		1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	666,584.280	
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	484,356.000	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	539,572.110	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	593,913.590	

		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,952,000.000	2,820,640.000	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,826,526.400	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,552,000.000	1,570,282.560	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,935,162.880	
		1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,250,000.000	1,293,412.500	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,835,662.920	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190131	1,672,000.000	1,683,938.080	
		0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,793,260.560	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,052,000.000	1,083,507.400	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	550,000.000	598,614.500	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,730,000.000	1,734,186.600	
		0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	580,000.000	584,570.400	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	1,818,630.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	550,000.000	564,525.500	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,300,000.000	1,295,372.000	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	300,000.000	300,756.000	
		0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	300,000.000	301,236.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	2,934,579.940	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,143,137.420	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,608,000.000	2,279,468.640	

	4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,102,062.680	
	4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,577,871.860	
	4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,932,531.250	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,373,000.000	1,906,808.670	
	4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,314,440.590	
	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,789,000.000	2,271,189.170	
	4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,923,736.400	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,986,864.300	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,718,774.000	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,447,517.860	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,270,849.280	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,601,000.000	1,954,772.970	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,270,000.000	1,716,913.000	
	3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20181031	1,254,000.000	1,301,764.860	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,049,000.000	1,543,991.630	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190430	1,836,000.000	1,916,857.440	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,347,786.900	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,366,128.980	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,967,089.000	

	ユーロ　小計		ユーロ 509,357,311.520	

				(67,647,744,543)	
	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	2,978,000.000	2,993,128.240	
		7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,682,979.680	
		10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	16,434,000.000	17,622,178.200	
		6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	5,229,520.120	
		6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,417,707.600	
		6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,007,528.800	
		7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,172,832.930	
		7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	5,539,000.000	5,340,149.900	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	13,452,000.000	11,553,250.200	
		8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,479,713.150	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	8,862,000.000	7,763,998.200	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	7,944,000.000	6,818,255.760	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	8,243,000.000	7,191,440.490	
		8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	4,166,000.000	3,752,941.100	
		9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	2,179,000.000	1,933,666.390	
	南アフリカ・ランド　小計			南アフリカ・ランド 102,959,290.760 (844,266,184)	
国債証券　合計				164,124,972,994 [164,124,972,994]	
合計				164,124,972,994 [164,124,972,994]	

（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	244銘柄	100%	43.1%
イギリス・ポンド	国債証券	41銘柄	100%	7.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	22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	5銘柄	100%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.5%
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	7銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16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	16銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	301銘柄	100%	41.2%
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。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成29年12月1日から平成30年5月31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。

【中間財務諸表】

ダイワライフスタイル７５

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 平成30年5月31日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,713,816
コール・ローン	4,718,602
親投資信託受益証券	960,756,941
未収入金	195,000
流動資産合計	968,384,359
資産合計	968,384,359
負債の部	
流動負債	
未払解約金	121,791
未払受託者報酬	410,872
未払委託者報酬	4,211,917
その他未払費用	38,520
流動負債合計	4,783,100
負債合計	4,783,100
純資産の部	
元本等	
元本	※1 657,722,479
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	305,878,780
（分配準備積立金）	264,433,744
元本等合計	963,601,259
純資産合計	963,601,259
負債純資産合計	968,384,359

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　平成29年12月1日 至　平成30年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	△ 7,884,685
営業収益合計	△ 7,884,685
営業費用	
支払利息	1,510
受託者報酬	410,872
委託者報酬	4,211,917
その他費用	38,554
営業費用合計	4,662,853
営業利益又は営業損失（△）	△ 12,547,538
経常利益又は経常損失（△）	△ 12,547,538
中間純利益又は中間純損失（△）	△ 12,547,538
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	171,496
期首剰余金又は期首欠損金（△）	305,785,576
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,889,645
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,889,645
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,077,407
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,077,407
中間剰余金又は中間欠損金（△）	305,878,780

