

【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9月11日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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】	高橋 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】	D C ダイワ・ターゲットイヤー2030
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

DCダイワ・ターゲットイヤー2030

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い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】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位

(7) 【申込期間】

2018年9月12日から2019年3月11日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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します。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

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

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

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

当ファンドは、積立投資専用です。

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

ロ．収益分配金は、自動的に再投資されます。

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

取得申込金額に利息は付きません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの特色 >

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

- 当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2030年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

◆2030年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

〈2018年7月時点の基本配分比率〉

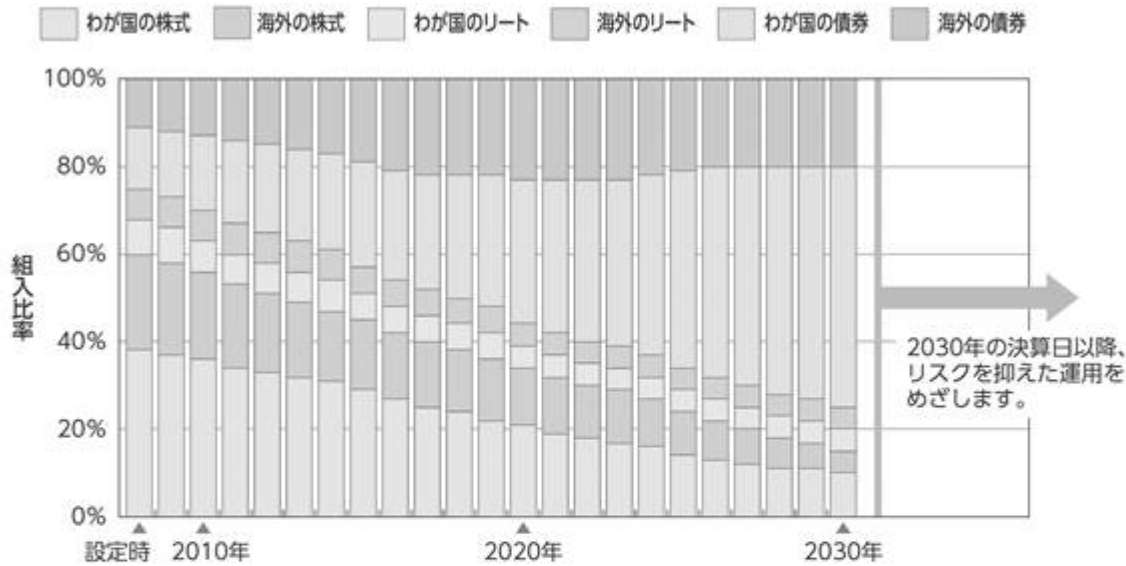
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	24%	14%	6%	6%	28%	22%

〈当初設定時の基本配分比率〉

	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	38%	22%	8%	7%	14%	11%

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

ファンドの基本配分比率のイメージ



- (注1) 2018年7月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2017年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要性があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。

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

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

運用プロセス



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

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

東証株価指数（TOPIX）とは

東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするもので、1968年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。

3 海外の株式への投資にあたっては、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

運用プロセス



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

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

MSCIコクサイ指数とは

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

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

4

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

運用プロセス



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

- 運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワJ-REITマザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

東証REIT指数とは

- 「東証REIT指数」は、東京証券取引所上場の不動産投信全銘柄を対象とする時価総額加重平均の指数で、2003年4月より算出・公表されています。

【算出方法の概要】

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

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

(注2) 2003年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市況変動によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額を修正します。なお、配当込み指数の算出に際しては、権利落（金銭の分配）についても、基準時の時価総額の修正が行なわれます。

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

5

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

運用プロセス



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

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

- 運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

【特徴】

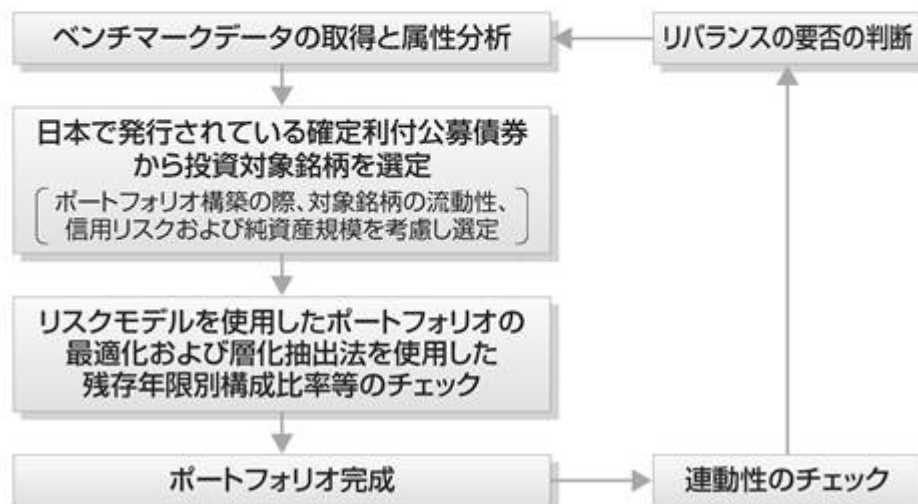
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

S&P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

6

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

運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

NOMURA－BPI総合指数とは

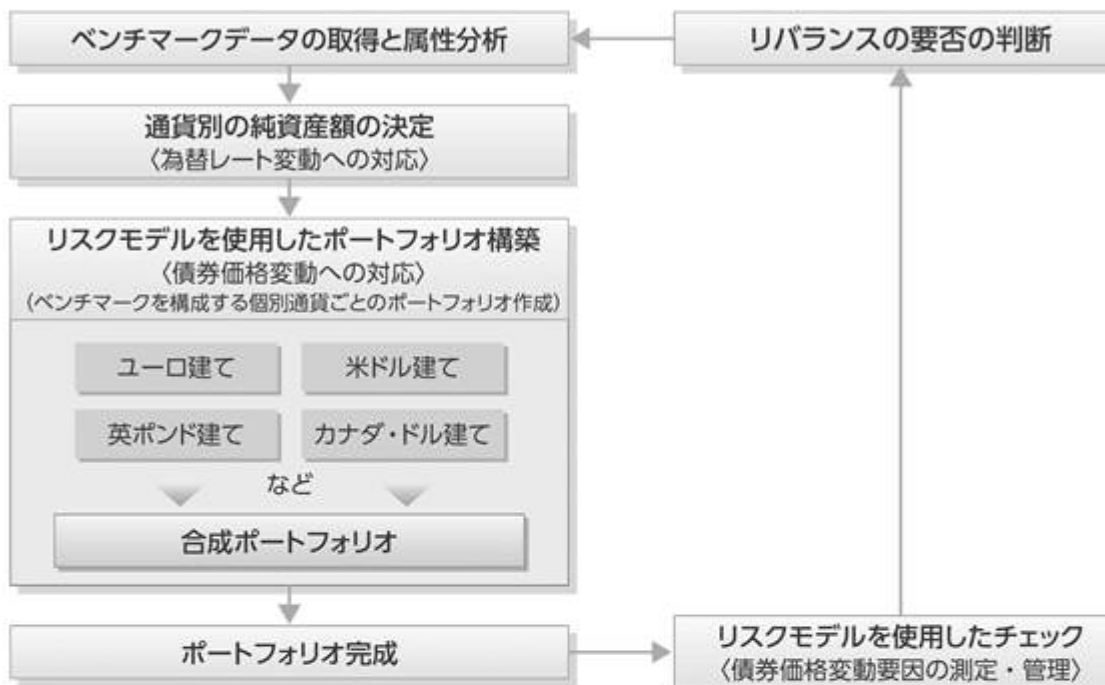
NOMURA－BPIは、野村証券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

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

7

海外の債券への投資にあたっては、投資成果を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います。

運用プロセス



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

①為替レート変動への対応

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

②債券価格変動への対応

ベンチマークは構成する債券の銘柄数が多く、構成銘柄の比率がベンチマークと同一のポートフォリオを構築することは困難です。したがって、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、リスクモデル⁽¹⁾を使用した効率的な複製を行なうことを基本とします。なお、リスクモデルを使用した効率的な複製はベンチマークを構成する通貨別に行ないます。

③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

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。

8

2030年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

NOMURA－BPI 総合短期指数とは

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

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

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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

〈2030年の決算日前日まで〉



※ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドに投資することがあります。

〈2030年の決算日から〉



• 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

9

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

10

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

〈分配方針〉

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

(2) 【ファンドの沿革】

2008年2月28日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など	お申込金（ 3 ）
お取扱窓口	販売会社	<p>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。</p> <p>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</p> <p style="text-align: right;">など</p>
1	収益分配金、償還金など	お申込金（ 3 ）

委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約(以下「信託契約」といいます。)(2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
運用指図	2	損益 信託金(3)
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など
		損益 投資
投資対象	内外の株式・債券・リート(REIT)および短期金融資産 など (ファミリーファンド方式で運用を行ないます。)	

(注) 収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況(2018年7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
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
3. ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券
4. ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)の受益証券
6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
7. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

投資態度

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

ロ. マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2030年に近づくにしながら株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないません。

当初設定時の基本配分比率

トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の38%

外国株式インデックスマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の22%

ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の 8%

ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券
.....信託財産の純資産総額の 7%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)の受益証券
.....信託財産の純資産総額の14%

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の11%

ハ. 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．2030年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデクスマザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

(2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1. 預金

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

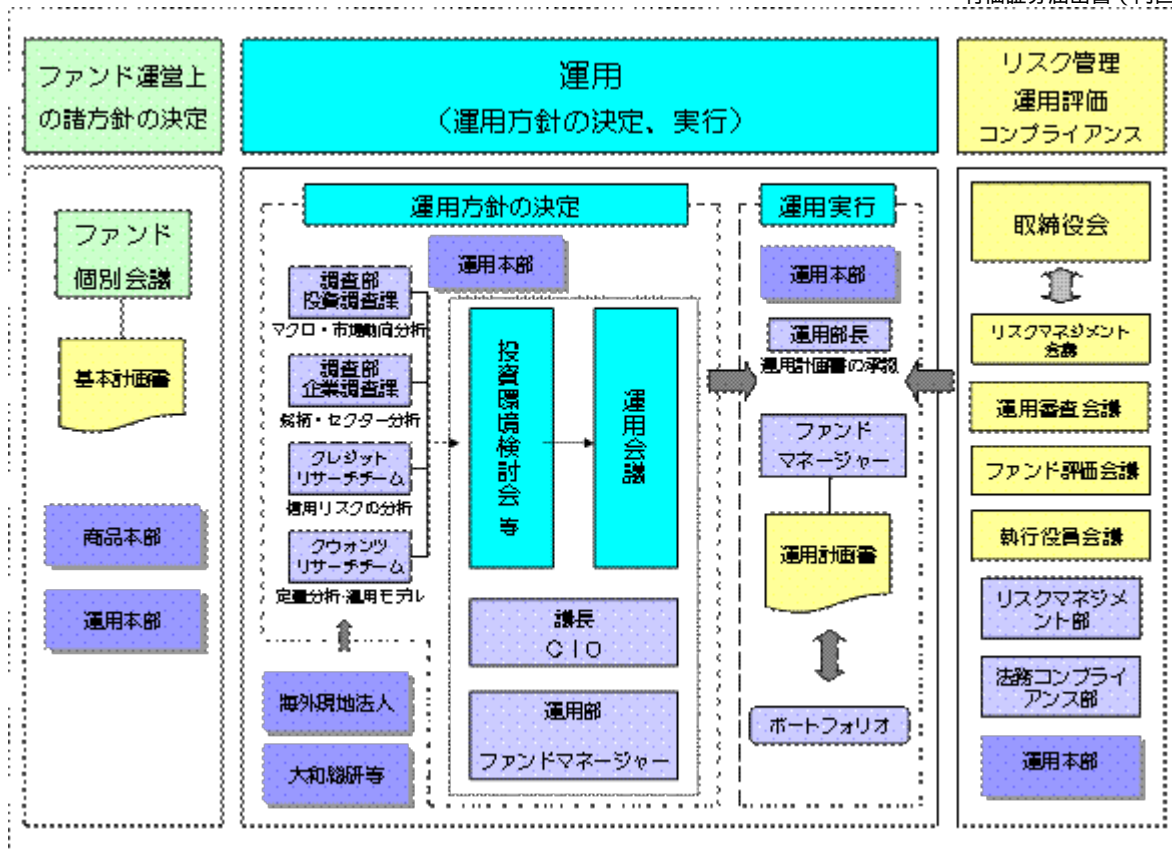
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更

- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的確な状況報告
- ・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。

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。

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7月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> 各マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

（注）東証株価指数（TOPIX）とは

東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするもので、1968年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. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

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

(2) 投資対象

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

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

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）MSCIコクサイ指数とは

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

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

3. ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

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

は同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下、「<参考>各マザーファンドの概要」において同じ。

投資態度

- イ．東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」(配当込み、以下同じ。)に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ．投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄(採用予定を含みます。)とし、組入比率を高位に保ちます。
- ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、「東証REIT指数」が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

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

- 1．次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)に定めるものに限ります。)
 - ハ．約束手形
 - ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 3．投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 4．新投資口予約権証券(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、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限ります。)
- 5．指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引

委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこ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。

（注）東証REIT指数とは

「東証REIT指数」は、東京証券取引所上場の不動産投信全銘柄を対象とする時価総額加重平均の指数で、2003年4月より算出・公表されています。

[算出方法の概要]

$$\text{指数} = \text{算出時の時価総額}^{(\text{注1})} \div \text{基準時の時価総額}^{(\text{注2})} \times 1,000$$

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

（注2）2003年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市況変動によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額を修正します。なお、配当込み指数の算出に際しては、権利落（金銭の分配）についても、基準時の時価総額の修正が行なわれます。

東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有します。

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

本商品は、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド**(1) 投資方針****主要投資対象**

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

投資態度

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。)および外国の金融商品取引所におけるこ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。

(注) S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本) (円ベース) とは

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

[特徴]

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

S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本) (「当インデックス」) は S&P Dow Jones Indices LLC (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor 's®および S&P® は Standard & Poor 's Financial Services LLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones® は Dow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが SPDJI に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本) の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの
委託会社は、信託金を、前に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引

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

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

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

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

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

（注）NOMURA - B P I 総合指数とは

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

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

6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引

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

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

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

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

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

(注) NOMURA - B P I 総合短期指数とは

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

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

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

7. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果を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

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

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

16. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

(3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注) 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

〈基準価額の主な変動要因〉

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

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



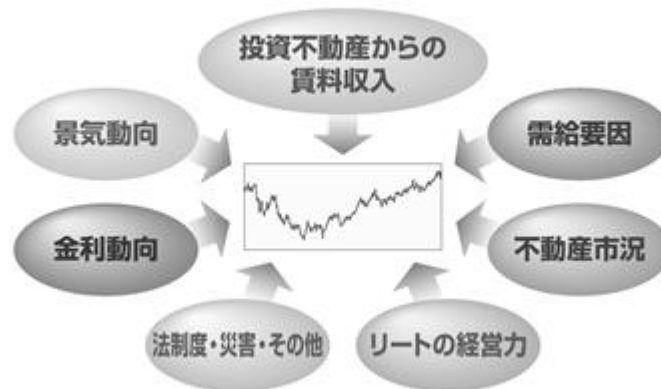
※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

す。)。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リートの主な価格変動要因〉



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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

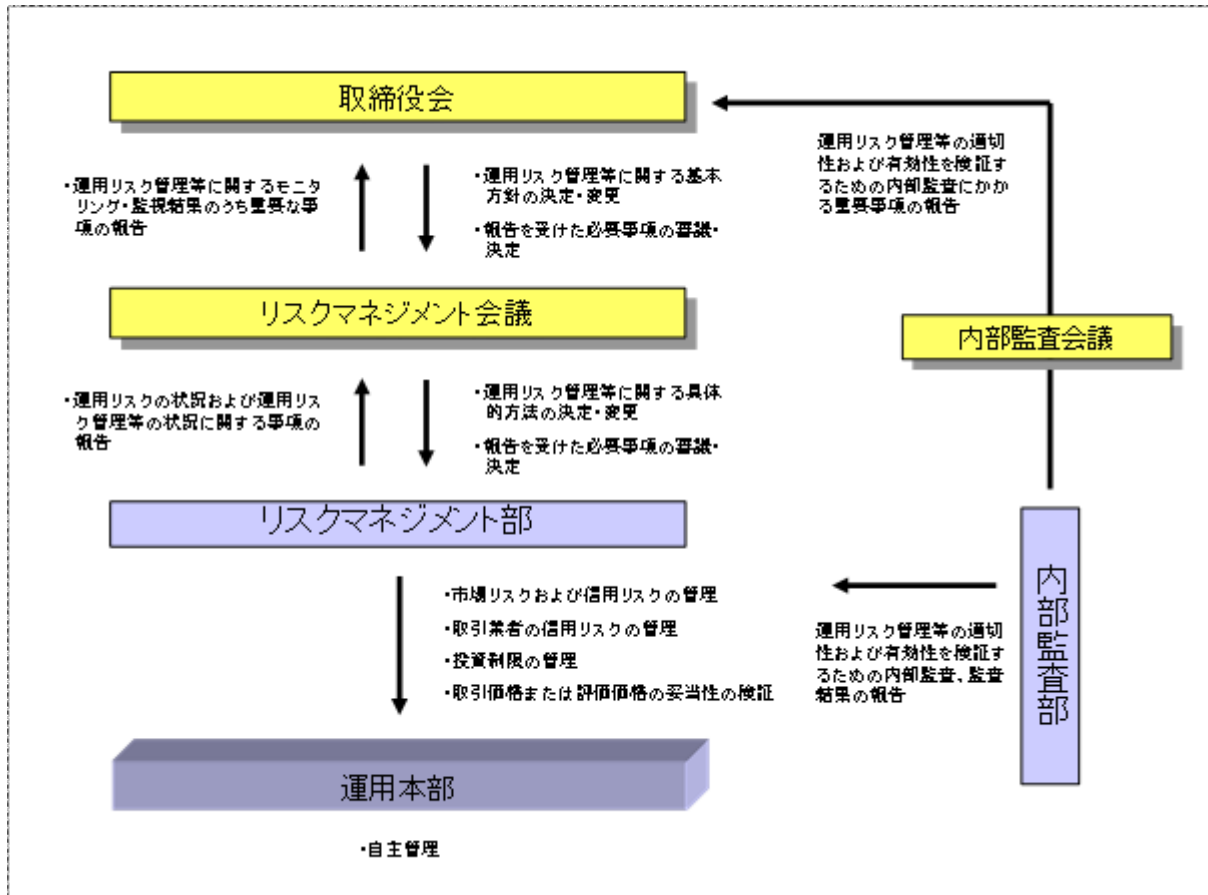
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者があるご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。

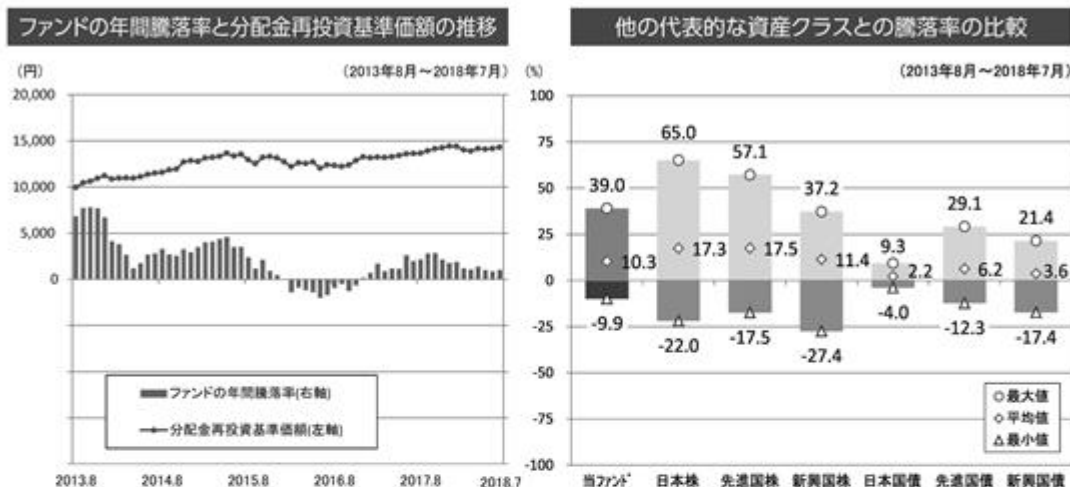


流動性リスクに対する管理体制

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

参 考 情 報

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



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

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
 日本国債：NOMURA-BPI国債
 先進国債：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・インデックスー エマージング・マーケット 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.が発行した指数です。同指数に対する著作権、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。●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・インデックスー エマージング・マーケット 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】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、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に信託財産中から支弁します。

	信託報酬率
第1計算期間から2016年3月11日まで	年率0.7020%（税抜0.65%）
2016年3月12日から第18計算期間まで	年率0.3672%（税抜0.34%）
第19計算期間から第23計算期間まで	年率0.3024%（税抜0.28%）
第24計算期間以降	年率0.2376%（税抜0.22%）

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

< 第1計算期間から2016年3月11日まで >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.300% （税抜）	年率0.300% （税抜）	年率0.05% （税抜）

< 2016年3月12日から第18計算期間まで >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.155% （税抜）	年率0.155% （税抜）	年率0.03% （税抜）

< 第19計算期間から第23計算期間まで >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.125% （税抜）	年率0.125% （税抜）	年率0.03% （税抜）

< 第24計算期間以降 >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.095% （税抜）	年率0.095% （税抜）	年率0.03% （税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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】

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

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

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

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

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

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

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

() 上記は、2018年7月末現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2018年7月31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	210,999,818	99.80
内 日本	210,999,818	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	414,294	0.20
純資産総額	211,414,112	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】（2018年7月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資 信託受 益証券	46,145,310	1.2705 58,631,767	1.2744 58,807,583	27.82
2	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	46,711,187	1.1262 52,610,458	1.1028 51,513,097	24.37
3	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	16,754,570	2.8242 47,318,613	2.7415 45,932,653	21.73
4	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	11,832,878	2.4294 28,747,515	2.5061 29,654,375	14.03
5	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	4,919,239	2.3728 11,672,373	2.5747 12,665,564	5.99
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	5,532,499	2.2708 12,563,379	2.2461 12,426,546	5.88

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.80%
合計	99.80%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2008年12月18日)	2,735,746	2,735,746	0.6530	0.6530
第2計算期間末 (2009年12月18日)	7,830,771	7,830,771	0.7362	0.7362
第3計算期間末 (2010年12月20日)	19,887,419	19,887,419	0.7670	0.7670
第4計算期間末 (2011年12月19日)	22,353,895	22,353,895	0.6876	0.6876
第5計算期間末 (2012年12月18日)	43,076,218	43,076,218	0.8120	0.8120
第6計算期間末 (2013年12月18日)	73,041,242	73,041,242	1.0850	1.0850
第7計算期間末 (2014年12月18日)	113,864,260	113,864,260	1.2566	1.2566
第8計算期間末 (2015年12月18日)	164,118,771	164,118,771	1.3135	1.3135

第9計算期間末 (2016年12月19日)	202,443,979	202,443,979	1.3306	1.3306
2017年7月末日	237,509,462	-	1.3622	-
8月末日	237,310,154	-	1.3657	-
9月末日	237,045,674	-	1.3924	-
10月末日	231,286,047	-	1.4141	-
11月末日	229,936,116	-	1.4257	-
第10計算期間末 (2017年12月18日)	229,901,968	229,901,968	1.4390	1.4390
12月末日	228,371,424	-	1.4433	-
2018年1月末日	228,371,229	-	1.4386	-
2月末日	225,747,954	-	1.4012	-
3月末日	223,852,126	-	1.3884	-
4月末日	228,523,511	-	1.4166	-
5月末日	225,381,161	-	1.4084	-
6月末日	227,450,353	-	1.4168	-
7月末日	211,414,112	-	1.4311	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
2017年12月19日～ 2018年6月18日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	34.7
第2計算期間	12.7

第3計算期間	4.2
第4計算期間	10.4
第5計算期間	18.1
第6計算期間	33.6
第7計算期間	15.8
第8計算期間	4.5
第9計算期間	1.3
第10計算期間	8.1
2017年12月19日～ 2018年6月18日	0.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	8,866,423	5,677,066
第2計算期間	8,210,996	1,763,695
第3計算期間	15,967,619	676,450
第4計算期間	11,508,725	4,926,400
第5計算期間	25,323,485	4,786,754
第6計算期間	24,816,314	10,545,012
第7計算期間	30,371,983	7,076,122
第8計算期間	55,198,367	20,861,737
第9計算期間	51,030,255	23,832,682
第10計算期間	51,008,648	43,394,758
2017年12月19日～ 2018年6月18日	9,527,385	9,870,481

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(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 (2018年7月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	144,508,241,850	99.26
内 日本	144,508,241,850	99.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,073,364,392	0.74
純資産総額	145,581,606,242	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)	996,360,000	0.68
内 日本	996,360,000	0.68

(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 (2018年7月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	702,200	6,750.72 4,740,358,168	7,305.00 5,129,571,000	3.52
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	3,989,000	707.62 2,822,734,680	689.40 2,750,016,600	1.89
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	256,900	8,882.84 2,282,001,769	9,260.00 2,378,894,000	1.63
4	ソニー	日本	株式	電気機 器	387,100	4,352.24 1,684,752,881	5,828.00 2,256,018,800	1.55
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	406,200	5,131.25 2,084,317,743	5,168.00 2,099,241,600	1.44
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	430,800	4,296.53 1,850,949,394	4,445.00 1,914,906,000	1.32
7	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	518,500	3,306.76 1,714,557,369	3,355.00 1,739,567,500	1.19
8	キーエンス	日本	株式	電気機 器	28,400	60,364.13 1,714,341,349	58,910.00 1,673,044,000	1.15
9	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	499,500	2,977.38 1,487,205,502	3,113.00 1,554,943,500	1.07
10	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,733,100	195.68 1,513,270,384	194.60 1,504,861,260	1.03

11	任天堂	日本	株式	その他製品	35,600	40,999.60 1,459,586,100	36,760.00 1,308,656,000	0.90
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	427,300	2,497.27 1,067,086,983	3,055.00 1,305,401,500	0.90
13	三菱商事	日本	株式	卸売業	399,500	2,640.35 1,054,823,456	3,117.00 1,245,241,500	0.86
14	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	51,900	19,651.65 1,019,921,044	23,245.00 1,206,415,500	0.83
15	ファナック	日本	株式	電気機器	54,900	22,826.09 1,253,152,737	21,920.00 1,203,408,000	0.83
16	村田製作所	日本	株式	電気機器	60,600	17,176.23 1,040,879,800	19,500.00 1,181,700,000	0.81
17	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	406,500	2,594.49 1,054,663,559	2,873.00 1,167,874,500	0.80
18	花王	日本	株式	化学	142,000	6,912.43 981,565,624	8,137.00 1,155,454,000	0.79
19	東京海上HD	日本	株式	保険業	214,400	4,554.47 976,480,478	5,301.00 1,136,534,400	0.78
20	日本電産	日本	株式	電気機器	69,600	13,869.85 965,341,562	16,180.00 1,126,128,000	0.77
21	信越化学	日本	株式	化学	99,800	10,181.50 1,016,114,661	11,270.00 1,124,746,000	0.77
22	キヤノン	日本	株式	電気機器	308,800	3,837.96 1,185,164,642	3,617.00 1,116,929,600	0.77
23	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	238,200	4,421.79 1,053,272,305	4,555.00 1,085,001,000	0.75
24	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	103,900	10,206.95 1,060,502,539	10,440.00 1,084,716,000	0.75
25	日立	日本	株式	電気機器	1,385,000	793.61 1,099,160,776	778.60 1,078,361,000	0.74
26	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	334,500	3,690.16 1,234,359,462	3,176.00 1,062,372,000	0.73
27	ダイキン工業	日本	株式	機械	78,900	11,398.66 899,354,433	13,320.00 1,050,948,000	0.72
28	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	568,000	1,472.11 836,162,901	1,817.50 1,032,340,000	0.71
29	武田薬品	日本	株式	医薬品	212,900	6,144.73 1,308,214,400	4,675.00 995,307,500	0.68
30	パナソニック	日本	株式	電気機器	658,700	1,647.03 1,084,901,860	1,438.00 947,210,600	0.65

(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	99.26%
合計	99.26%

(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

業種	投資比率
水産・農林業	0.12%
鉱業	0.30%
建設業	3.15%
食料品	4.19%
繊維製品	0.65%
パルプ・紙	0.26%
化学	7.45%
医薬品	4.77%
石油・石炭製品	0.83%
ゴム製品	0.76%
ガラス・土石製品	1.01%
鉄鋼	1.04%
非鉄金属	0.84%
金属製品	0.65%
機械	5.14%
電気機器	13.51%
輸送用機器	8.61%
精密機器	1.74%
その他製品	2.03%
電気・ガス業	1.72%
陸運業	4.26%
海運業	0.18%
空運業	0.58%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	7.69%
卸売業	4.66%
小売業	4.78%
銀行業	6.88%

証券、商品先物取引業	0.90%
保険業	2.27%
その他金融業	1.20%
不動産業	2.39%
サービス業	4.52%
合計	99.26%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2018年9月	買建	57	999,710,780	996,360,000	0.68%

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2018年7月31日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		101,403,774,909	96.08
	内 香港	1,394,047,294	1.32
	内 シンガポール	474,450,111	0.45
	内 イスラエル	216,577,061	0.21
	内 ノルウェー	293,220,145	0.28
	内 スウェーデン	1,087,711,997	1.03
	内 デンマーク	711,282,204	0.67
	内 イギリス	7,157,822,038	6.78
	内 アイルランド	220,112,503	0.21

内 オランダ	1,499,802,924	1.42
内 ベルギー	442,952,353	0.42
内 フランス	4,411,843,129	4.18
内 ドイツ	3,995,147,118	3.79
内 スイス	3,340,841,465	3.17
内 ポルトガル	62,174,916	0.06
内 スペイン	1,263,379,124	1.20
内 イタリア	984,844,343	0.93
内 フィンランド	420,573,015	0.40
内 オーストリア	95,643,486	0.09
内 カナダ	3,936,173,558	3.73
内 アメリカ	66,769,498,254	63.26
内 オーストラリア	2,542,869,879	2.41
内 ニュージーランド	82,807,992	0.08
投資証券	2,583,412,882	2.45
内 香港	81,723,756	0.08
内 シンガポール	43,291,891	0.04
内 イギリス	86,306,079	0.08
内 フランス	152,168,039	0.14
内 カナダ	18,408,985	0.02
内 アメリカ	1,905,960,127	1.81
内 オーストラリア	295,554,005	0.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,555,653,531	1.47
純資産総額	105,542,841,322	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,633,741,108	1.55
内 アメリカ	1,633,741,108	1.55
為替予約取引(買建)	443,800,000	0.42
内 日本	443,800,000	0.42

(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（2018年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	125,000	18,840.83 2,355,118,224	21,081.90 2,635,238,638	2.50
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	181,000	9,338.60 1,690,296,840	11,697.12 2,117,179,390	2.01
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	10,180	131,959.91 1,343,352,136	197,511.21 2,010,664,140	1.91
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	59,050	19,479.70 1,150,281,235	18,989.37 1,121,322,334	1.06
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	84,520	11,556.58 976,768,820	12,958.19 1,095,226,836	1.04
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,767	114,063.66 885,932,719	135,403.33 1,051,677,722	1.00
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	7,370	115,664.31 852,446,545	136,546.74 1,006,349,477	0.95
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	66,500	15,434.38 1,026,387,581	14,672.19 975,700,748	0.92
9	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	104,655	9,111.47 953,563,750	9,073.95 949,635,012	0.90
10	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	241,301	3,156.34 761,644,295	3,475.72 838,695,460	0.79
11	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	115,572	6,295.93 727,640,207	6,492.97 750,406,095	0.71
12	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	78,500	9,481.49 744,304,975	9,112.39 715,323,086	0.68
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	31,600	21,181.81 669,348,249	22,100.98 698,390,996	0.66
14	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	23,976	24,811.51 594,881,984	28,178.77 675,614,391	0.64
15	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	44,550	12,290.02 547,525,509	15,150.64 674,961,226	0.64
16	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	47,218	13,047.11 616,063,260	14,190.40 670,042,699	0.63

17	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通 信サー ビス	180,291	3,925.53 707,755,021	3,552.32 640,451,325	0.61
18	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消 費財・ サービス	29,000	19,746.45 572,650,025	21,900.05 635,101,531	0.60
19	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケ ア	147,663	4,018.89 593,450,105	4,283.87 632,569,967	0.60
20	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技 術	115,500	4,921.73 568,462,117	5,294.06 611,464,727	0.58
21	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通 信サー ビス	102,454	5,539.17 567,514,991	5,826.91 596,990,739	0.57
22	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技 術	120,400	4,192.29 504,762,759	4,681.29 563,627,521	0.53
23	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	62,367	9,853.24 614,519,962	8,903.00 555,253,526	0.53
24	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・ サービス	13,790	30,422.29 419,524,141	38,971.17 537,412,443	0.51
25	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	504,700	1,080.14 545,161,573	1,057.41 533,678,875	0.51
26	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケ ア	56,150	9,359.02 525,513,056	9,332.62 524,026,703	0.50
27	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	101,100	5,039.96 509,548,433	5,131.99 518,844,422	0.49
28	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	64,473	8,327.85 536,922,219	8,024.91 517,390,209	0.49
29	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技 術	23,200	16,711.33 387,704,645	21,965.54 509,600,730	0.48
30	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケ ア	17,700	27,604.26 488,596,860	27,241.68 482,177,771	0.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.08%
投資証券	2.45%
合計	98.53%

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

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	7.07%
素材	4.74%
資本財・サービス	10.17%
一般消費財・サービス	11.65%
生活必需品	8.13%
ヘルスケア	12.73%
金融	17.23%
情報技術	18.53%
電気通信サービス	2.33%
公益事業	2.97%
不動産	0.54%
合計	96.08%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2018年9月	買建	105	1,609,258,408	1,633,741,108	1.55%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年8 月	買建	4,000,000	444,105,130	443,800,000	0.42%

(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。

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況（2018年7月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	210,473,631,250	97.56
内 日本	210,473,631,250	97.56
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,267,402,809	2.44
純資産総額	215,741,034,059	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(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	3,164,400,000	1.47
内 日本	3,164,400,000	1.47

(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) 不動産投信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（2018年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	24,072	579,265.78 13,944,085,889	622,000.00 14,972,784,000	6.94
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	24,858	550,297.04 13,679,283,978	585,000.00 14,541,930,000	6.74
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	73,680	144,956.04 10,680,361,573	158,400.00 11,670,912,000	5.41
4	日本リテールファンド	日本	投資証券	46,982	203,384.63 9,555,416,984	203,900.00 9,579,629,800	4.44
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	54,825	168,111.15 9,216,694,183	173,400.00 9,506,655,000	4.41
6	オリックス不動産投資	日本	投資証券	49,530	165,841.78 8,214,143,507	174,200.00 8,628,126,000	4.00
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	31,123	250,527.79 7,797,176,687	276,000.00 8,589,948,000	3.98

8	日本プロロジスリート	日本	投資証券	33,344	232,574.51 7,754,964,466	226,100.00 7,539,078,400	3.49
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	24,227	279,004.38 6,759,439,259	290,900.00 7,047,634,300	3.27
10	GLP投資法人	日本	投資証券	54,957	117,055.02 6,432,993,065	119,400.00 6,561,865,800	3.04
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	15,736	373,159.13 5,872,032,211	402,500.00 6,333,740,000	2.94
12	API投資法人	日本	投資証券	11,912	470,584.08 5,605,597,612	499,000.00 5,944,088,000	2.76
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	71,977	77,228.88 5,558,703,619	81,900.00 5,894,916,300	2.73
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	7,690	662,788.94 5,096,847,015	678,000.00 5,213,820,000	2.42
15	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	64,137	71,980.47 4,616,611,649	72,200.00 4,630,691,400	2.15
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	8,260	475,612.59 3,928,560,062	529,000.00 4,369,540,000	2.03
17	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	5,738	623,570.63 3,578,048,321	681,000.00 3,907,578,000	1.81
18	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	8,456	438,051.11 3,704,160,264	450,000.00 3,805,200,000	1.76
19	森ヒルズリート	日本	投資証券	27,260	135,233.79 3,686,473,213	138,100.00 3,764,606,000	1.74
20	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	73,114	49,196.57 3,596,958,480	49,350.00 3,608,175,900	1.67
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	16,600	218,540.10 3,627,765,761	216,000.00 3,585,600,000	1.66
22	産業ファンド	日本	投資証券	28,962	119,612.80 3,464,226,082	120,600.00 3,492,817,200	1.62
23	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	22,260	142,407.25 3,169,985,431	143,700.00 3,198,762,000	1.48
24	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	17,928	161,645.36 2,897,978,121	172,900.00 3,099,751,200	1.44
25	イオンリート投資	日本	投資証券	25,516	113,634.39 2,899,495,145	119,500.00 3,049,162,000	1.41
26	森トラスト総合リート	日本	投資証券	17,766	159,511.43 2,833,880,160	162,100.00 2,879,868,600	1.33
27	日本リート投資法人	日本	投資証券	8,025	322,744.66 2,590,025,926	346,500.00 2,780,662,500	1.29