(3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自　平成29年12月1日 至　平成30年5月31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。

（中間貸借対照表に関する注記）

区　分	当中間計算期間末 平成30年5月31日現在
1.　※1　期首元本額	631,550,724円
期中追加設定元本額	46,971,239円
期中一部解約元本額	20,799,484円
2.　中間計算期間末日における受益権の総数	657,722,479口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自　平成29年12月1日 至　平成30年5月31日
	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	当中間計算期間末 平成30年5月31日現在
1.　金融商品の時価及び中間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、中間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。

（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

当中間計算期間末 平成30年5月31日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 平成30年5月31日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4651円 (14,651円)

（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、中間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、当ファンドの中間計算期間末日（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30年5月31日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,867,374,623
コール・ローン	6,724,333,158
株式　※2※3	140,746,928,475
派生商品評価勘定	19,258,540

未収入金	987,840
未収配当金	1,183,162,340
未収利息	808,079
前払金	17,720,000
その他未収収益　※4	23,217,075
流動資産合計	152,583,790,130
資産合計	152,583,790,130
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,924,140
未払解約金	70,061,700
受入担保金	9,275,763,000
その他未払費用	140,676
流動負債合計	9,371,889,516
負債合計	9,371,889,516
純資産の部	
元本等	
元本　※1	130,441,146,325
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	12,770,754,289
元本等合計	143,211,900,614
純資産合計	143,211,900,614
負債純資産合計	152,583,790,130

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29年12月1日 至　平成30年5月31日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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)新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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30年5月31日現在
1．※1　期首	平成29年12月1日
期首元本額	128,627,233,302円
期中追加設定元本額	9,288,196,086円
期中一部解約元本額	7,474,283,063円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックスファンド	4,170,198,428円

ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	9,721,390,107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	61,538,898円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	71,040,156円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,200,533,489円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	58,786,280円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,626,420,956円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	27,081,953円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	21,745,004円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	637,974円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	495,697,500円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	862,959,379円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	62,863,383,161円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,327,234,529円
ダイワ・ライフ・バランス５０	2,510,039,076円
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,427,828,638円
年金ダイワ日本株式インデックス	4,410,903,306円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	15,008,044円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	49,058,874円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	14,593,445円

ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	330,547円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	338,072円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	676,615円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	2,160,411円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	4,779,668円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	10,239,884円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	234,954,399円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	162,509,645円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	9,996,448,139円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	58,004,356円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	66,229,447円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	859,818,096円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	129,181,252円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	225,110,840円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	99,439,448円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	7,492,469,208円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	89,525,125円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	1,694,473,668円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,351,697,654円

ダイワライフスタイル２５	174,970,735円
ダイワライフスタイル５０	616,175,702円
ダイワライフスタイル７５	522,270,600円
ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	13,713,263,617円
計	130,441,146,325円
2.　期末日における受益権の総数	130,441,146,325口
3.　※2　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　8,796,093,500円
4.　※3　差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　692,100,000円
5.　※4　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21,447,362円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成30年5月31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。

（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

	平成30年5月31日 現在

種　類	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	2,448,890,000	－	2,442,300,000	△6,590,000
合計	2,448,890,000	－	2,442,300,000	△6,590,000

（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30年5月31日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0979円 (10,979円)

「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30年5月31日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	70,546,617
コール・ローン	122,661,753

国債証券	62,013,205,010
地方債証券	4,461,631,250
特殊債券	3,339,310,300
社債券	3,608,608,000
未収入金	406,318,000
未収利息	189,497,689
前払費用	4,239,354
流動資産合計	74,216,017,973
資産合計	74,216,017,973
負債の部	
流動負債	
未払解約金	184,660,000
その他未払費用	3,919
流動負債合計	184,663,919
負債合計	184,663,919
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	52,806,028,865
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	21,225,325,189
元本等合計	74,031,354,054
純資産合計	74,031,354,054
負債純資産合計	74,216,017,973