28	プレミア投資法人	日本	投資証券	23,587	111,049.40 2,619,322,226	112,800.00 2,660,613,600	1.23
29	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	27,960	83,027.47 2,321,448,307	91,000.00 2,544,360,000	1.18
30	東急リアル・エステート	日本	投資証券	16,666	143,335.87 2,388,835,677	152,500.00 2,541,565,000	1.18

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.56%
合計	97.56%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2018年9月	買建	1,800	3,079,814,400	3,164,400,000	1.47%

(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) 不動産投信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。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2018年7月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	169,979,622	0.98

	内 アメリカ	169,979,622	0.98
投資証券		16,830,814,097	97.41
	内 ガーンジー	10,275,329	0.06
	内 マン島	8,860,030	0.05
	内 香港	379,301,823	2.20
	内 シンガポール	601,167,073	3.48
	内 イスラエル	4,001,835	0.02
	内 イギリス	946,682,806	5.48
	内 アイルランド	41,471,616	0.24
	内 オランダ	73,977,159	0.43
	内 ベルギー	137,400,300	0.80
	内 フランス	868,718,100	5.03
	内 ドイツ	46,480,950	0.27
	内 スペイン	141,835,727	0.82
	内 イタリア	18,222,169	0.11
	内 カナダ	306,529,569	1.77
	内 アメリカ	11,994,524,977	69.42
	内 オーストラリア	1,178,912,392	6.82
	内 ニューージーランド	72,452,242	0.42
	コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	278,385,894	1.61
	純資産総額	17,279,179,613	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(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	167,238,019	0.97
内 ドイツ	23,322,435	0.13
内 アメリカ	143,915,584	0.83
為替予約取引(買建)	102,669,600	0.59
内 日本	102,669,600	0.59

(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 (2018年7月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	41,547	17,630.16 732,484,355	19,078.17 792,641,086	4.59
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	71,446	7,259.94 518,698,874	7,215.65 515,529,330	2.98
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	20,100	23,062.99 463,568,102	23,811.64 478,614,065	2.77
4	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	フランス	投資証券	18,360	26,751.28 491,154,897	24,608.74 451,816,503	2.61
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	27,578	12,714.30 350,637,187	13,404.45 369,668,129	2.14
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	18,600	19,779.87 367,906,456	19,112.59 355,494,206	2.06
7	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	49,300	7,252.61 357,556,771	7,079.10 349,000,010	2.02
8	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	49,800	7,215.76 359,348,551	6,849.31 341,095,987	1.97
9	LINK REIT	香港	投資証券	296,000	990.73 293,258,804	1,099.38 325,417,960	1.88
10	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	47,579	6,847.65 325,805,306	6,152.17 292,714,296	1.69
11	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	20,700	13,791.32 285,480,865	13,550.99 280,505,507	1.62
12	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	730,380	343.96 251,259,320	349.39 255,189,294	1.48
13	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	38,117	6,071.91 231,443,860	6,146.62 234,290,856	1.36
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	8,867	27,094.32 240,246,061	25,954.13 230,135,342	1.33
15	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	99,100	2,192.89 217,317,596	2,296.79 227,612,573	1.32
16	GGP INC	アメリカ	投資証券	84,877	2,554.34 216,812,140	2,348.97 199,373,662	1.15
17	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	13,800	14,040.21 193,755,855	13,634.24 188,152,625	1.09
18	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	23,064	8,365.15 192,936,215	7,777.36 179,377,045	1.04

19	HCP INC	アメリカ	投資証券	62,700	2,903.02 182,024,842	2,828.53 177,349,132	1.03
20	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	219,880	711.60 156,474,745	798.25 175,521,211	1.02
21	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	16,900	9,483.69 160,275,461	10,380.54 175,431,212	1.02
22	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託受益証券	19,000	9,066.74 172,268,648	8,946.29 169,979,622	0.98
23	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	15,328	11,076.35 169,780,026	10,951.13 167,859,020	0.97
24	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	47,900	3,128.92 149,876,523	3,171.55 151,917,518	0.88
25	UDR INC	アメリカ	投資証券	35,600	4,281.21 152,412,401	4,112.92 146,419,970	0.85
26	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	37,400	4,326.17 161,802,929	3,875.35 144,938,430	0.84
27	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	101,931	1,364.24 139,071,360	1,357.39 138,360,499	0.80
28	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	19,820	7,366.40 146,002,461	6,960.32 137,953,681	0.80
29	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	137,330	818.04 112,361,108	970.58 133,290,682	0.77
30	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	11,900	11,262.18 134,020,264	11,159.83 132,802,040	0.77

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	0.98%
投資証券	97.41%
合計	98.39%

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

八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DJ US REIT IDXFTRS 2018年9月	買建	41	143,546,753	143,915,584	0.83%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFTR 2018年9月	買建	20	23,075,568	23,322,435	0.13%
為替予約取引	日本	シンガポール・ドル買/ 円売 2018年8月	買建	120,000	9,918,641	9,783,600	0.06%
		ユーロ買/円売 2018年8 月	買建	100,000	12,993,339	12,993,000	0.08%
		米ドル買/円売 2018年8 月	買建	720,000	80,130,575	79,893,000	0.46%

(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。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資状況（2018年7月31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	12,834,338,940	78.26
内 日本	12,834,338,940	78.26
地方債証券	1,140,268,300	6.95
内 日本	1,140,268,300	6.95
特殊債券	918,496,500	5.60
内 日本	918,496,500	5.60
社債券	1,345,129,700	8.20
内 日本	1,345,129,700	8.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	160,625,592	0.98
純資産総額	16,398,859,032	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（2018年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	125 5年国債	日本	国債証券	200,000,000	100.63 201,274,100	100.47 200,942,000	0.100000 2020/09/20	1.23
2	334 10年国債	日本	国債証券	181,000,000	104.39 188,962,970	103.92 188,109,680	0.600000 2024/06/20	1.15
3	350 10年国債	日本	国債証券	185,000,000	100.64 186,200,650	100.57 186,063,750	0.100000 2028/03/20	1.13
4	135 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.06 171,813,200	100.95 171,621,800	0.100000 2023/03/20	1.05
5	386 2年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.45 170,771,300	100.36 170,620,500	0.100000 2020/03/15	1.04
6	128 5年国債	日本	国債証券	167,000,000	100.79 168,324,660	100.62 168,038,740	0.100000 2021/06/20	1.02
7	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	104.38 167,017,600	103.73 165,980,800	0.800000 2022/09/20	1.01
8	126 5年国債	日本	国債証券	164,000,000	100.71 165,164,720	100.52 164,862,640	0.100000 2020/12/20	1.01
9	380 2年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.41 160,671,800	100.25 160,404,800	0.100000 2019/09/15	0.98
10	130 5年国債	日本	国債証券	157,000,000	100.90 158,421,380	100.71 158,119,410	0.100000 2021/12/20	0.96
11	343 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	100.98 153,494,160	100.94 153,439,440	0.100000 2026/06/20	0.94
12	345 10年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.85 151,287,000	100.88 151,320,000	0.100000 2026/12/20	0.92
13	348 10年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.67 151,007,000	100.72 151,093,500	0.100000 2027/09/20	0.92
14	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	104.95 146,939,800	104.09 145,733,000	1.100000 2021/12/20	0.89
15	322 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	104.42 146,189,400	103.66 145,131,000	0.900000 2022/03/20	0.89
16	335 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	103.92 145,496,400	103.44 144,828,600	0.500000 2024/09/20	0.88

17	133 5年国債	日本	国債証券	130,000,000	101.05 131,369,600	100.85 131,106,300	0.100000 2022/09/20	0.80
18	347 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.76 130,989,300	100.79 131,037,400	0.100000 2027/06/20	0.80
19	124 5年国債	日本	国債証券	120,000,000	100.50 120,611,500	100.41 120,498,000	0.100000 2020/06/20	0.73
20	11兵庫県公債20年	日本	地方債証券	100,000,000	118.05 118,053,000	117.81 117,818,500	1.840000 2030/08/16	0.72
21	80 三菱地所	日本	社債券	100,000,000	117.68 117,682,000	117.14 117,147,900	2.305000 2027/03/19	0.71
22	331 10年国債	日本	国債証券	110,000,000	103.92 114,312,290	103.53 113,887,400	0.600000 2023/09/20	0.69
23	32東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	113.27 113,278,800	111.86 111,860,700	2.260000 2024/03/19	0.68
24	129 5年国債	日本	国債証券	110,000,000	100.87 110,964,700	100.67 110,743,600	0.100000 2021/09/20	0.68
25	309 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	103.15 106,244,500	102.30 105,373,120	1.100000 2020/06/20	0.64
26	497 関西電力	日本	社債券	100,000,000	104.95 104,951,000	104.66 104,666,600	1.002000 2025/06/20	0.64
27	25 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	103.65 103,656,700	103.38 103,384,600	0.694000 2023/11/22	0.63
28	116 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	103.73 103,739,100	103.28 103,286,800	0.800000 2022/11/25	0.63
29	24 - 16 愛知県公債	日本	地方債証券	100,000,000	103.63 103,633,300	103.22 103,229,600	0.757000 2023/01/31	0.63
30	33 中日本高速道	日本	社債券	100,000,000	103.73 103,730,200	103.22 103,226,400	1.084000 2021/09/17	0.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	78.26%
地方債証券	6.95%
特殊債券	5.60%
社債券	8.20%
合計	99.02%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2018年7月31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	163,757,821,595	98.17
内 ユーロ	66,438,498,519	39.83
内 シンガポール	615,143,217	0.37
内 マレーシア	784,651,131	0.47
内 ノルウェー	373,224,049	0.22
内 スウェーデン	631,268,057	0.38
内 デンマーク	974,971,244	0.58
内 イギリス	11,415,203,883	6.84
内 スイス	214,612,191	0.13
内 ポーランド	1,048,236,341	0.63
内 カナダ	3,308,001,228	1.98
内 アメリカ	72,081,666,390	43.21
内 メキシコ	1,364,085,371	0.82
内 南アフリカ	986,030,748	0.59
内 オーストラリア	3,522,229,226	2.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,047,326,295	1.83
純資産総額	166,805,147,890	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)	1,108,045,570	0.66

	内 日本	1,108,045,570	0.66
為替予約取引(売建)		20,805,740	0.01
	内 日本	20,805,740	0.01

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

(注2) 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（2018年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,300,000	99.21 693,866,339	98.11 686,193,994	2.750000 2028/02/15	0.41
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,287,000	99.30 693,076,492	96.64 674,469,762	2.000000 2022/11/30	0.40
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,084,000	161.87 648,624,652	160.60 643,538,830	4.500000 2041/04/25	0.39
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,921,000	98.95 650,411,385	96.17 632,175,151	2.250000 2024/11/15	0.38
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,840,000	99.47 644,901,316	95.47 618,969,380	2.250000 2025/11/15	0.37
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,900,000	98.80 647,125,690	94.29 617,600,138	2.250000 2027/08/15	0.37
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,788,000	98.87 635,297,463	95.05 610,746,549	2.125000 2025/05/15	0.37
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,700,000	99.92 632,307,742	95.45 603,985,539	2.375000 2027/05/15	0.36
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,743,000	98.14 625,672,364	94.49 602,415,253	2.000000 2025/02/15	0.36
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,743,000	97.81 623,581,264	94.07 599,775,877	2.000000 2025/08/15	0.36
11	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,807,000	165.97 605,315,012	163.54 596,485,298	5.750000 2032/10/25	0.36
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,697,000	125.56 603,128,979	122.47 588,329,358	4.250000 2023/10/25	0.35

13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,229,000	103.05 598,198,883	99.33 576,611,155	2.750000 2024/02/15	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,500,000	97.55 595,611,832	94.13 574,727,632	2.250000 2027/11/15	0.34
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,500,000	97.03 592,476,466	92.94 567,480,344	2.000000 2026/11/15	0.34
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,340,000	97.83 579,951,490	94.63 560,972,250	2.250000 2027/02/15	0.34
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,600,000	93.28 579,886,933	89.60 557,009,992	1.500000 2026/08/15	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,162,000	100.73 577,239,686	97.06 556,197,892	2.375000 2024/08/15	0.33
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,025,000	144.56 568,185,871	141.23 555,111,502	6.000000 2025/10/25	0.33
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,021,000	103.16 575,016,751	99.43 554,243,153	2.750000 2023/11/15	0.33
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,000,000	100.02 555,205,414	99.62 552,946,360	2.625000 2021/06/15	0.33
22	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,499,000	120.81 549,268,917	119.54 543,495,178	2.750000 2027/10/25	0.33
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,366,000	94.68 564,031,199	91.08 542,574,818	1.625000 2026/02/15	0.33
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,630,000	114.53 540,204,348	112.23 529,342,342	3.000000 2022/04/25	0.32
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,550,000	114.21 526,813,788	111.68 515,153,350	3.250000 2021/10/25	0.31
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,623,000	152.28 518,990,194	149.28 508,762,595	5.500000 2029/04/25	0.31
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,146,000	126.42 516,790,902	124.24 507,859,501	3.500000 2026/04/25	0.30
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,029,000	94.47 527,430,494	90.80 506,930,846	1.625000 2026/05/15	0.30
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,624,000	149.31 509,069,066	148.52 506,375,669	4.000000 2038/10/25	0.30
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,509,000	102.19 511,511,011	99.78 499,487,941	2.625000 2020/11/15	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。

□ . 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	98.17%
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。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(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8月	買建	199,000	16,195,823	16,355,810	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2018年8月	買建	427,000	35,910,739	36,359,050	0.02%
		デンマーク・クローネ買/円売 2018年8月	買建	886,000	15,383,529	15,451,840	0.01%
		ユーロ買/円売 2018年9月	買建	685,000	88,912,566	89,008,900	0.05%
		ユーロ買/円売 2018年8月	買建	3,205,000	415,771,443	416,425,650	0.25%
		英ポンド買/円売 2018年8月	買建	374,000	54,706,775	54,480,580	0.03%
		英ポンド買/円売 2018年9月	買建	109,000	15,864,632	15,866,040	0.01%
		メキシコ・ペソ買/円売 2018年8月	買建	4,113,000	22,970,592	24,595,740	0.01%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2018年8月	買建	472,000	14,100,807	14,358,240	0.01%
		米ドル買/円売 2018年8月	買建	2,655,000	295,130,077	294,651,900	0.18%
		米ドル買/円売 2018年9月	買建	887,000	98,270,425	98,226,380	0.06%
		南アフリカ・ランド買/円売 2018年8月	買建	3,832,000	31,169,535	32,265,440	0.02%

	マレーシア・リングgit	売建	761,000	20,790,520	20,805,740	0.01%
	売/円買 2018年8月					

(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

●DCダイワ・ターゲットイヤー 2030

2018年7月31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	14,311円
純資産総額	2.1億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	1.0%
3か月間	1.0%
6か月間	-0.5%
1年間	5.1%
3年間	5.6%
5年間	41.9%
設定来	43.1%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において運用管理費用(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1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
	08年12月	09年12月	10年12月	11年12月	12年12月	13年12月	14年12月	15年12月	16年12月	17年12月
分配金	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	国・地域名	比率	
国内債券	272	27.5%	日本円	58.4%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	0.9%	
国内株式・先物	1,499	24.4%	米ドル	23.1%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%	
外国債券	766	21.3%	ユーロ	11.1%	修正デュレーション	ソフトバンクグループ	日本	0.4%	
外国株式・先物	1,251	13.7%	英ポンド	2.8%	残存年数	ソニー	日本	0.4%	
外国リート・先物	318	6.1%	豪ドル	1.3%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.4%	
国内リート・先物	60	5.9%	カナダ・ドル	1.1%	AAA	82.6%	日本ビルファンド	日本	0.4%
外国投資信託等	7	0.1%	スイス・フラン	0.5%	AA	8.0%	ジャパニアルエステイト	日本	0.4%
			シンガポール・ドル	0.4%	A	7.0%	野村不動産マスターF	日本	0.3%
			香港ドル	0.3%	BBB	0.3%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.3%
コール・ローン、その他		1.5%	その他	1.2%	BB以下・無格付	2.2%	日本リアルファンド	日本	0.3%
合計	4,173	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	4.1%	

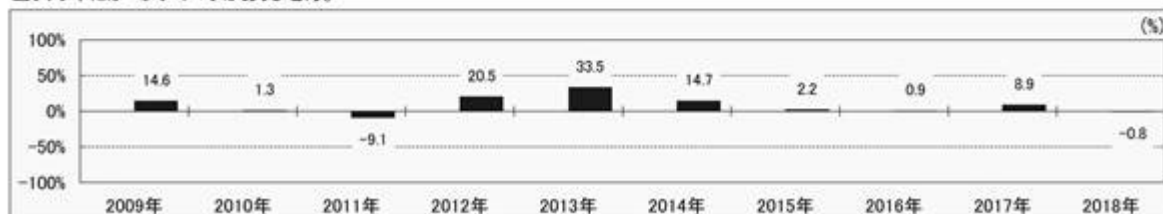
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.2%保有しております。

※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

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2018年は7月31日までの騰落率を表示しています。

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

2 【換金(解約)手続等】

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

<一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く。)
3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い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) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年12月19日から翌年12月18日までとします。ただし、第1計算期間は、2008年2月28日から2008年12月18日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、あるいは、第24計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同

じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、 の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本 の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1. の事項(前1. の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
3. 前2. の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

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れてい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。

公告

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

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

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

償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(平成28年12月20日から平成29年12月18日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2030

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 平成28年12月19日現在	第10期 平成29年12月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	747,266	1,602,902
親投資信託受益証券	202,053,989	229,438,806
未収入金	417,000	1,398,000
流動資産合計	203,218,255	232,439,708
資産合計	203,218,255	232,439,708
負債の部		
流動負債		
未払解約金	429,976	2,098,023
未払受託者報酬	29,686	37,928
未払委託者報酬	307,206	392,393
その他未払費用	7,408	9,396
流動負債合計	774,276	2,537,740
負債合計	774,276	2,537,740
純資産の部		
元本等		
元本	1 152,148,249	1 159,762,139
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	50,295,730	70,139,829
（分配準備積立金）	30,265,156	40,430,054
元本等合計	202,443,979	229,901,968
純資産合計	202,443,979	229,901,968
負債純資産合計	203,218,255	232,439,708

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期		第10期	
	自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19日		自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日	
営業収益				
受取利息		13		-
有価証券売買等損益		5,359,863		19,649,817
営業収益合計		5,359,876		19,649,817
営業費用				
支払利息		98		224
受託者報酬		64,142		73,129
委託者報酬		696,429		756,583
その他費用		13,894		18,110
営業費用合計		774,563		848,046
営業利益		4,585,313		18,801,771
経常利益		4,585,313		18,801,771
当期純利益		4,585,313		18,801,771
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（ ）		1,380,154		1,701,168
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		39,168,095		50,295,730
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,338,717		17,051,241
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,338,717		17,051,241
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,176,549		14,307,745
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,176,549		14,307,745
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		50,295,730		70,139,829

(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10期	
	自 平成28年12月20日	至 平成29年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 平成28年12月18日が休日のため、前計算期間末日を平成28年12月19日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第9期	第10期
	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
1. 1 期首元本額	124,950,676円	152,148,249円
期中追加設定元本額	51,030,255円	51,008,648円
期中一部解約元本額	23,832,682円	43,394,758円
2. 計算期間末日における受益権の総数	152,148,249口	159,762,139口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第9期	第10期
	自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19日	自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(5,965,550円)、投資信託約款に規定される収益調整金(48,616,064円)及び分配準備積立金(24,299,606円)より分配可能額は78,881,220円(1万口当たり5,184.50円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(17,100,739円)、投資信託約款に規定される収益調整金(59,499,024円)及び分配準備積立金(23,329,315円)より分配可能額は99,929,078円(1万口当たり6,254.87円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第10期 自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>

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得ます。
--------------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第10期 平成29年12月18日現在
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額
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9期 平成28年12月19日現在	第10期 平成29年12月18日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	6,671,950	17,516,784
合計	6,671,950	17,516,784

（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9期 平成28年12月19日現在	第10期 平成29年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第9期 平成28年12月19日現在	第10期 平成29年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3306円 (13,306円)	1.4390円 (14,390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	51,136,828	57,728,365	
	外国株式インデックスマザーファンド	14,136,612	34,374,585	
	外国債券インデックスマザーファンド	17,808,259	50,372,441	
	ダイワJ-REITマザーファンド	5,785,265	13,714,549	
	ダイワ・グローバルREITインデッ クス・マザーファンド	6,017,065	13,818,189	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	46,788,441	59,430,677	
親投資信託受益証券 合計			229,438,806	
合計			229,438,806	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「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12月19日現在	平成29年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,184,602,845	5,325,669,538
株式	3 4 129,800,710,660	143,644,364,120
派生商品評価勘定	741,360	20,448,280
未収入金	481,730,228	28,787,680
未収配当金	11,051,750	13,410,638
未収利息	185,379	203,658
その他未収収益	5 2,380,925	2,465,912
流動資産合計	134,481,403,147	149,035,349,826
資産合計	134,481,403,147	149,035,349,826
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	42,160	-
前受金	960,000	3,005,000
未払解約金	370,015,000	146,171,100
受入担保金	3,898,160,805	3,932,576,602
流動負債合計	4,269,177,965	4,081,752,702
負債合計	4,269,177,965	4,081,752,702
純資産の部		
元本等		
元本	1 138,207,285,313	128,399,557,544
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金() 2	7,995,060,131	16,554,039,580
元本等合計	130,212,225,182	144,953,597,124
純資産合計	130,212,225,182	144,953,597,124
負債純資産合計	134,481,403,147	149,035,349,826

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20日 至 平成29年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	140,729,416,146円	138,207,285,313円
期中追加設定元本額	15,146,910,652円	15,341,862,921円
期中一部解約元本額	17,669,041,485円	25,149,590,690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	5,497,265,486円	4,340,213,526円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	13,563,265,198円	10,950,187,562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	126,601,870円	62,130,624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)	2,316,749,433円	1,368,511,576円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	96,793,829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)	3,260,080,900円	1,923,003,980円
D-I's TOPIX イン デックス	22,437,751円	28,362,087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	24,808,577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	123,752,399円	276,190,632円
iFree 8資産バランス	117,889,334円	638,889,399円
DCダイワ日本株式インデッ クス	62,984,417,547円	60,774,772,193円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,349,453,806円	2,165,831,652円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,364,986,060円	2,314,028,426円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,111,458,667円	2,187,409,592円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,809,681,060円	4,029,488,955円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	22,874,733円	16,986,957円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー-2030	58,804,320円	51,136,828円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー-2040	12,636,946円	13,388,722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)	839,912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	330,217,542円	17,156,249円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	183,676,164円	15,921,448円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,412,992,315円	345,195,537円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	227,274,133円	169,150,600円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	14,178,232,373円	10,851,915,853円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	371,349,761円	220,121,595円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	639,321,646円	228,337,957円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,159,873,390円	885,899,660円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	162,562,702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)	285,231,730円	241,089,158円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	64,166,119円	73,865,612円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	1,792,053,724円	6,118,126,552円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	-円	4,248,902円

	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	- 円	1,205,509,199円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,031,097,025円	1,197,963,794円
	ダイワライフスタイル25	202,055,361円	175,105,430円
	ダイワライフスタイル50	673,841,558円	625,654,835円
	ダイワライフスタイル75	509,571,158円	504,751,457円
	DC・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	15,909,343,740円	14,050,989,284円
	計	138,207,285,313円	128,399,557,544円
2.	期末日における受益権の総数	138,207,285,313口	128,399,557,544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7,995,060,131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 3,737,943,250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 3,768,357,250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 714,400,000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 716,200,000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1,709,350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1,725,920円が含まれております。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日
----	--------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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12月19日現在	平成29年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	19,265,132,041	11,644,035,480
合計	19,265,132,041	11,644,035,480

（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12月19日まで、及び平成29年9月20日から平成29年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成28年12月19日 現在				平成29年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	308,890,000	-	309,600,000	710,000	1,214,735,000	-	1,235,220,000	20,485,000
合計	308,890,000	-	309,600,000	710,000	1,214,735,000	-	1,235,220,000	20,485,000

（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12月19日現在	平成29年12月18日現在
1口当たり純資産額	0.9422円	1.1289円
（1万口当たり純資産額）	(9,422円)	(11,289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	4,025.00	15,295,000	貸付株式数 1,000株
日本水産	70,100	619.00	43,391,900	
マルハニチロ	11,800	3,445.00	40,651,000	
カネコ種苗	5,400	1,725.00	9,315,000	
サカタのタネ	9,300	3,955.00	36,781,500	
ホクト	6,500	2,018.00	13,117,000	
ショーボンドHD	5,800	8,120.00	47,096,000	
ミライト・ホールディングス	18,900	1,641.00	31,014,900	貸付株式数 5,200株
タマホーム	10,300	758.00	7,807,400	
インベスターズクラウド	1,200	7,860.00	9,432,000	
日鉄鉱業	1,800	7,740.00	13,932,000	
三井松島	5,000	1,469.00	7,345,000	
国際石油開発帝石	298,500	1,324.50	395,363,250	
日本海洋掘削	3,500	2,123.00	7,430,500	貸付株式数 900株 (700株)
石油資源開発	8,600	2,783.00	23,933,800	貸付株式数 2,400株
K&Oエナジーグループ	4,000	1,835.00	7,340,000	
安藤・間	47,900	904.00	43,301,600	
東急建設	24,300	1,136.00	27,604,800	
コムシスホールディングス	21,400	3,320.00	71,048,000	
ミサワホーム	7,500	1,005.00	7,537,500	
高松コンストラクションGP	4,000	3,060.00	12,240,000	
東建コーポレーション	2,400	13,290.00	31,896,000	
ヤマウラ	8,400	875.00	7,350,000	
大成建設	63,100	6,030.00	380,493,000	
大林組	186,100	1,380.00	256,818,000	
清水建設	191,300	1,202.00	229,942,600	
飛鳥建設	74,800	161.00	12,042,800	
長谷工コーポレーション	72,100	1,790.00	129,059,000	

松井建設	8,800	971.00	8,544,800	貸付株式数	100株
鹿島建設	273,000	1,125.00	307,125,000		
不動テトラ	55,000	185.00	10,175,000		
鉄建建設	3,900	3,325.00	12,967,500		
西松建設	14,000	3,245.00	45,430,000		
三井住友建設	45,200	631.00	28,521,200		
大豊建設	24,000	573.00	13,752,000		
前田建設	44,000	1,593.00	70,092,000		
奥村組	9,600	4,665.00	44,784,000		
東鉄工業	7,300	3,745.00	27,338,500		
浅沼組	26,000	410.00	10,660,000		
戸田建設	72,000	892.00	64,224,000		
熊谷組	9,700	3,155.00	30,603,500		
北野建設	19,000	406.00	7,714,000		
三井ホーム	11,000	743.00	8,173,000		
矢作建設	10,200	1,001.00	10,210,200		
ピーエス三菱	10,900	962.00	10,485,800		
日本ハウスHLDGS	15,100	738.00	11,143,800	貸付株式数	3,100株
大東建託	22,500	23,435.00	527,287,500	貸付株式数	6,200株
新日本建設	8,500	1,003.00	8,525,500		
NIPPO	13,000	2,658.00	34,554,000		
東亜道路	1,700	4,355.00	7,403,500		
前田道路	18,000	2,649.00	47,682,000		
日本道路	1,700	6,580.00	11,186,000		
東亜建設	5,400	3,170.00	17,118,000		
若築建設	4,700	1,747.00	8,210,900		
東洋建設	19,900	677.00	13,472,300		
五洋建設	72,800	874.00	63,627,200		
世紀東急	12,600	618.00	7,786,800		
福田組	2,300	6,850.00	15,755,000		
住友林業	39,100	2,007.00	78,473,700		
日本基礎技術	19,000	422.00	8,018,000		
日成ビルド工業	10,000	1,443.00	14,430,000		
巴コーポレーション	21,900	692.00	15,154,800		
大和ハウス	183,600	4,357.00	799,945,200		
ライト工業	11,800	1,298.00	15,316,400		
積水ハウス	200,800	2,022.50	406,118,000		
日特建設	10,300	725.00	7,467,500		
ユアテック	9,900	952.00	9,424,800		
中電工	7,900	3,155.00	24,924,500		

関電工	23,900	1,141.00	27,269,900	貸付株式数	6,600株
きんでん	41,100	1,860.00	76,446,000		
東京エネシス	7,600	1,253.00	9,522,800		
トーエネック	1,900	3,315.00	6,298,500		
住友電設	5,000	2,406.00	12,030,000		
日本電設工業	9,400	2,397.00	22,531,800		
協和エクシオ	21,900	2,837.00	62,130,300		
日本工営	3,800	3,720.00	14,136,000		
九電工	12,300	5,380.00	66,174,000		
三機工業	13,100	1,350.00	17,685,000		
日揮	52,800	2,057.00	108,609,600	貸付株式数	14,700株
中外炉工業	3,700	2,455.00	9,083,500		
太平電業	4,200	2,701.00	11,344,200		
高砂熱学	17,000	2,080.00	35,360,000		
NECネッツエスアイ	5,700	2,841.00	16,193,700		
明星工業	12,600	801.00	10,092,600		
大気社	8,000	3,670.00	29,360,000		
ダイダン	4,500	2,985.00	13,432,500		
日比谷総合設備	7,200	2,310.00	16,632,000		
東芝プラントシステム	13,300	2,180.00	28,994,000		
日本製粉	17,800	1,765.00	31,417,000		
日清製粉G本社	68,000	2,314.00	157,352,000		
昭和産業	5,100	2,895.00	14,764,500		
中部飼料	7,200	2,448.00	17,625,600		
フィード・ワン	42,900	275.00	11,797,500	貸付株式数	11,500株
東洋精糖	8,600	1,202.00	10,337,200		
三井製糖	4,500	4,790.00	21,555,000		
塩水港精糖	32,100	264.00	8,474,400		
日新製糖	3,800	2,298.00	8,732,400		
Lifull	19,200	1,083.00	20,793,600		
ジェイエシーリクルートメント	4,800	2,202.00	10,569,600	貸付株式数	1,300株
日本M&Aセンター	18,500	5,550.00	102,675,000		
タケエイ	7,000	1,301.00	9,107,000	貸付株式数	1,900株
トラスト・テック	2,800	3,470.00	9,716,000		
コシダカホールディングス	3,000	5,250.00	15,750,000		
パソナグループ	5,100	1,933.00	9,858,300	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
CDS	6,300	1,390.00	8,757,000		

リンクアンドモチベーション	11,100	907.00	10,067,700	貸付株式数 (2,800株)	2,900株
G C A	7,200	1,075.00	7,740,000	貸付株式数	2,100株
エス・エム・エス	10,600	3,810.00	40,386,000	貸付株式数	2,900株
パーソルホールディングス	49,100	2,771.00	136,056,100		
リニカル	4,200	1,569.00	6,589,800	貸付株式数	1,100株
クックパッド	17,400	631.00	10,979,400	貸付株式数	5,000株
森永製菓	13,100	5,790.00	75,849,000		
江崎グリコ	15,500	5,710.00	88,505,000		
不二家	4,300	2,685.00	11,545,500		
山崎製パン	45,100	2,213.00	99,806,300		
モロゾフ	1,500	7,610.00	11,415,000		
亀田製菓	3,600	5,010.00	18,036,000	貸付株式数	1,000株
寿スピリッツ	5,600	6,290.00	35,224,000	貸付株式数	1,400株
カルビー	25,300	3,715.00	93,989,500	貸付株式数 (600株)	7,200株
森永乳業	11,200	4,735.00	53,032,000		
六甲バター	3,400	2,886.00	9,812,400		
ヤクルト	33,300	8,550.00	284,715,000	貸付株式数 (9,300株)	9,300株
明治ホールディングス	36,800	10,050.00	369,840,000		
雪印メグミルク	13,500	3,250.00	43,875,000		
プリマハム	39,000	809.00	31,551,000		
日本ハム	48,000	2,792.00	134,016,000		
丸大食品	32,000	498.00	15,936,000		
S Foods	4,000	5,060.00	20,240,000	貸付株式数 (1,200株)	1,200株
伊藤ハム米久HLDGS	35,800	1,061.00	37,983,800		
スタジオアリス	3,200	2,741.00	8,771,200		
シミックホールディングス	4,800	1,747.00	8,385,600		
システナ	4,700	3,640.00	17,108,000	貸付株式数	1,300株
デジタルアーツ	2,900	4,750.00	13,775,000	貸付株式数	500株
新日鉄住金SOL	8,700	2,950.00	25,665,000		
総合警備保障	21,100	6,110.00	128,921,000		
キューブシステム	8,100	812.00	6,577,200		
いちご	77,900	431.00	33,574,900	貸付株式数	21,700株
日本駐車場開発	76,300	192.00	14,649,600		
コア	3,400	1,550.00	5,270,000		
カカクコム	41,300	1,842.00	76,074,600	貸付株式数	11,400株
ディップ	7,800	2,915.00	22,737,000		

オプトホールディング	5,800	1,343.00	7,789,400	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ツクイ	14,300	1,045.00	14,943,500	貸付株式数 3,900株
エムスリー	56,000	4,000.00	224,000,000	
アウトソーシング	16,200	2,078.00	33,663,600	貸付株式数 4,400株
ウェルネット	5,700	1,207.00	6,879,900	貸付株式数 1,600株
ワールドホールディングス	2,000	3,425.00	6,850,000	貸付株式数 500株
ディー・エヌ・エー	28,700	2,325.00	66,727,500	
博報堂D Y H L D G S	73,400	1,478.00	108,485,200	
ぐるなび	8,800	1,344.00	11,827,200	貸付株式数 2,400株
ファンコミュニケーションズ	15,100	963.00	14,541,300	貸付株式数 1,200株
W D Bホールディングス	3,000	3,660.00	10,980,000	
ティア	10,300	1,024.00	10,547,200	
バリューコマース	7,600	755.00	5,738,000	
インフォマート	28,200	672.00	18,950,400	貸付株式数 7,900株
サッポロホールディングス	20,500	3,590.00	73,595,000	
アサヒグループホールディング	116,700	5,810.00	678,027,000	
麒麟HD	268,000	2,908.00	779,344,000	
宝ホールディングス	45,500	1,316.00	59,878,000	
オエノンホールディングス	31,100	376.00	11,693,600	
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	5,190.00	221,094,000	
ダイドーグループHD	2,900	5,900.00	17,110,000	
伊藤園	18,400	4,520.00	83,168,000	
キーコーヒー	7,000	2,137.00	14,959,000	
日清オイリオグループ	6,600	3,470.00	22,902,000	
不二製油グループ	15,100	3,285.00	49,603,500	
J - オイルミルズ	3,200	3,960.00	12,672,000	
ローソン	13,700	7,920.00	108,504,000	貸付株式数 4,800株
サンエー	4,200	5,430.00	22,806,000	
カワチ薬品	4,500	2,779.00	12,505,500	
エービーシー・マート	9,800	6,390.00	62,622,000	貸付株式数 2,700株
ハードオフコーポレーション	6,500	1,219.00	7,923,500	
アスクル	5,800	3,125.00	18,125,000	貸付株式数 1,600株
ゲオホールディングス	10,400	2,173.00	22,599,200	貸付株式数 400株
アダストリア	8,400	2,499.00	20,991,600	
くらコーポレーション	3,300	6,300.00	20,790,000	

エレマテック	2,900	2,667.00	7,734,300	
パルグループHLDGS	3,000	3,510.00	10,530,000	
JALUX	2,600	2,821.00	7,334,600	
エディオン	20,700	1,297.00	26,847,900	貸付株式数 8,800株
あらた	2,800	6,160.00	17,248,000	
サーラコーポレーション	11,000	697.00	7,667,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
ワッツ	5,800	1,199.00	6,954,200	
ハローズ	2,500	2,616.00	6,540,000	
J Pホールディングス	19,800	340.00	6,732,000	貸付株式数 6,100株 (2,000株)
あみやき亭	2,200	5,250.00	11,550,000	
東京エレクトロンデバイス	4,100	2,015.00	8,261,500	
ひらまつ	14,800	564.00	8,347,200	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
フィールズ	5,500	1,246.00	6,853,000	貸付株式数 1,500株
双日	315,300	327.00	103,103,100	
ゲンキー	2,500	4,057.00	10,142,500	
アルフレッサホールディングス	59,800	2,609.00	156,018,200	
大黒天物産	1,600	5,110.00	8,176,000	
ハニーズホールディングス	6,800	1,154.00	7,847,200	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
キッコーマン	43,700	4,575.00	199,927,500	
味の素	127,600	2,116.00	270,001,600	
キューピー	31,500	3,020.00	95,130,000	
ハウス食品G本社	21,400	3,830.00	81,962,000	
カゴメ	22,500	4,320.00	97,200,000	
アリアケジャパン	5,200	9,910.00	51,532,000	
ニチレイ	26,500	3,185.00	84,402,500	
横浜冷凍	14,000	1,144.00	16,016,000	貸付株式数 4,000株 (3,900株)
東洋水産	30,300	4,880.00	147,864,000	
日清食品HD	24,300	8,260.00	200,718,000	
永谷園ホールディングス	8,000	1,381.00	11,048,000	
フジッコ	6,200	2,517.00	15,605,400	
ロックフィールド	6,800	2,044.00	13,899,200	
日本たばこ産業	343,800	3,714.00	1,276,873,200	
ケンコーマヨネーズ	4,200	3,655.00	15,351,000	貸付株式数 100株
わらべや日洋HD	3,900	3,185.00	12,421,500	貸付株式数 1,100株