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　平成29年12月1日 至　平成30年5月31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30年5月31日現在
1.　※1　期首	平成29年12月1日
期首元本額	48,889,824,254円
期中追加設定元本額	7,380,612,876円
期中一部解約元本額	3,464,408,265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)	144,466,105円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	953,450,220円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	110,876,266円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,291,984,154円
Ｄ－Ｉ'ｓ 日本債券インデックス	761,060円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	5,419,388,519円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	13,951,309,414円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,276,987,060円

ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	312,147,523円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	416,966,702円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	55,443,248円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	17,582,253,602円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	147,578,801円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	1,405,276,927円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,301,099,403円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,354,998,021円
ダイワライフスタイル２５	451,879,777円
ダイワライフスタイル５０	489,816,322円
ダイワライフスタイル７５	139,345,741円
計	52,806,028,865円
2. 期末日における受益権の総数	52,806,028,865口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成30年5月31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。

（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30年5月31日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成30年5月31日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4019円 (14,019円)

「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30年5月31日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	347,256,886
金銭信託	220,445,941
コール・ローン	383,296,705
株式	95,578,378,390
投資証券	2,446,942,169
派生商品評価勘定	35,580,074
未収入金	40,092,041
未収配当金	223,855,286
差入委託証拠金	722,558,124
流動資産合計	99,998,405,616
資産合計	99,998,405,616
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	92,395
未払金	24,266,236
未払解約金	102,664,300
その他未払費用	2,075
流動負債合計	127,025,006
負債合計	127,025,006
純資産の部	
元本等	
元本　※1	41,758,957,841

剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	58,112,422,769
元本等合計	99,871,380,610
純資産合計	99,871,380,610
負債純資産合計	99,998,405,616

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29年12月1日 至　平成30年5月31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30年5月31日現在
1．※1　期首	平成29年12月1日
期首元本額	39,734,106,968円
期中追加設定元本額	3,847,998,552円
期中一部解約元本額	1,823,147,679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	515,968,573円

ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	16,429,883円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	236,749,298円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	26,978,339円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	748,398,890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）	545,958,104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）	1,340,748,243円
ダイワファンドラップオンライン 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）	480,100,832円
Ｄ－Ｉ'ｓ 外国株式インデックス	1,011,122円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	195,844円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	519,397,620円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	396,766,657円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	25,618,955,780円
ダイワ・ライフ・バランス３０	545,549,449円
ダイワ・ライフ・バランス５０	768,584,744円
ダイワ・ライフ・バランス７０	620,305,430円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,475,176,982円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	4,413,556円

	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	13,149,627円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	3,879,429円
	ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	77,536円
	ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	158,798円
	ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	675,106円
	ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	2,241,162円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	324,778,874円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	376,573,646円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,462,130,787円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	170,696,684円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	586,718,912円
	ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	62,670,790円
	ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	463,630円
	ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,741,534,322円
	ダイワライフスタイル２５	20,140,252円
	ダイワライフスタイル５０	71,182,267円
	ダイワライフスタイル７５	60,196,673円
計		41,758,957,841円
2.	期末日における受益権の総数	41,758,957,841口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成30年5月31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。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種　類	平成30年5月31日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買　建	1,742,655,301	－	1,776,918,900	34,263,599
合計	1,742,655,301	－	1,776,918,900	34,263,599

（注）　1．　時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2．　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

	平成30年5月31日 現在

種　類	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買　建	476,791,920	－	478,016,000	1,224,080
アメリカ・ドル	476,791,920	－	478,016,000	1,224,080
合計	476,791,920	－	478,016,000	1,224,080

（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30年5月31日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3916円 (23,916円)

「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30年5月31日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	582,950,009
金銭信託	670,880,788
コール・ローン	1,166,482,786
国債証券	159,489,923,150
派生商品評価勘定	8,352,326
未収利息	1,230,679,309
前払費用	28,670,713
流動資産合計	163,177,939,081
資産合計	163,177,939,081
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,531,871
未払金	697,651,672
未払解約金	63,813,000
その他未払費用	11,629
流動負債合計	775,008,172
負債合計	775,008,172
純資産の部	
元本等	
元本　※1	60,565,338,399
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	101,837,592,510
元本等合計	162,402,930,909
純資産合計	162,402,930,909
負債純資産合計	163,177,939,081