ユーグレナ	22,000	1,035.00	22,770,000	貸付株式数 6,200株 (6,100株)
片倉工業	7,900	1,444.00	11,407,600	
グ ン ゼ	4,400	5,900.00	25,960,000	
ヒューリック	114,300	1,307.00	149,390,100	
アルペン	4,500	2,341.00	10,534,500	
クオール	5,900	2,147.00	12,667,300	
アルコニックス	6,500	2,216.00	14,404,000	貸付株式数 1,900株
神戸物産	3,600	4,615.00	16,614,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
ジンス	3,700	5,970.00	22,089,000	貸付株式数 1,000株
ビックカメラ	31,600	1,639.00	51,792,400	貸付株式数 8,900株 (8,900株)
D C Mホールディングス	27,900	1,086.00	30,299,400	貸付株式数 9,100株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	3,000	5,890.00	17,670,000	貸付株式数 800株 (800株)
MonotaRO	19,600	3,430.00	67,228,000	貸付株式数 5,600株
あいホールディングス	7,900	2,722.00	21,503,800	貸付株式数 2,200株
ディービーエックス	4,700	1,370.00	6,439,000	
アークランドサービスHD	5,000	2,632.00	13,160,000	貸付株式数 1,200株
J. フロント リテイリング	65,200	1,988.00	129,617,600	
ドトール・日レスHD	9,900	2,780.00	27,522,000	
マツモトキヨシHLDGS	11,400	9,250.00	105,450,000	
ブロンコビリー	3,500	3,625.00	12,687,500	貸付株式数 900株 (900株)
スタートトゥデイ	53,800	3,610.00	194,218,000	
物語コーポレーション	1,700	11,160.00	18,972,000	貸付株式数 500株
ココカラファイン	5,700	7,510.00	42,807,000	
三越伊勢丹HD	102,200	1,366.00	139,605,200	
東洋紡	21,200	2,068.00	43,841,600	
ユニチカ	17,800	828.00	14,738,400	
富士紡ホールディングス	3,500	3,710.00	12,985,000	
日清紡ホールディングス	33,700	1,539.00	51,864,300	
倉敷紡績	59,000	360.00	21,240,000	
ダイワボウHD	4,700	4,770.00	22,419,000	
シキボウ	5,700	1,431.00	8,156,700	
日東紡績	8,400	3,250.00	27,300,000	
トヨタ紡織	16,000	2,269.00	36,304,000	

マクニカ・富士エレHLDGS	10,300	2,487.00	25,616,100	
ウエルシアHD	14,600	5,050.00	73,730,000	
クリエイトSDH	8,000	3,015.00	24,120,000	
バイタルKSKHD	10,300	1,025.00	10,557,500	
UKCホールディングス	4,400	2,166.00	9,530,400	貸付株式数 900株
TOKAIホールディングス	29,200	885.00	25,842,000	
三洋貿易	3,800	2,683.00	10,195,400	
ウイン・パートナーズ	5,200	1,372.00	7,134,400	
ジョイフル本田	8,900	3,450.00	30,705,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
鳥貴族	2,400	3,720.00	8,928,000	貸付株式数 700株
ホットランド	4,400	1,510.00	6,644,000	貸付株式数 1,200株
すかいらーく	33,100	1,639.00	54,250,900	貸付株式数 9,200株 (2,800株)
綿半ホールディングス	3,200	3,075.00	9,840,000	
日本毛織	15,900	1,077.00	17,124,300	
ユナイテッド・スーパーマケ	18,100	1,154.00	20,887,400	貸付株式数 5,000株
三栄建築設計	2,700	2,555.00	6,898,500	貸付株式数 700株
野村不動産HLDGS	36,300	2,574.00	93,436,200	
三重交通グループHD	14,600	475.00	6,935,000	
サムティ	5,200	1,698.00	8,829,600	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本商業開発	4,300	1,709.00	7,348,700	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
プレサンスコーポレーション	7,600	1,510.00	11,476,000	
ユニゾホールディングス	6,400	3,035.00	19,424,000	
日本管理センター	4,800	1,560.00	7,488,000	貸付株式数 1,300株 (700株)
フージャースHD	8,100	1,297.00	10,505,700	
オープンハウス	9,100	5,860.00	53,326,000	
東急不動産HD	130,600	809.00	105,655,400	
飯田GHHD	45,100	2,104.00	94,890,400	
帝国繊維	6,600	2,211.00	14,592,600	貸付株式数 1,600株
日本コークス工業	60,600	126.00	7,635,600	
あさひ	5,200	1,377.00	7,160,400	貸付株式数 1,300株
日本調剤	2,000	3,525.00	7,050,000	貸付株式数 500株 (100株)

コスモス薬品	2,800	23,910.00	66,948,000	
シップヘルスケアHD	11,000	3,675.00	40,425,000	
ソフトクリエイトHD	5,500	1,544.00	8,492,000	
セブン&アイ・HLDGS	228,900	4,727.00	1,082,010,300	
薬王堂	2,700	3,355.00	9,058,500	貸付株式数 800株
クリエイト・レストランツ・ホール	15,500	1,313.00	20,351,500	貸付株式数 1,300株
ツルハホールディングス	11,100	16,310.00	181,041,000	
サンマルクホールディングス	4,100	3,020.00	12,382,000	
トリドールホールディングス	6,800	4,045.00	27,506,000	
帝人	46,500	2,479.00	115,273,500	
東レ	420,900	1,077.50	453,519,750	
クラレ	96,600	2,167.00	209,332,200	
旭化成	361,700	1,473.00	532,784,100	
サカイオーベックス	3,100	2,747.00	8,515,700	
TOKYO BASE	1,200	4,730.00	5,676,000	
宮地エンジニアリングG	2,200	2,592.00	5,702,400	
トーカロ	3,900	4,790.00	18,681,000	
アルファCO	2,600	2,341.00	6,086,600	
SUMCO	50,700	2,968.00	150,477,600	
川田テクノロジーズ	1,200	6,110.00	7,332,000	貸付株式数 300株 (300株)
住江織物	2,100	3,100.00	6,510,000	
アツギ	8,300	1,321.00	10,964,300	
コメダホールディングス	10,400	2,002.00	20,820,800	貸付株式数 100株
ダイユー・リックHLDGS	9,100	1,194.00	10,865,400	
クスリのアオキHLDGS	4,400	6,370.00	28,028,000	貸付株式数 1,200株
ダイニック	7,100	1,140.00	8,094,000	貸付株式数 1,900株
共和レザー	7,300	1,024.00	7,475,200	
スシローグローバルHLDGS	5,100	4,275.00	21,802,500	
LIXILビバ	5,300	1,902.00	10,080,600	
セーレン	13,400	2,120.00	28,408,000	
ソトー	9,600	1,130.00	10,848,000	
東海染工	5,500	1,446.00	7,953,000	
小松精練	11,300	936.00	10,576,800	
ワコールホールディングス	15,700	3,570.00	56,049,000	

ホギメディカル	3,600	8,540.00	30,744,000	貸付株式数	1,000株
T S Iホールディングス	22,300	841.00	18,754,300		
T I S	18,100	4,030.00	72,943,000		
電算システム	4,500	2,174.00	9,783,000	貸付株式数	1,200株
グリー	34,500	730.00	25,185,000		
コーエーテクモHD	9,200	2,325.00	21,390,000		
三菱総合研究所	2,900	3,710.00	10,759,000		
K L a b	10,800	1,871.00	20,206,800	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
ポルトゥウィン・ピット クル	5,000	2,100.00	10,500,000	貸付株式数	1,300株
ネクソン	61,200	3,265.00	199,818,000		
アイスタイル	13,600	896.00	12,185,600	貸付株式数	3,800株
エイチーム	4,100	2,997.00	12,287,700	貸付株式数	1,100株
テクノスジャパン	6,700	959.00	6,425,300	貸付株式数	1,700株
コロブラ	17,600	1,259.00	22,158,400	貸付株式数	4,800株 (4,500株)
ブロードリーフ	14,500	1,138.00	16,501,000		
ハーツユナイテッドグルー プ	3,800	1,771.00	6,729,800	貸付株式数	1,000株
メディアドゥHLDGS	2,400	2,397.00	5,752,800	貸付株式数	600株
特種東海製紙	3,400	4,075.00	13,855,000		
ティーガイア	5,500	2,655.00	14,602,500		
豆蔵ホールディングス	6,500	1,333.00	8,664,500		
ガンホー・オンライン・エ ンター	147,900	316.00	46,736,400	貸付株式数	41,400株
GMOペイメントゲート ウェイ	4,000	8,970.00	35,880,000	貸付株式数	1,300株
インターネットイニシア ティブ	9,600	2,028.00	19,468,800		
さくらインターネット	7,400	851.00	6,297,400		
S R Aホールディングス	3,400	3,630.00	12,342,000		
システムインテグレータ	7,500	942.00	7,065,000		
朝日ネット	17,200	519.00	8,926,800		
コムチュア	4,100	2,887.00	11,836,700	貸付株式数	900株
王子ホールディングス	239,000	754.00	180,206,000		
日本製紙	24,400	2,130.00	51,972,000		
三菱製紙	13,100	727.00	9,523,700	貸付株式数	3,100株
北越紀州製紙	31,300	631.00	19,750,300		
中越パルプ	3,400	2,047.00	6,959,800		

大王製紙	22,900	1,435.00	32,861,500	貸付株式数 6,700株 (6,500株)
g u m i	7,100	1,087.00	7,717,700	貸付株式数 1,900株
アカツキ	1,100	7,120.00	7,832,000	貸付株式数 300株
L I N E	15,600	4,725.00	73,710,000	貸付株式数 4,300株
レンゴー	53,200	816.00	43,411,200	
トーモク	4,200	2,146.00	9,013,200	
ザ・パック	4,400	3,775.00	16,610,000	
A O I T Y O H O L D I N G S	6,000	1,259.00	7,554,000	
マクロミル	7,400	2,561.00	18,951,400	貸付株式数 2,000株
昭和電工	38,600	4,485.00	173,121,000	
住友化学	425,000	796.00	338,300,000	
住友精化	2,400	6,250.00	15,000,000	
日産化学	33,600	4,540.00	152,544,000	
ラサ工業	4,000	2,143.00	8,572,000	貸付株式数 1,100株
クレハ	4,700	7,560.00	35,532,000	
テイカ	4,900	3,100.00	15,190,000	
石原産業	10,700	2,052.00	21,956,400	
日本曹達	39,000	743.00	28,977,000	
東ソー	83,600	2,526.00	211,173,600	
トクヤマ	16,800	3,475.00	58,380,000	
セントラル硝子	11,600	2,401.00	27,851,600	
東亜合成	33,000	1,425.00	47,025,000	
大阪ソーダ	5,300	2,896.00	15,348,800	貸付株式数 1,400株
関東電化	14,000	1,345.00	18,830,000	貸付株式数 200株
デンカ	21,000	4,350.00	91,350,000	
イビデン	33,600	1,726.00	57,993,600	貸付株式数 10,800株
信越化学	96,600	11,800.00	1,139,880,000	
日本カ - バイド	3,000	2,168.00	6,504,000	
堺 化 学	4,000	2,800.00	11,200,000	
エア・ウォーター	47,500	2,387.00	113,382,500	
大陽日酸	44,900	1,581.00	70,986,900	
日本化学工業	3,400	2,494.00	8,479,600	
日本パ - カライジング	28,900	1,839.00	53,147,100	
高圧ガス	11,100	953.00	10,578,300	
四国化成	8,900	1,799.00	16,011,100	
戸田工業	1,500	4,410.00	6,615,000	貸付株式数 400株
ステラ ケミファ	3,100	3,625.00	11,237,500	貸付株式数 800株
保土谷化学	1,900	6,380.00	12,122,000	貸付株式数 500株

日本触媒	9,000	8,060.00	72,540,000	
大日精化	4,400	5,440.00	23,936,000	
カネカ	76,000	987.00	75,012,000	
協和発酵キリン	69,200	2,189.00	151,478,800	
三菱瓦斯化学	49,500	3,210.00	158,895,000	
三井化学	52,300	3,560.00	186,188,000	
J S R	57,500	2,262.00	130,065,000	
東京応化工業	10,000	4,890.00	48,900,000	
大阪有機化学	4,900	1,292.00	6,330,800	貸付株式数 1,300株
三菱ケミカルH L D G S	388,200	1,235.00	479,427,000	
K H ネオケム	8,900	2,768.00	24,635,200	
ダイセル	76,900	1,320.00	101,508,000	
住友ベークライト	46,000	961.00	44,206,000	
積水化学	119,800	2,256.00	270,268,800	
日本ゼオン	48,500	1,621.00	78,618,500	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
アイカ工業	15,800	4,130.00	65,254,000	
宇部興産	28,800	3,280.00	94,464,000	
積水樹脂	9,000	2,269.00	20,421,000	
タキロンシーアイ	14,000	793.00	11,102,000	
旭有機材	5,600	2,030.00	11,368,000	
日立化成	28,100	2,896.00	81,377,600	
ニチバン	3,400	3,085.00	10,489,000	
リケンテクノス	14,300	624.00	8,923,200	
大倉工業	15,000	687.00	10,305,000	
積水化成品	8,100	1,452.00	11,761,200	
群栄化学	2,100	3,785.00	7,948,500	
ダイキョーニシカワ	11,600	1,819.00	21,100,400	
竹本容器	3,500	2,174.00	7,609,000	
日本化薬	36,900	1,717.00	63,357,300	
カーリットホールディングス	15,200	1,090.00	16,568,000	貸付株式数 4,000株
E P S ホールディングス	8,400	2,486.00	20,882,400	
プレステージ・インター	12,200	1,405.00	17,141,000	貸付株式数 3,200株
アミューズ	3,900	3,185.00	12,421,500	貸付株式数 100株
野村総合研究所	36,500	5,280.00	192,720,000	
ドリームインキュベータ	2,600	2,245.00	5,837,000	貸付株式数 200株
クイック	4,300	1,811.00	7,787,300	
T A C	23,500	342.00	8,037,000	貸付株式数 6,300株 (6,300株)

ケネディクス	74,300	738.00	54,833,400	貸付株式数	2,600株
電通	64,500	4,830.00	311,535,000	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	1,435.00	10,762,500		
びあ	2,000	7,340.00	14,680,000	貸付株式数	500株
イオンファンタジー	1,900	5,090.00	9,671,000	貸付株式数	500株
ネクシーズグループ	2,500	1,858.00	4,645,000		
日本精化	9,200	1,129.00	10,386,800		
扶桑化学工業	4,200	3,235.00	13,587,000	貸付株式数	1,200株
A D E K A	23,800	2,010.00	47,838,000		
日油	22,000	3,060.00	67,320,000		
ハリマ化成グループ	6,600	911.00	6,012,600		
花 王	136,400	7,753.00	1,057,509,200		
第一工業製薬	14,000	839.00	11,746,000	貸付株式数	3,000株
三洋化成	3,500	6,010.00	21,035,000		
武田薬品	203,400	6,285.00	1,278,369,000		
アステラス製薬	567,400	1,448.00	821,595,200		
大日本住友製薬	40,800	1,667.00	68,013,600	貸付株式数	11,700株
塩野義製薬	79,000	6,309.00	498,411,000		
田辺三菱製薬	67,100	2,409.00	161,643,900		
あすか製薬	6,700	2,086.00	13,976,200		
日本新薬	14,500	8,380.00	121,510,000		
中外製薬	58,000	5,910.00	342,780,000		
科研製薬	9,800	5,900.00	57,820,000		
エーザイ	66,200	7,033.00	465,584,600		
理研ビタミン	2,300	4,540.00	10,442,000		
ロート製薬	30,500	3,120.00	95,160,000		
小野薬品	141,700	2,675.00	379,047,500		
久光製薬	16,300	6,590.00	107,417,000	貸付株式数	4,500株
持田製薬	3,800	8,390.00	31,882,000		
参天製薬	104,700	1,937.00	202,803,900		
扶桑薬品	3,700	2,880.00	10,656,000		
日本ケミファ	1,600	4,955.00	7,928,000		
ツムラ	19,800	3,790.00	75,042,000		
日医工	14,300	1,698.00	24,281,400	貸付株式数	3,900株
テ ル モ	85,000	5,340.00	453,900,000		
みらかホールディングス	15,300	4,885.00	74,740,500		
キッセイ薬品工業	10,100	3,235.00	32,673,500		
生化学工業	11,000	1,656.00	18,216,000		

栄研化学	4,500	5,300.00	23,850,000	
鳥居薬品	3,700	2,994.00	11,077,800	
J C R ファーマ	4,100	4,965.00	20,356,500	
東和薬品	2,700	6,290.00	16,983,000	貸付株式数 700株
富士製薬工業	2,100	4,285.00	8,998,500	
沢井製薬	9,600	5,020.00	48,192,000	貸付株式数 2,600株
ゼリア新薬工業	12,100	2,218.00	26,837,800	
第一三共	157,400	2,921.50	459,844,100	
キョーリン製薬HD	14,700	2,145.00	31,531,500	
大幸薬品	4,000	2,338.00	9,352,000	貸付株式数 1,100株
ダイト	3,900	3,440.00	13,416,000	
大塚ホールディングス	115,000	5,047.00	580,405,000	
大正製薬HD	12,300	8,970.00	110,331,000	貸付株式数 3,300株
ペプチドリーム	22,800	3,865.00	88,122,000	貸付株式数 6,300株
大日本塗料	7,200	1,863.00	13,413,600	
日本ペイントHOLD	44,800	3,705.00	165,984,000	貸付株式数 12,500株
関西ペイント	61,000	2,956.00	180,316,000	
中国塗料	17,400	955.00	16,617,000	
日本特殊塗料	4,200	2,127.00	8,933,400	
藤倉化成	12,400	712.00	8,828,800	
太陽ホールディングス	4,400	5,050.00	22,220,000	
D I C	22,600	4,295.00	97,067,000	
サカタインクス	12,000	1,802.00	21,624,000	
東洋インキSCホールディングン	53,000	663.00	35,139,000	
T & K TOKA	5,500	1,481.00	8,145,500	
アルプス技研	2,800	4,360.00	12,208,000	
オリエンタルランド	62,900	10,645.00	669,570,500	
ダスキン	14,200	2,973.00	42,216,600	
パーク24	29,900	2,856.00	85,394,400	貸付株式数 600株
明光ネットワークジャパン	7,800	1,327.00	10,350,600	
ファルコホールディングス	7,100	1,773.00	12,588,300	
クレスコ	1,700	4,570.00	7,769,000	
フジ・メディア・HD	56,000	1,739.00	97,384,000	貸付株式数 16,100株
ラウンドワン	16,600	1,756.00	29,149,600	
リゾートトラスト	22,600	2,560.00	57,856,000	
オービック	17,400	8,180.00	142,332,000	
ジャストシステム	9,300	2,267.00	21,083,100	
ヤフー	395,700	512.00	202,598,400	貸付株式数 114,100株
ビー・エム・エル	7,200	2,843.00	20,469,600	

トレンドマイクロ	26,600	6,570.00	174,762,000	
りらいあコミュニケーション	8,900	1,268.00	11,285,200	
リソー教育	10,400	865.00	8,996,000	
日本オラクル	9,000	10,270.00	92,430,000	
フューチャー	9,700	1,265.00	12,270,500	
CAC HOLDINGS	7,600	1,079.00	8,200,400	
ユー・エス・エス	65,000	2,413.00	156,845,000	
オービックビジネスC	3,000	6,220.00	18,660,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	12,500	4,910.00	61,375,000	
アイティフォー	14,000	805.00	11,270,000	
サイバーエージェント	35,100	4,315.00	151,456,500	
楽天	272,800	1,026.00	279,892,800	
テー・オー・ダブリュー	9,600	920.00	8,832,000	
大塚商会	16,500	8,790.00	145,035,000	
総合メディカル	2,600	6,240.00	16,224,000	貸付株式数 700株
サイボウズ	15,400	504.00	7,761,600	
セントラルスポーツ	2,400	4,300.00	10,320,000	貸付株式数 700株
パラカ	3,000	2,504.00	7,512,000	貸付株式数 800株
電通国際情報S	3,800	2,568.00	9,758,400	
デジタルガレージ	10,200	3,015.00	30,753,000	貸付株式数 2,800株
イーエムシステムズ	3,100	2,520.00	7,812,000	
ウェザーニューズ	2,500	3,415.00	8,537,500	貸付株式数 700株 (700株)
C I J	13,800	708.00	9,770,400	
WOWOW	3,000	3,300.00	9,900,000	貸付株式数 800株
フルキャストホールディングス	5,200	2,195.00	11,414,000	
富士フイルムHLDGS	115,000	4,677.00	537,855,000	
コニカミノルタ	127,600	1,067.00	136,149,200	
資生堂	103,500	5,474.00	566,559,000	
ライオン	77,000	2,090.00	160,930,000	
高砂香料	3,500	3,485.00	12,197,500	
マンダム	10,600	3,680.00	39,008,000	
ミルボン	3,800	7,780.00	29,564,000	
ファンケル	13,700	3,250.00	44,525,000	
コーセー	9,400	17,300.00	162,620,000	
シーズ・ホールディングス	7,800	5,560.00	43,368,000	
ポーラ・オルビスHD	23,900	4,125.00	98,587,500	
ノエビアホールディングス	3,800	8,220.00	31,236,000	
エステー	4,700	2,828.00	13,291,600	

コニシ	9,300	2,068.00	19,232,400	
長谷川香料	7,600	2,317.00	17,609,200	
小林製薬	15,400	7,510.00	115,654,000	
荒川化学工業	5,400	2,324.00	12,549,600	
メック	4,500	2,371.00	10,669,500	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	4,100	2,623.00	10,754,300	
タカラバイオ	14,400	1,567.00	22,564,800	
JCU	3,500	5,460.00	19,110,000	
新田ゼラチン	10,300	782.00	8,054,600	貸付株式数 800株
デクセリアルズ	14,200	1,377.00	19,553,400	
アース製薬	4,200	5,670.00	23,814,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
北興化学	10,000	774.00	7,740,000	貸付株式数 2,800株
クミアイ化学	24,900	768.00	19,123,200	貸付株式数 7,300株 (3,700株)

日本農薬	15,000	672.00	10,080,000	貸付株式数 4,200株 (4,200株)
昭和シエル石油	51,200	1,556.00	79,667,200	
ニチレキ	7,900	1,461.00	11,541,900	
ユシロ化学	5,300	1,682.00	8,914,600	
ビーピー・カストロール	3,100	2,228.00	6,906,800	
富士石油	15,500	598.00	9,269,000	
MORESCO	3,700	2,177.00	8,054,900	
出光興産	46,100	4,295.00	197,999,500	
JXTGホールディングス	879,900	686.10	603,699,390	
コスモエネルギーHLDGS	15,800	3,760.00	59,408,000	
横浜ゴム	31,700	2,637.00	83,592,900	
東洋ゴム	32,700	2,300.00	75,210,000	
ブリヂストン	196,000	5,169.00	1,013,124,000	
住友ゴム	53,800	2,052.00	110,397,600	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
藤倉ゴム	7,500	973.00	7,297,500	
オカモト	20,000	1,149.00	22,980,000	
アキレス	5,300	2,404.00	12,741,200	
ニッタ	5,700	4,235.00	24,139,500	
住友理工	10,200	1,198.00	12,219,600	
三ツ星ベルト	13,000	1,463.00	19,019,000	

バンドー化学	11,100	1,281.00	14,219,100	
旭硝子	56,400	4,770.00	269,028,000	
日本板硝子	27,500	1,009.00	27,747,500	
有沢製作所	11,200	1,284.00	14,380,800	
日本山村硝子	52,000	188.00	9,776,000	
日本電気硝子	23,800	4,330.00	103,054,000	
住友大阪セメント	107,000	531.00	56,817,000	
太平洋セメント	34,900	4,860.00	169,614,000	
日本ヒュ-ム	11,800	789.00	9,310,200	
日本コンクリ-ト	16,600	476.00	7,901,600	
アジアパイルHD	10,700	716.00	7,661,200	
東海カーボン	51,100	1,342.00	68,576,200	
日本カーボン	3,100	4,840.00	15,004,000	貸付株式数 800株
東洋炭素	4,000	3,350.00	13,400,000	
ノリタケ	3,400	5,810.00	19,754,000	
TOTO	42,800	6,390.00	273,492,000	
日本碍子	66,700	2,115.00	141,070,500	
日本特殊陶業	47,000	2,647.00	124,409,000	
MARUWA	2,000	7,840.00	15,680,000	
品川リフラクトリーズ	2,000	3,330.00	6,660,000	
黒崎播磨	1,300	4,765.00	6,194,500	貸付株式数 300株
ニッカトー	11,700	1,124.00	13,150,800	
フジインコーポレーテッド	5,200	2,441.00	12,693,200	
ニチアス	31,000	1,448.00	44,888,000	
新日鐵住金	245,100	2,801.00	686,525,100	
神戸製鋼所	99,800	1,055.00	105,289,000	
中山製鋼所	9,100	751.00	6,834,100	
合同製鐵	3,700	2,223.00	8,225,100	貸付株式数 1,000株
JFEホールディングス	147,600	2,675.50	394,903,800	
日新製鋼	15,100	1,786.00	26,968,600	
東京製鐵	29,400	948.00	27,871,200	
共英製鋼	6,300	2,053.00	12,933,900	貸付株式数 1,800株
大和工業	11,200	3,115.00	34,888,000	
東京鐵鋼	3,800	1,931.00	7,337,800	
大阪製鐵	4,200	2,261.00	9,496,200	
淀川製鋼所	8,000	3,385.00	27,080,000	
東洋鋼鈑	14,900	463.00	6,898,700	
丸一鋼管	19,100	3,250.00	62,075,000	
大同特殊鋼	9,600	6,720.00	64,512,000	

日本高周波	5,900	909.00	5,363,100	
日本冶金工	49,900	230.00	11,477,000	貸付株式数 13,800株
山陽特殊製鋼	6,300	2,796.00	17,614,800	
愛知製鋼	2,800	4,545.00	12,726,000	
日立金属	58,300	1,516.00	88,382,800	
日本金属	2,100	2,511.00	5,273,100	
大太平洋金属	3,700	2,938.00	10,870,600	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
新日本電工	34,200	455.00	15,561,000	貸付株式数 10,000株
栗本鉄工所	3,600	2,268.00	8,164,800	
日本製鋼所	18,100	3,515.00	63,621,500	
三菱製鋼	3,800	2,767.00	10,514,600	
日本精線	1,400	5,190.00	7,266,000	
大紀アルミニウム	10,400	808.00	8,403,200	貸付株式数 700株
日本軽金属HD	156,100	311.00	48,547,100	
三井金属	14,800	6,260.00	92,648,000	
東邦亜鉛	3,200	5,750.00	18,400,000	
三菱マテリアル	35,900	3,770.00	135,343,000	
住友鉱山	70,100	4,425.00	310,192,500	
DOWAホールディングス	13,800	4,385.00	60,513,000	
古河機金	9,000	2,198.00	19,782,000	
大阪チタニウム	6,300	1,970.00	12,411,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
東邦チタニウム	10,800	1,086.00	11,728,800	貸付株式数 3,100株 (200株)
UACJ	8,200	2,863.00	23,476,600	貸付株式数 2,200株
古河電工	18,200	5,570.00	101,374,000	
住友電工	203,900	1,855.50	378,336,450	
フジクラ	65,100	997.00	64,904,700	
昭和電線HLDGS	8,500	982.00	8,347,000	
タツタ電線	11,500	870.00	10,005,000	
リョービ	6,700	3,135.00	21,004,500	
アーレステイ	8,600	895.00	7,697,000	
アサヒHD	9,300	1,996.00	18,562,800	
東洋製罐グループHD	36,600	1,824.00	66,758,400	
ホッカンホールディングス	18,000	444.00	7,992,000	
横河ブリッジHLDGS	10,300	2,568.00	26,450,400	
OSJBHD	31,300	355.00	11,111,500	貸付株式数 7,400株
駒井ハルテック	3,100	2,614.00	8,103,400	
三和ホールディングス	52,500	1,505.00	79,012,500	

文化シヤツタ -	17,600	1,069.00	18,814,400	
三協立山	8,200	1,650.00	13,530,000	貸付株式数 2,200株
アルインコ	7,700	1,236.00	9,517,200	
LIxilグループ	80,900	3,010.00	243,509,000	
日本ファイルコン	11,700	771.00	9,020,700	
ノーリツ	12,200	2,181.00	26,608,200	
長府製作所	6,600	2,665.00	17,589,000	
リンナイ	9,700	10,110.00	98,067,000	
ユニプレス	10,600	2,913.00	30,877,800	
岡 部	11,700	1,080.00	12,636,000	
ジーテクト	6,300	2,247.00	14,156,100	
東 プ レ	10,100	3,235.00	32,673,500	
高周波熱錬	11,200	1,236.00	13,843,200	
東京製綱	5,000	1,598.00	7,990,000	貸付株式数 1,300株
パイオラックス	8,400	3,260.00	27,384,000	
エイチワン	4,400	1,760.00	7,744,000	
日本発条	53,000	1,224.00	64,872,000	
三浦工業	23,700	2,849.00	67,521,300	
タ ク マ	18,700	1,581.00	29,564,700	
テクノプロ・ホールディング ゲ	9,500	6,160.00	58,520,000	
イー・ガーディアン	3,300	2,596.00	8,566,800	貸付株式数 900株
ジャパンマテリアル	5,100	3,710.00	18,921,000	貸付株式数 1,400株 (600株)
ベクトル	7,000	1,662.00	11,634,000	貸付株式数 1,800株
アサンテ	4,300	1,933.00	8,311,900	
N・フィールド	3,700	1,600.00	5,920,000	貸付株式数 1,200株
M&Aキャピタルパート ナー	1,200	7,650.00	9,180,000	貸付株式数 300株 (300株)
エスクローAJ	8,800	578.00	5,086,400	
日本ビューホテル	5,300	1,376.00	7,292,800	
リクルートホールディング ス	409,500	2,814.50	1,152,537,750	貸付株式数 107,500株
ツ ガ ミ	15,000	1,375.00	20,625,000	貸付株式数 4,000株
オークマ	6,200	7,210.00	44,702,000	
東芝機械	31,000	806.00	24,986,000	
アマダホールディングス	82,900	1,506.00	124,847,400	
アイダエンジニア	13,600	1,331.00	18,101,600	
滝澤鉄工所	4,700	2,109.00	9,912,300	
富士機械製造	16,100	2,235.00	35,983,500	貸付株式数 4,900株

牧野フライス	25,000	1,116.00	27,900,000	貸付株式数	6,000株
オーエスジー	23,900	2,308.00	55,161,200	貸付株式数	7,600株 (7,600株)
旭ダイヤモンド	16,700	1,250.00	20,875,000		
D M G 森精機	29,800	2,294.00	68,361,200		
ソディック	12,200	1,442.00	17,592,400	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
ディスコ	7,500	25,710.00	192,825,000		
日東工器	4,000	2,893.00	11,572,000		
パンチ工業	3,200	2,688.00	8,601,600		
日本郵政	298,500	1,305.00	389,542,500		
ベルシステム24HLDGS	9,200	1,365.00	12,558,000	貸付株式数	2,800株
ソラスト	3,700	2,747.00	10,163,900	貸付株式数	900株
豊田自動織機	44,900	7,050.00	316,545,000		
豊和工業	3,500	1,715.00	6,002,500	貸付株式数	900株 (900株)
OKK	5,100	1,262.00	6,436,200		
石川製作所	1,700	3,270.00	5,559,000	貸付株式数	400株
東洋機械金属	7,000	907.00	6,349,000		
島精機製作所	7,000	7,310.00	51,170,000		
ヤマシンフィルタ	8,500	1,350.00	11,475,000	貸付株式数	2,100株
日阪製作所	10,300	1,228.00	12,648,400		
やまびこ	10,800	1,666.00	17,992,800		
平田機工	1,600	11,750.00	18,800,000	貸付株式数	400株 (400株)
ナプテスコ	29,800	4,330.00	129,034,000		
三井海洋開発	5,700	2,568.00	14,637,600		
レオン自動機	5,400	1,691.00	9,131,400		
SMC	17,400	45,710.00	795,354,000		
ホソカワミクロン	2,200	7,920.00	17,424,000		
ユニオンツール	2,700	4,360.00	11,772,000		
オイレス工業	7,100	2,228.00	15,818,800		
日精エーエスピー	2,000	6,870.00	13,740,000	貸付株式数	500株 (500株)
サト-ホールディングス	7,400	3,380.00	25,012,000		
技研製作所	3,000	2,999.00	8,997,000		
日精樹脂工業	5,700	1,669.00	9,513,300		
小松製作所	267,400	3,905.00	1,044,197,000		
住友重機械	31,400	4,685.00	147,109,000		

日立建機	25,800	3,925.00	101,265,000	
巴工業	4,500	2,071.00	9,319,500	
井関農機	5,500	2,754.00	15,147,000	
TOWA	4,700	2,125.00	9,987,500	
丸山製作所	5,000	2,138.00	10,690,000	
北川鉄工所	3,400	3,040.00	10,336,000	
シンニッタン	9,700	767.00	7,439,900	
ローツェ	3,000	2,676.00	8,028,000	貸付株式数 800株 (200株)
クボタ	299,200	2,140.00	640,288,000	
東洋エンジニア	7,700	1,245.00	9,586,500	貸付株式数 2,100株
三菱化工機	3,200	2,300.00	7,360,000	貸付株式数 100株
月島機械	11,600	1,306.00	15,149,600	
帝国電機製作所	6,300	1,613.00	10,161,900	
新東工業	13,400	1,413.00	18,934,200	
渋谷工業	5,000	4,340.00	21,700,000	
アイチ コーポレーション	9,600	831.00	7,977,600	貸付株式数 2,600株
小森コーポレーション	13,800	1,490.00	20,562,000	
鶴見製作所	4,900	2,024.00	9,917,600	
住友精密	27,000	373.00	10,071,000	
酒井重工業	1,800	4,410.00	7,938,000	
荏原製作所	22,600	4,325.00	97,745,000	
西島製作所	7,400	1,178.00	8,717,200	
北越工業	7,700	1,254.00	9,655,800	
千代田化工建	39,500	747.00	29,506,500	貸付株式数 12,200株
ダイキン工業	75,800	13,640.00	1,033,912,000	
オルガノ	2,800	3,240.00	9,072,000	
ト - ヨ - カネツ	2,500	4,355.00	10,887,500	貸付株式数 700株 (700株)
栗田工業	30,000	3,700.00	111,000,000	
椿本チエイン	31,000	882.00	27,342,000	
日 機 装	19,100	1,090.00	20,819,000	
新興プランテック	13,000	1,175.00	15,275,000	
アネスト岩田	10,300	1,200.00	12,360,000	
ダイフク	27,600	5,930.00	163,668,000	貸付株式数 7,700株
加藤製作所	2,800	3,225.00	9,030,000	
油研工業	3,500	2,731.00	9,558,500	
タダノ	26,200	1,757.00	46,033,400	
フジテック	17,300	1,613.00	27,904,900	
C K D	15,500	2,388.00	37,014,000	