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29年12月1日 至　平成30年5月31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30年5月31日現在
1．※1　期首	平成29年12月1日
期首元本額	59,383,778,765円
期中追加設定元本額	3,513,148,736円
期中一部解約元本額	2,331,589,102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	854,871,741円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	29,450,309円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	211,379,884円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	56,735,456円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	668,173,943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）	352,651,388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）	868,917,278円
ダイワファンドラップオンライン 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）	624,454,883円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	894,669円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	27,099円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	429,402,986円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	355,212,538円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	41,268,876,244円
ダイワ・ライフ・バランス３０	714,565,886円
ダイワ・ライフ・バランス５０	344,038,669円
ダイワ・ライフ・バランス７０	222,100,991円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	301,075,789円

	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	246,231,116円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	78,414,018円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	11,140,956円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	18,253,578円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	1,736,790円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	336,920,936円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	164,742,227円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	6,143,671,153円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	94,326,977円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	40,908,853円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	349,404,648円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	138,596,838円
	ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	26,607,583円
	ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	373,707円
	ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,494,070,788円
	ダイワライフスタイル２５	35,965,029円
	ダイワライフスタイル５０	63,227,770円
	ダイワライフスタイル７５	17,915,679円
計		60,565,338,399円
2.	期末日における受益権の総数	60,565,338,399口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成30年5月31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。

（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30年5月31日 現在			
	契約額等 （円）	うち １年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買　建	1,715,001,535	－	1,709,821,990	△5,179,545
アメリカ・ドル	760,113,484	－	758,536,800	△1,576,684
イギリス・ポンド	131,429,293	－	130,380,080	△1,049,213
オーストラリア・ドル	42,297,048	－	42,641,760	344,712
カナダ・ドル	49,063,219	－	49,164,390	101,171
メキシコ・ペソ	12,302,215	－	11,968,320	△333,895
ユーロ	704,365,103	－	701,577,280	△2,787,823
南アフリカ・ランド	15,431,173	－	15,553,360	122,187
合計	1,715,001,535	－	1,709,821,990	△5,179,545

（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30年5月31日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6815円 (26,815円)

２　【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成30年6月29日

Ⅰ	資産総額	959,016,843円
Ⅱ	負債総額	4,597,658円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	954,419,185円
Ⅳ	発行済数量	653,861,583口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4597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30年6月29日

Ⅰ	資産総額	155,156,224,427円
Ⅱ	負債総額	11,773,371,253円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	143,382,853,174円
Ⅳ	発行済数量	131,699,076,824口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0887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30年6月29日

Ⅰ	資産総額	76,376,217,059円
Ⅱ	負債総額	117,173,015円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	76,259,044,044円
Ⅳ	発行済数量	54,369,117,216口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4026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30年6月29日

Ⅰ	資産総額	101,247,191,104円
Ⅱ	負債総額	48,839,841円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	101,198,351,263円
Ⅳ	発行済数量	41,980,030,940口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4106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30年6月29日

Ⅰ	資産総額	165,013,463,720円
Ⅱ	負債総額	116,261,364円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	164,897,202,356円
Ⅳ	発行済数量	60,597,290,881口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7212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

2018年6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。

2018年6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	81	186,533
追加型株式投資信託	708	15,390,018
株式投資信託　　合計	789	15,576,552
単位型公社債投資信託	25	99,407
追加型公社債投資信託	14	1,494,843
公社債投資信託　合計	39	1,594,250
総合計	828	17,170,801

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。

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、当事業年度（平成29年４月１日から平成30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。