キトー	5,300	1,630.00	8,639,000	
平和	16,800	1,995.00	33,516,000	貸付株式数 4,700株 (4,700株)
理想科学工業	5,700	2,065.00	11,770,500	
SANKYO	13,400	3,550.00	47,570,000	
日本金銭機械	6,500	1,135.00	7,377,500	貸付株式数 1,800株
マースエンジニアリング	4,100	2,439.00	9,999,900	
福島工業	3,600	5,070.00	18,252,000	
ダイコク電機	4,200	1,750.00	7,350,000	
竹内製作所	9,100	2,382.00	21,676,200	
アマノ	17,000	2,915.00	49,555,000	
JUKI	8,500	1,874.00	15,929,000	
サンデンホールディングス	7,100	2,208.00	15,676,800	
ブラザー工業	67,500	2,793.00	188,527,500	
マックス	8,800	1,559.00	13,719,200	
モリタホールディングス	9,200	2,050.00	18,860,000	
グローリー	16,400	4,405.00	72,242,000	
新晃工業	6,100	2,115.00	12,901,500	
大和冷機工業	10,000	1,379.00	13,790,000	
セガサミーホールディングス	54,700	1,393.00	76,197,100	
日本ピストンリング	3,800	2,233.00	8,485,400	
リケン	2,700	6,540.00	17,658,000	
TPR	6,200	3,710.00	23,002,000	
ツバキ・ナカシマ	5,700	2,591.00	14,768,700	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,500	10,020.00	175,350,000	貸付株式数 400株
大豊工業	5,100	1,689.00	8,613,900	
日本精工	113,800	1,693.00	192,663,400	貸付株式数 33,100株 (33,100株)
NTN	123,600	539.00	66,620,400	
ジェイテクト	58,000	1,893.00	109,794,000	
不二越	49,000	719.00	35,231,000	
ミネベアミツミ	102,800	2,375.00	244,150,000	
日本トムソン	19,100	725.00	13,847,500	
THK	34,300	4,140.00	142,002,000	
ユーシン精機	2,900	3,150.00	9,135,000	貸付株式数 800株 (800株)
イーグル工業	7,000	2,002.00	14,014,000	
日本ピラ-工業	6,300	1,717.00	10,817,100	

キッツ	24,900	834.00	20,766,600	
日立	1,328,000	849.60	1,128,268,800	
三菱電機	554,000	1,849.00	1,024,346,000	
富士電機	166,000	835.00	138,610,000	
東洋電機製造	3,500	1,930.00	6,755,000	貸付株式数 900株
安川電機	64,200	4,905.00	314,901,000	貸付株式数 18,200株
シンフォニア テクノロ ジー	37,000	434.00	16,058,000	
明電舎	47,000	460.00	21,620,000	貸付株式数 14,000株
オリジン電気	4,000	1,713.00	6,852,000	
山洋電気	2,800	7,990.00	22,372,000	
デンヨー	5,500	1,946.00	10,703,000	
三桜工業	9,700	855.00	8,293,500	
マキタ	72,100	4,740.00	341,754,000	
東芝テック	39,000	713.00	27,807,000	貸付株式数 10,000株
マブチモーター	15,300	5,970.00	91,341,000	
日本電産	66,700	15,720.00	1,048,524,000	
東光高岳	3,300	1,817.00	5,996,100	
ダブル・スコープ	8,200	2,178.00	17,859,600	貸付株式数 2,300株 (100株)
ダイヘン	30,000	998.00	29,940,000	
ヤーマン	7,400	1,905.00	14,097,000	貸付株式数 2,000株
JVCケンウッド	43,600	379.00	16,524,400	
第一精工	2,900	2,985.00	8,656,500	
日新電機	13,000	1,349.00	17,537,000	
大崎電気	12,800	821.00	10,508,800	
オムロン	58,700	6,710.00	393,877,000	貸付株式数 100株 (100株)
日東工業	8,900	1,785.00	15,886,500	
I D E C	7,400	2,470.00	18,278,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	98,000	553.00	54,194,000	貸付株式数 27,000株
メルコホールディングス	2,700	4,025.00	10,867,500	貸付株式数 1,000株
日本電気	71,200	3,135.00	223,212,000	
富士通	570,000	821.90	468,483,000	
沖電気	22,100	1,605.00	35,470,500	
電気興業	3,800	3,170.00	12,046,000	
サンケン電気	33,000	698.00	23,034,000	
アイホン	4,900	1,930.00	9,457,000	
ルネサスエレクトロニクス	30,300	1,285.00	38,935,500	
セイコーエプソン	82,300	2,653.00	218,341,900	

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	7,280.00	67,704,000	
E I Z O	5,100	5,610.00	28,611,000	
ジャパンディスプレイ	115,700	233.00	26,958,100	貸付株式数 32,000株 (31,700株)
日本信号	15,200	1,199.00	18,224,800	
京三製作所	17,000	682.00	11,594,000	
能美防災	7,600	2,033.00	15,450,800	
ホーチキ	4,600	2,419.00	11,127,400	
エレコム	4,900	2,614.00	12,808,600	
パナソニック	632,800	1,674.50	1,059,623,600	
アンリツ	40,400	1,245.00	50,298,000	
富士通ゼネラル	17,100	2,450.00	41,895,000	
日立国際電気	10,900	3,105.00	33,844,500	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
ソ ニ ー	369,800	5,161.00	1,908,537,800	
T D K	28,700	8,860.00	254,282,000	
帝国通信工業	7,100	1,273.00	9,038,300	
タムラ製作所	22,800	847.00	19,311,600	
アルプス電気	47,500	3,245.00	154,137,500	
池上通信機	40,000	176.00	7,040,000	
パイオニア	92,200	218.00	20,099,600	貸付株式数 6,000株
日本電波工業	8,100	757.00	6,131,700	貸付株式数 2,200株
日本トリム	1,400	5,120.00	7,168,000	貸付株式数 400株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,300	3,140.00	10,362,000	
フオスタ - 電機	6,800	2,796.00	19,012,800	
クラリオン	30,000	419.00	12,570,000	
S M K	16,000	543.00	8,688,000	
ヨコオ	4,700	1,530.00	7,191,000	貸付株式数 1,500株
ホシデン	14,100	1,683.00	23,730,300	貸付株式数 3,800株
ヒロセ電機	8,800	16,170.00	142,296,000	
日本航空電子	14,000	1,944.00	27,216,000	
T O A	7,100	1,452.00	10,309,200	
マクセルホールディングス	11,100	2,429.00	26,961,900	
古野電気	9,600	837.00	8,035,200	
ユニデンホールディングス	22,000	298.00	6,556,000	
アルパイン	13,300	2,327.00	30,949,100	

スミダコーポレーション	5,900	1,984.00	11,705,600	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
アイコム	3,600	2,686.00	9,669,600	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
リオン	3,600	2,274.00	8,186,400	
本多通信工業	6,200	1,130.00	7,006,000	
船井電機	7,200	862.00	6,206,400	貸付株式数 2,000株 (1,800株)
横河電機	54,700	2,164.00	118,370,800	
新電元工業	2,100	8,140.00	17,094,000	
アズビル	16,300	4,870.00	79,381,000	
日本光電工業	23,000	2,582.00	59,386,000	
共和電業	19,500	461.00	8,989,500	
堀場製作所	10,800	6,910.00	74,628,000	
アドバンテスト	31,000	2,192.00	67,952,000	貸付株式数 8,500株
エスペック	5,100	2,719.00	13,866,900	
キーエンス	27,200	64,660.00	1,758,752,000	
日置電機	3,600	2,941.00	10,587,600	
シスメックス	43,100	8,690.00	374,539,000	
日本マイクロニクス	10,600	1,167.00	12,370,200	貸付株式数 3,100株
メガチップス	4,500	3,290.00	14,805,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
O B A R A G R O U P	3,300	7,670.00	25,311,000	
デンソー	123,100	6,479.00	797,564,900	
コーセル	8,200	1,848.00	15,153,600	
イリソ電子工業	4,700	6,830.00	32,101,000	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
オプテックスグループ	4,700	5,820.00	27,354,000	
千代田インテグレ	3,000	2,814.00	8,442,000	
レーザーテック	12,400	2,834.00	35,141,600	
スタンレー電気	42,300	4,635.00	196,060,500	
岩崎電気	3,800	1,669.00	6,342,200	
ウシオ電機	32,900	1,609.00	52,936,100	
ヘリオステクノH	8,700	1,044.00	9,082,800	
日本セラミック	5,700	2,862.00	16,313,400	
古河電池	5,300	1,102.00	5,840,600	貸付株式数 1,400株 (1,000株)
山一電機	4,400	2,056.00	9,046,400	貸付株式数 1,600株
図 研	4,700	1,918.00	9,014,600	
日本電子	21,000	620.00	13,020,000	

カシオ	44,100	1,615.00	71,221,500	
ファナック	52,600	26,890.00	1,414,414,000	
日本シイエムケイ	10,100	1,005.00	10,150,500	貸付株式数 2,700株
エンプラス	2,600	4,630.00	12,038,000	
大真空	3,700	1,669.00	6,175,300	
ローム	24,800	12,080.00	299,584,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
浜松ホトニクス	40,000	3,775.00	151,000,000	
三井ハイテック	7,500	2,016.00	15,120,000	貸付株式数 2,000株
新光電気工業	21,500	894.00	19,221,000	
京セラ	90,900	7,533.00	684,749,700	
太陽誘電	24,200	1,731.00	41,890,200	
村田製作所	58,100	14,925.00	867,142,500	
ユーシン	13,200	776.00	10,243,200	貸付株式数 3,900株 (3,500株)
双葉電子工業	8,800	2,318.00	20,398,400	
日東電工	41,800	10,405.00	434,929,000	
北陸電気工業	4,500	1,723.00	7,753,500	
東海理化電機	14,000	2,290.00	32,060,000	
ニチコン	17,100	1,479.00	25,290,900	
日本ケミコン	4,600	3,605.00	16,583,000	
K O A	8,100	2,241.00	18,152,100	
三井造船	17,900	1,641.00	29,373,900	貸付株式数 5,000株
日立造船	41,800	567.00	23,700,600	
三菱重工業	92,200	4,177.00	385,119,400	
川崎重工業	42,400	3,585.00	152,004,000	
I H I	42,300	3,720.00	157,356,000	
名村造船所	18,200	669.00	12,175,800	
日本車輛	25,000	323.00	8,075,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
三菱ロジスネクスト	7,200	922.00	6,638,400	
F P G	19,800	1,381.00	27,343,800	貸付株式数 5,400株
じもとホールディングス	55,200	194.00	10,708,800	
全国保証	15,500	5,020.00	77,810,000	
めぶきフィナンシャルG	281,100	479.00	134,646,900	
東京TYフィナンシャルG	7,400	3,235.00	23,939,000	
九州フィナンシャルG	88,100	703.00	61,934,300	
かんぽ生命保険	20,700	2,627.00	54,378,900	
ゆうちょ銀行	156,400	1,484.00	232,097,600	
富山第一銀行	19,100	540.00	10,314,000	

コンコルディア・フィナンシャル	331,300	697.00	230,916,100	
西日本フィナンシャルHD	36,000	1,358.00	48,888,000	
日産自動車	651,900	1,101.50	718,067,850	
いすゞ自動車	160,600	1,841.00	295,664,600	
トヨタ自動車	673,500	7,162.00	4,823,607,000	
日野自動車	79,100	1,433.00	113,350,300	
三菱自動車工業	205,100	798.00	163,669,800	
エフテック	4,600	1,659.00	7,631,400	
武蔵精密工業	6,100	3,415.00	20,831,500	貸付株式数 1,600株
日産車体	21,600	1,158.00	25,012,800	
新明和工業	23,500	1,054.00	24,769,000	
極東開発工業	10,300	1,994.00	20,538,200	
日信工業	11,200	2,156.00	24,147,200	
トピー工業	4,700	3,430.00	16,121,000	
ティラド	2,300	3,910.00	8,993,000	
曙ブレーキ	27,400	309.00	8,466,600	貸付株式数 7,500株
タチエス	9,500	2,062.00	19,589,000	
N O K	29,400	2,636.00	77,498,400	
フタバ産業	17,200	1,056.00	18,163,200	
K Y B	5,800	6,450.00	37,410,000	
市光工業	9,400	1,022.00	9,606,800	
大同メタル工業	8,000	1,074.00	8,592,000	
プレス工業	29,800	665.00	19,817,000	
太平洋工業	11,800	1,707.00	20,142,600	
ケーヒン	12,600	2,211.00	27,858,600	
河西工業	7,100	1,756.00	12,467,600	
アイシン精機	45,700	6,040.00	276,028,000	
マ ッ ダ	172,600	1,510.50	260,712,300	貸付株式数 48,200株 (48,200株)
今仙電機製作所	7,300	1,342.00	9,796,600	
本田技研	498,200	3,830.00	1,908,106,000	
スズキ	109,900	6,474.00	711,492,600	
S U B A R U	172,000	3,712.00	638,464,000	
安永	2,800	2,640.00	7,392,000	貸付株式数 700株
ヤマハ発動機	78,100	3,605.00	281,550,500	
ショーワ	14,700	1,320.00	19,404,000	貸付株式数 4,000株
小糸製作所	33,400	7,750.00	258,850,000	貸付株式数 9,400株
T B K	22,400	538.00	12,051,200	
エクセディ	6,200	3,420.00	21,204,000	

ミツバ	10,500	1,642.00	17,241,000	
豊田合成	19,600	2,886.00	56,565,600	貸付株式数 4,500株
愛三工業	10,100	1,286.00	12,988,600	
ヨロズ	5,700	2,507.00	14,289,900	
エフ・シー・シー	8,900	2,958.00	26,326,200	
シマノ	22,500	15,440.00	347,400,000	
テイ・エス テック	13,000	4,580.00	59,540,000	
ジャムコ	2,900	2,774.00	8,044,600	貸付株式数 900株 (900株)
小野建	5,300	2,047.00	10,849,100	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ノジマ	9,900	2,698.00	26,710,200	
佐鳥電機	8,700	1,020.00	8,874,000	
伯東	3,900	1,892.00	7,378,800	
コンドーテック	8,200	1,059.00	8,683,800	
ライトオン	6,600	905.00	5,973,000	貸付株式数 1,800株 (1,400株)
ナガイレーベン	7,300	2,671.00	19,498,300	
三菱食品	5,900	3,375.00	19,912,500	
良品計画	7,300	35,750.00	260,975,000	
松田産業	5,800	1,839.00	10,666,200	
第一興商	8,000	5,470.00	43,760,000	
メディパルHD	54,400	2,209.00	120,169,600	
アドヴァン	6,600	1,070.00	7,062,000	貸付株式数 600株 (600株)
萩原電気	2,500	3,340.00	8,350,000	
アルビス	1,600	4,095.00	6,552,000	貸付株式数 400株 (100株)
アズワン	4,300	6,820.00	29,326,000	
ドウシシャ	6,000	2,277.00	13,662,000	
小津産業	4,900	2,158.00	10,574,200	
コジマ	16,900	376.00	6,354,400	
コーナン商事	7,900	2,445.00	19,315,500	
ネットワンシステムズ	22,900	1,752.00	40,120,800	
ワタミ	7,300	1,598.00	11,665,400	
ドンキホーテホールディング グ	35,500	5,750.00	204,125,000	
丸文	7,300	1,096.00	8,000,800	
西松屋チェーン	12,200	1,302.00	15,884,400	貸付株式数 3,400株

ゼンショーホールディングス	28,500	1,955.00	55,717,500	貸付株式数	8,000株
ハピネット	4,300	2,045.00	8,793,500		
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,834.00	13,388,200	貸付株式数	1,900株 (1,600株)
日本ライフライン	7,800	4,590.00	35,802,000	貸付株式数	1,800株 (100株)
サイゼリヤ	8,300	3,720.00	30,876,000		
エクセル	3,100	2,602.00	8,066,200	貸付株式数	900株
V Tホールディングス	19,500	576.00	11,232,000	貸付株式数	5,400株
マルカキカイ	3,400	2,157.00	7,333,800	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	3,200	3,415.00	10,928,000		
I D O M	17,700	822.00	14,549,400	貸付株式数	4,700株 (100株)
ポプラ	11,600	675.00	7,830,000		
ユナイテッドアローズ	6,700	4,540.00	30,418,000		
進和	4,700	2,621.00	12,318,700		
ダイترون	3,800	2,428.00	9,226,400		
ハイデイ日高	6,100	3,770.00	22,997,000		
シークス	3,300	4,755.00	15,691,500	貸付株式数	900株 (900株)
コロワイド	18,300	2,186.00	40,003,800	貸付株式数	5,100株
ピーシーデポコーポ	8,900	865.00	7,698,500	貸付株式数	2,400株 (500株)
壱番屋	3,900	4,540.00	17,706,000	貸付株式数	900株
スギホールディングス	11,800	5,860.00	69,148,000		
島津製作所	65,900	2,569.00	169,297,100		
長野計器	7,500	1,303.00	9,772,500		
ブイ・テクノロジー	1,300	18,700.00	24,310,000	貸付株式数	300株
スター精密	8,600	1,875.00	16,125,000	貸付株式数	2,700株
東京計器	4,800	1,360.00	6,528,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
東京精密	9,900	4,575.00	45,292,500		
マニー	6,900	3,295.00	22,735,500		
ニコン	96,600	2,278.00	220,054,800		
トプコン	29,700	2,449.00	72,735,300		
オリンパス	82,600	4,230.00	349,398,000	貸付株式数	25,300株 (25,300株)
理研計器	5,900	2,529.00	14,921,100		
S C R E E Nホールディングス	10,500	9,630.00	101,115,000		

キヤノン電子	5,600	2,496.00	13,977,600	
タムロン	4,600	2,439.00	11,219,400	貸付株式数 100株
HOYA	113,900	5,677.00	646,610,300	貸付株式数 31,800株 (31,800株)
ノーリツ鋼機	6,100	2,349.00	14,328,900	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	297,900	4,338.00	1,292,290,200	
リコー	165,900	1,012.00	167,890,800	
シチズン時計	63,800	825.00	52,635,000	
リズム時計	4,000	2,313.00	9,252,000	
メニコン	4,000	6,360.00	25,440,000	
パラマウントベッドHD	5,800	5,370.00	31,146,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
SHOBI	13,300	432.00	5,745,600	貸付株式数 3,000株
ニホンフラッシュ	4,400	2,957.00	13,010,800	貸付株式数 1,200株
前田工織	6,500	2,030.00	13,195,000	
アートネイチャー	9,000	793.00	7,137,000	
ダンロップスポーツ	4,400	1,607.00	7,070,800	
バンダイナムコHLDGS	57,300	3,735.00	214,015,500	
SHOEI	2,800	4,550.00	12,740,000	
マーベラス	9,900	1,045.00	10,345,500	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	5,470.00	52,512,000	
萩原工業	4,500	1,935.00	8,707,500	貸付株式数 1,200株
エイベックス	10,200	1,626.00	16,585,200	
トッパン・フォームズ	12,200	1,243.00	15,164,600	
フジシールインターナショナル	12,300	3,775.00	46,432,500	
タカラトミー	23,600	1,531.00	36,131,600	
レック	3,600	2,850.00	10,260,000	貸付株式数 1,100株
大建工業	4,700	2,918.00	13,714,600	
凸版印刷	153,000	1,020.00	156,060,000	
大日本印刷	71,700	2,513.00	180,182,100	
共同印刷	2,300	3,665.00	8,429,500	
NISSHA	11,100	3,435.00	38,128,500	貸付株式数 3,100株 (2,700株)
藤森工業	4,800	3,730.00	17,904,000	
ヴィア・ホールディングス	10,700	752.00	8,046,400	貸付株式数 2,900株
宝印刷	6,900	1,714.00	11,826,600	