３．財務諸表の記載金額は、百万円未満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29年３月31日）		当事業年度 （平成30年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		31,260		28,709
有価証券		110		0
前払費用		190		201
未収委託者報酬		10,453		12,368
未収収益		72		82
繰延税金資産		439		552
その他		34		47
流動資産計		42,560		41,962
固定資産				
有形固定資産	※1	229	※1	213
建物		15		12
器具備品		214		200
無形固定資産		2,650		2,614
ソフトウェア		2,323		2,456
ソフトウェア仮勘定		327		158
投資その他の資産		12,353		15,066
投資有価証券		5,920		8,600
関係会社株式		5,129		5,129
出資金		185		183
長期差入保証金		1,050		1,072
繰延税金資産		31		45
その他		37		34
固定資産計		15,234		17,894
資産合計		57,795		59,856

（単位:百万円）

	前事業年度 （平成29年３月31日）		当事業年度 （平成30年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		79		65
未払金		9,466		9,747
未払収益分配金		7		8
未払償還金		59		59
未払手数料		4,453		5,202
その他未払金	※2	4,946	※2	4,476
未払費用		4,077		4,148
未払法人税等		980		850
未払消費税等		223		583
賞与引当金		945		1,012
その他		3		335
流動負債計		15,776		16,744
固定負債				
退職給付引当金		2,318		2,350
役員退職慰労引当金		151		125
その他		7		5
固定負債計		2,477		2,481
負債合計		18,254		19,225
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		12,231		13,370
利益剰余金合計		12,606		13,744
株主資本合計		39,276		40,414
評価・換算差額等				

その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日）	当事業年度 （自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973
賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316

役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日）	当事業年度 （自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日）
営業外収益		
受取配当金	92	75
投資有価証券売却益	224	210
有価証券償還益	94	17
その他	69	55
営業外収益計	481	359
営業外費用		
投資有価証券売却損	24	0
その他	75	29
営業外費用計	100	29
経常利益	16,935	18,741
特別損失		
MMF等償還関連費用	305	-
関係会社整理損失	-	333
特別損失計	305	333
税引前当期純利益	16,629	18,407
法人税、住民税及び事業税	6,501	5,843
法人税等調整額	△1,405	△106
法人税等合計	5,096	5,737
当期純利益	11,533	12,670

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　平成28年４月１日 至　平成29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	13,960	14,334	41,004
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,261	△13,261	△13,261
当期純利益	-	-	-	11,533	11,533	11,533
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,728	△1,728	△1,728
当期末残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△13,261
当期純利益	-	-	11,533
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△15	△15	△15
当期変動額合計	△15	△15	△1,743
当期末残高	264	264	39,540

当事業年度（自　平成29年４月１日 至　平成30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	12,231	12,606	39,276

当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,532	△11,532	△11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

	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	264	264	39,540
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△47	△47	△47
当期変動額合計	△47	△47	1,090
当期末残高	216	216	40,631

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」に独立掲記しておりました「受取利息」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」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」に表示していた「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万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29年３月31日）	当事業年度 （平成30年３月31日）
建物	26百万円	29百万円
器具備品	264百万円	235百万円

※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29年３月31日）	当事業年度 （平成30年３月31日）
未払金	4,877百万円	4,406百万円

３　保証債務

前事業年度（平成29年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,685百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成30年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　平成28年４月１日　至　平成29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

（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29年６月26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　　11,532百万円
②　配当の原資　　利益剰余金
③　１株当たり配当額　　4,421円
④　基準日　　平成29年３月31日
⑤　効力発生日　　平成29年６月27日

当事業年度（自　平成29年４月１日　至　平成30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29年６月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 ３月31日	平成29年 ６月27日

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

平成30年６月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

①　剰余金の配当の総額　12,669百万円
②　配当の原資　利益剰余金
③　１株当たり配当額　4,857円
④　基準日　平成30年３月31日
⑤　効力発生日　平成30年６月26日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（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代行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29年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	31,260	31,260	―
（２）未収委託者報酬	10,453	10,453	―
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	5,060	5,060	―
資産計	46,774	46,774	―
（１）未払手数料	(4,453)	(4,453)	―
（２）その他未払金	(4,946)	(4,946)	―
（３）未払費用（*2）	(3,409)	(3,409)	―
負債計	(12,809)	(12,809)	―

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(*2) 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30年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	28,709	28,709	―
（２）未収委託者報酬	12,368	12,368	―
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	7,631	7,631	―
資産計	48,709	48,709	―
（１）未払手数料	(5,202)	(5,202)	―
（２）その他未払金	(4,476)	(4,476)	―

（３）未払費用（*2）	(3,286)	(3,286)	―
負債計	(12,965)	(12,965)	―

（*1）負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
（*2）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29年３月31日）	当事業年度 （平成30年３月31日）
（１）その他有価証券		
非上場株式	970	970
（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	1,050	1,072

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29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	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
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	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

当事業年度（平成30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	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
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	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

（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29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30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29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	122	55	67
（２）その他			
証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
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	1,829	1,926	△96
小計	1,829	1,926	△96
合計	5,060	4,679	381

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　970百万円）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30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	134	55	79
（２）その他			
証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
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	3,299	3,522	△223
小計	3,299	3,522	△223
合計	7,631	7,318	312

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　970百万円）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28年４月１日　至　平成29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	50	-	1
（２）その他			
証券投資信託	4,371	224	23
合計	4,421	224	24

当事業年度（自　平成29年４月１日　至　平成30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	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、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28年４月１日 至　平成29年３月31日）	当事業年度 （自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,209百万円	2,318百万円
勤務費用	202	159
退職給付の支払額	△122	△166
その他	29	38
退職給付債務の期末残高	2,318	2,350

（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28年４月１日 至　平成29年３月31日）	当事業年度 （自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,318百万円	2,350百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,318	2,350
退職給付引当金	2,318	2,350
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,318	2,350

（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28年４月１日 至　平成29年３月31日）	当事業年度 （自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日）
勤務費用	202百万円	159百万円
その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

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173百万円、当事業年度171百万円であります。

（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29年３月31日）	当事業年度 （平成30年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	709	719
賞与引当金	224	244
未払事業税	169	162
出資金評価損	98	94
投資有価証券評価損	65	68
連結法人間取引（譲渡損）	5	5
その他	185	308
繰延税金資産小計	1,458	1,602
評価性引当額	△201	△200
繰延税金資産合計	1,257	1,402
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△639	△639
その他有価証券評価差額金	△146	△164
繰延税金負債合計	△786	△804
繰延税金資産の純額	470	598

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29年３月31日）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（平成30年３月31日）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

（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28年４月１日　至　平成29年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　平成29年４月１日　至　平成30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28年４月１日　至　平成29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）	1,685	－	－

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29年４月１日　至　平成30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）	1,701	－	－

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28年４月１日　至　平成29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）	23,238	未払手数料	3,298
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）	768	未払費用	218
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）	1,036	長期差入保証金	1,028

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29年４月１日　至　平成30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）	23,216	未払手数料	3,913
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）	1,020	未払費用	233
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）	1,048	長期差入保証金	1,055

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28年４月１日 至　平成29年３月31日）		当事業年度 （自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日）	
１株当たり純資産額	15,158.25円	１株当たり純資産額	15,576.40円
１株当たり当期純利益	4,421.51円	１株当たり当期純利益	4,857.40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28年４月１日 至　平成29年３月31日）	当事業年度 （自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日）
当期純利益（百万円）	11,533	12,670
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。

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（2018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 （2018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（2018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。

⑫　委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

⑬　UD FONT マークおよび説明文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30年５月25日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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29年４月１日から平成30年３月31日までの第59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30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12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年12月1日から平成29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29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30年7月6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29年12月1日から平成30年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワライフスタイル７５の平成30年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年12月1日から平成30年5月31日まで）の損益の状況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
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。