アシックス	54,600	1,756.00	95,877,600	貸付株式数	15,200株
ジェイ エス ピー	3,500	3,710.00	12,985,000		
ニチハ	8,500	4,405.00	37,442,500		
エフピコ	4,600	6,060.00	27,876,000	貸付株式数	1,400株
ヤマハ	37,500	4,090.00	153,375,000		
河合楽器	3,800	2,580.00	9,804,000		
クリナップ	8,300	866.00	7,187,800		
ビジョン	33,400	4,365.00	145,791,000		
天馬	4,600	2,192.00	10,083,200		
キングジム	10,100	998.00	10,079,800		
リンテック	12,400	3,075.00	38,130,000		
信越ポリマー	11,400	1,250.00	14,250,000		
東リ	22,300	441.00	9,834,300		
イトーキ	13,300	826.00	10,985,800		
任天堂	34,100	43,030.00	1,467,323,000		
三菱鉛筆	9,000	2,426.00	21,834,000		
タカラスタンダード	11,300	1,782.00	20,136,600		
コクヨ	26,200	2,109.00	55,255,800		
ナカバヤシ	12,800	715.00	9,152,000		
ニフコ	10,000	7,500.00	75,000,000		
立川ブラインド	5,200	1,452.00	7,550,400		
グローブライド	4,100	1,989.00	8,154,900		
岡村製作所	19,200	1,521.00	29,203,200		
日本バルカー	4,900	2,970.00	14,553,000		
伊藤忠	400,500	1,949.50	780,774,750		
丸紅	444,500	776.00	344,932,000		
スクロール	16,500	511.00	8,431,500		
高島	3,300	2,204.00	7,273,200		
ヨンドシーホールディングス	5,600	2,947.00	16,503,200	貸付株式数	1,400株
三陽商会	4,900	2,171.00	10,637,900	貸付株式数	1,200株
長瀬産業	31,800	2,038.00	64,808,400		
蝶理	4,100	2,104.00	8,626,400		
豊田通商	60,700	4,365.00	264,955,500		
オンワードホールディングス	35,000	954.00	33,390,000		
兼松	23,300	1,565.00	36,464,500		
美津濃	5,700	3,320.00	18,924,000		
ツカモトコーポレーション	6,800	1,291.00	8,778,800		

ユニー・ファミリーマート HD	17,600	8,070.00	142,032,000	
三井物産	461,600	1,740.00	803,184,000	
日本紙パルプ	2,900	4,145.00	12,020,500	
東京エレクトロン	37,000	21,320.00	788,840,000	
日立ハイテクノロジーズ	18,900	4,780.00	90,342,000	
カメイ	7,200	1,853.00	13,341,600	
スターゼン	2,400	5,600.00	13,440,000	
セイコーHD	8,300	3,300.00	27,390,000	貸付株式数 2,300株
山 善	20,900	1,318.00	27,546,200	
住友商事	343,400	1,832.50	629,280,500	
日本ユニシス	15,200	2,272.00	34,534,400	
内田洋行	3,100	3,225.00	9,997,500	
三菱商事	382,900	2,942.00	1,126,491,800	
第一実業	3,100	3,320.00	10,292,000	
キャノンマーケティングJ PN	15,800	3,030.00	47,874,000	
西華産業	3,700	2,932.00	10,848,400	
菱洋エレクトロ	5,600	1,982.00	11,099,200	
ユアサ商事	5,100	4,020.00	20,502,000	
神鋼商事	2,000	3,010.00	6,020,000	
阪和興業	10,100	4,610.00	46,561,000	
正栄食品	3,200	5,170.00	16,544,000	貸付株式数 800株
カナデン	8,400	1,466.00	12,314,400	
菱電商事	5,000	1,820.00	9,100,000	
ニプロ	38,100	1,550.00	59,055,000	
岩谷産業	11,500	3,530.00	40,595,000	
すてきナイスグループ	6,100	1,544.00	9,418,400	
極東貿易	20,000	475.00	9,500,000	
イ ワ キ	14,000	487.00	6,818,000	
兼松エレクトロニクス	3,700	3,365.00	12,450,500	
三愛石油	14,400	1,576.00	22,694,400	
稲畑産業	12,900	1,679.00	21,659,100	
ゴ - ルドウイン	1,800	8,420.00	15,156,000	貸付株式数 700株 (700株)
ユニ・チャ - ム	117,300	2,976.50	349,143,450	
デサント	13,300	1,934.00	25,722,200	貸付株式数 3,500株
ワ キ タ	12,300	1,331.00	16,371,300	
東邦ホールディングス	15,400	2,451.00	37,745,400	貸付株式数 4,700株
サンゲツ	17,900	2,056.00	36,802,400	

ミツウロコグループ	9,300	843.00	7,839,900	
シナネンホールディングス	3,200	2,578.00	8,249,600	
伊藤忠エネクス	11,600	1,089.00	12,632,400	
サンリオ	15,300	1,873.00	28,656,900	貸付株式数 4,600株
サンワ テクノス	4,200	2,165.00	9,093,000	
リョーサン	6,800	4,320.00	29,376,000	
新光商事	6,600	2,093.00	13,813,800	
トーホー	4,300	2,789.00	11,992,700	
三信電気	5,400	1,791.00	9,671,400	
東陽テクニカ	10,000	972.00	9,720,000	
モスフード サービス	7,400	3,415.00	25,271,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
加賀電子	5,000	3,190.00	15,950,000	
三益半導体	5,400	2,028.00	10,951,200	
木曽路	7,500	2,759.00	20,692,500	
千 趣 会	15,200	659.00	10,016,800	貸付株式数 2,600株
タカキユー	33,400	228.00	7,615,200	
ケーヨー	14,400	716.00	10,310,400	
上新電機	6,600	4,115.00	27,159,000	
日本瓦斯	10,200	4,000.00	40,800,000	
ロイヤルホールディングス	9,900	3,245.00	32,125,500	貸付株式数 2,700株
いなげや	6,900	1,852.00	12,778,800	
島 忠	14,000	3,340.00	46,760,000	貸付株式数 3,600株
チヨダ	6,600	3,020.00	19,932,000	
ライフコーポレーション	4,300	3,015.00	12,964,500	
リンガーハット	7,100	2,563.00	18,197,300	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
MrMaxHD	9,700	902.00	8,749,400	
AOKIホールディングス	10,500	1,652.00	17,346,000	
オークワ	9,000	1,163.00	10,467,000	
コメリ	8,200	3,260.00	26,732,000	
青山商事	10,300	4,245.00	43,723,500	貸付株式数 3,000株
しまむら	6,300	13,350.00	84,105,000	
高 島 屋	85,000	1,146.00	97,410,000	
松 屋	12,500	1,441.00	18,012,500	貸付株式数 3,400株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	25,700	2,256.00	57,979,200	
丸井グループ	52,700	2,028.00	106,875,600	
クレディセゾン	41,000	2,047.00	83,927,000	
アクシアル リテイリング	4,700	4,270.00	20,069,000	

イオン	210,300	1,930.50	405,984,150	貸付株式数	48,000株
イズミ	10,000	6,980.00	69,800,000		
平和堂	10,900	2,464.00	26,857,600	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
フジ	6,600	2,438.00	16,090,800		
ヤオコー	6,400	5,470.00	35,008,000		
ゼビオホールディングス	7,300	2,182.00	15,928,600		
ケースホールディングス	22,800	2,949.00	67,237,200	貸付株式数	6,600株 (3,000株)
PALTAC	7,600	5,280.00	40,128,000		
新生銀行	47,000	1,951.00	91,697,000		
あおぞら銀行	32,100	4,450.00	142,845,000		
三菱UFJフィナンシャルG	3,861,600	821.60	3,172,690,560		
りそなホールディングス	597,800	648.20	387,493,960		
三井住友トラストHD	107,000	4,459.00	477,113,000		
三井住友フィナンシャルG	413,300	4,866.00	2,011,117,800		
第四銀行	6,500	5,160.00	33,540,000		
北越銀行	5,900	2,632.00	15,528,800		
千葉銀行	195,000	940.00	183,300,000		
群馬銀行	107,000	704.00	75,328,000		
武蔵野銀行	8,400	3,795.00	31,878,000		
千葉興業銀行	19,100	593.00	11,326,300		
筑波銀行	33,000	399.00	13,167,000		
七十七銀行	16,300	2,814.00	45,868,200		
青森銀行	4,200	3,580.00	15,036,000		
秋田銀行	3,500	3,125.00	10,937,500		
山形銀行	6,000	2,504.00	15,024,000	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
岩手銀行	3,600	4,630.00	16,668,000	貸付株式数	600株
東邦銀行	47,200	411.00	19,399,200		
東北銀行	8,300	1,531.00	12,707,300		
ふくおかフィナンシャルG	219,000	634.00	138,846,000		
静岡銀行	142,000	1,178.00	167,276,000		
十六銀行	6,700	3,430.00	22,981,000		
スルガ銀行	55,700	2,421.00	134,849,700		
八十二銀行	93,800	661.00	62,001,800		
山梨中央銀行	34,000	501.00	17,034,000		
大垣共立銀行	8,300	2,880.00	23,904,000		
福井銀行	4,900	2,757.00	13,509,300		

北國銀行	6,000	4,605.00	27,630,000	
清水銀行	2,700	3,335.00	9,004,500	
滋賀銀行	46,000	598.00	27,508,000	
南都銀行	6,300	3,140.00	19,782,000	
百五銀行	50,000	551.00	27,550,000	
京都銀行	20,600	6,150.00	126,690,000	
紀陽銀行	19,800	1,887.00	37,362,600	
三重銀行	3,800	2,611.00	9,921,800	
ほくほくフィナンシャルG	34,700	1,793.00	62,217,100	
広島銀行	78,100	933.00	72,867,300	
山陰合同銀行	31,200	1,078.00	33,633,600	
中国銀行	36,700	1,553.00	56,995,100	
伊予銀行	76,000	946.00	71,896,000	貸付株式数 15,700株
百十四銀行	58,000	373.00	21,634,000	
四国銀行	8,600	1,594.00	13,708,400	
阿波銀行	41,000	721.00	29,561,000	
大分銀行	3,000	4,495.00	13,485,000	貸付株式数 800株
宮崎銀行	3,600	3,825.00	13,770,000	
佐賀銀行	3,800	2,653.00	10,081,400	
十八銀行	38,000	309.00	11,742,000	
沖縄銀行	5,200	4,580.00	23,816,000	貸付株式数 100株
琉球銀行	10,800	1,692.00	18,273,600	
セブン銀行	203,400	383.00	77,902,200	貸付株式数 58,500株
みずほフィナンシャルG	7,416,000	205.60	1,524,729,600	
高知銀行	8,600	1,326.00	11,403,600	
山口フィナンシャルG	48,000	1,381.00	66,288,000	
芙蓉総合リース	6,200	7,450.00	46,190,000	
興銀リース	10,100	2,846.00	28,744,600	
東京センチュリー	11,100	5,300.00	58,830,000	
SBIホールディングス	61,900	2,396.00	148,312,400	
日本証券金融	23,700	614.00	14,551,800	
アイフル	94,500	393.00	37,138,500	貸付株式数 27,400株 (300株)
名古屋銀行	4,100	4,500.00	18,450,000	貸付株式数 1,200株
北洋銀行	78,200	380.00	29,716,000	
愛知銀行	1,900	5,440.00	10,336,000	
第三銀行	5,100	1,882.00	9,598,200	
中京銀行	3,100	2,340.00	7,254,000	
大光銀行	3,200	2,581.00	8,259,200	
愛媛銀行	7,700	1,381.00	10,633,700	貸付株式数 1,900株

トマト銀行	8,300	1,567.00	13,006,100	
みなと銀行	5,200	2,085.00	10,842,000	
京葉銀行	45,000	521.00	23,445,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
関西アーバン銀行	7,400	1,469.00	10,870,600	
栃木銀行	27,800	473.00	13,149,400	
北日本銀行	3,400	3,200.00	10,880,000	
東和銀行	10,400	1,492.00	15,516,800	
福島銀行	10,900	923.00	10,060,700	
大東銀行	5,400	1,676.00	9,050,400	
リコーリース	4,300	3,770.00	16,211,000	
イオンフィナンシャルサー ビス	38,600	2,552.00	98,507,200	
アコム	114,800	477.00	54,759,600	貸付株式数 32,900株
ジャックス	6,900	2,573.00	17,753,700	
オリコ	116,900	180.00	21,042,000	貸付株式数 35,700株
日立キャピタル	14,800	2,759.00	40,833,200	
アプラスフィナンシャル	58,400	107.00	6,248,800	貸付株式数 16,300株
オリックス	363,300	1,904.00	691,723,200	
三菱UFJリース	136,700	667.00	91,178,900	
ジャフコ	7,800	6,690.00	52,182,000	
トモニホールディングス	43,900	596.00	26,164,400	
大和証券G本社	464,000	705.80	327,491,200	
野村ホールディングス	985,300	668.20	658,377,460	
岡三証券グループ	45,000	700.00	31,500,000	
丸三証券	19,400	1,041.00	20,195,400	貸付株式数 4,500株
東洋証券	32,000	318.00	10,176,000	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	413.00	10,820,600	
いちよし証券	13,600	1,294.00	17,598,400	
松井証券	24,500	957.00	23,446,500	
SOMPOホールディング ス	107,100	4,443.00	475,845,300	
日本取引所グループ	160,800	1,980.00	318,384,000	
マネックスG	58,800	340.00	19,992,000	
カブドットコム証券	35,600	347.00	12,353,200	
極東証券	8,200	1,666.00	13,661,200	
岩井コスモホールディング	7,900	1,425.00	11,257,500	
藍澤證券	14,100	761.00	10,730,100	
フィデアホール	63,500	203.00	12,890,500	

池田泉州HD	50,500	421.00	21,260,500	
アニコムホールディングス	4,000	3,500.00	14,000,000	貸付株式数 1,100株
MS&AD	142,700	3,817.00	544,685,900	
SONY FH	44,200	1,979.00	87,471,800	
第一生命HLDGS	308,700	2,351.00	725,753,700	
東京海上HD	205,700	5,114.00	1,051,949,800	
イー・ギャランティ	2,400	3,365.00	8,076,000	貸付株式数 700株 (700株)
NECキャピタルソリューション	3,300	2,260.00	7,458,000	
T&Dホールディングス	167,700	1,944.50	326,092,650	
アドバンスクリエイト	3,700	1,960.00	7,252,000	
三井不動産	273,300	2,571.50	702,790,950	
三菱地所	407,900	1,969.50	803,359,050	
平和不動産	9,900	2,060.00	20,394,000	
東京建物	58,300	1,545.00	90,073,500	
ダイビル	14,300	1,371.00	19,605,300	
京阪神ビルディング	12,200	863.00	10,528,600	
住友不動産	131,000	3,724.00	487,844,000	
大京	8,700	2,204.00	19,174,800	
テーオーシー	19,400	977.00	18,953,800	
レオパレス21	67,500	912.00	61,560,000	
スターツコーポレーション	7,400	2,886.00	21,356,400	
フジ住宅	10,900	861.00	9,384,900	
空港施設	11,100	672.00	7,459,200	
ゴールドクレスト	4,300	2,291.00	9,851,300	
リログループ	29,400	2,954.00	86,847,600	
日本エスリード	3,400	2,496.00	8,486,400	
日神不動産	9,100	920.00	8,372,000	
日本エスコン	11,800	710.00	8,378,000	貸付株式数 3,100株
タカラレーベン	25,900	497.00	12,872,300	貸付株式数 7,200株
サンヨーハウジ名古屋	8,000	1,198.00	9,584,000	
イオンモール	34,600	2,167.00	74,978,200	
東祥	3,700	3,580.00	13,246,000	貸付株式数 1,000株
トーセイ	8,300	1,100.00	9,130,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	33,700	1,301.00	43,843,700	
サンフロンティア不動産	6,500	1,283.00	8,339,500	貸付株式数 1,700株 (100株)
エフ・ジェー・ネクスト	6,200	1,007.00	6,243,400	

グランディハウス	19,200	588.00	11,289,600	
東武鉄道	59,200	3,730.00	220,816,000	
相鉄ホールディングス	17,500	2,979.00	52,132,500	
東京急行	151,200	1,824.00	275,788,800	
京浜急行	76,300	2,182.00	166,486,600	
小田急電鉄	82,900	2,458.00	203,768,200	
京王電鉄	30,900	5,120.00	158,208,000	
京成電鉄	38,600	3,700.00	142,820,000	
富士急行	7,800	3,265.00	25,467,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
東日本旅客鉄道	99,700	11,230.00	1,119,631,000	
西日本旅客鉄道	50,000	8,405.00	420,250,000	
東海旅客鉄道	49,800	20,800.00	1,035,840,000	
西武ホールディングス	70,200	2,120.00	148,824,000	
鴻池運輸	8,200	1,919.00	15,735,800	
西日本鉄道	15,200	3,080.00	46,816,000	
ハマキョウレックス	4,200	3,080.00	12,936,000	
サカイ引越センター	3,100	5,550.00	17,205,000	貸付株式数 800株 (200株)
近鉄グループHLDGS	52,400	4,425.00	231,870,000	
阪急阪神HLDGS	70,300	4,600.00	323,380,000	
南海電鉄	25,000	2,858.00	71,450,000	
京阪ホールディングス	23,100	3,355.00	77,500,500	
名古屋鉄道	40,200	2,819.00	113,323,800	貸付株式数 11,200株 (11,200株)
山陽電鉄	4,900	2,800.00	13,720,000	
トランコム	1,700	7,830.00	13,311,000	
日本通運	20,500	7,450.00	152,725,000	
ヤマトホールディングス	92,300	2,347.50	216,674,250	
山 九	13,300	4,920.00	65,436,000	
日 新	4,900	3,105.00	15,214,500	
丸全昭和運輸	22,000	528.00	11,616,000	
センコーグループHLDGS	31,700	788.00	24,979,600	
トナミホールディングス	1,500	5,760.00	8,640,000	
ニッコンホールディングス	19,500	3,085.00	60,157,500	
福山通運	7,500	4,255.00	31,912,500	
セイノーホールディングス	38,700	1,782.00	68,963,400	貸付株式数 10,600株
日立物流	11,700	3,020.00	35,334,000	

丸和運輸機関	3,200	3,540.00	11,328,000	貸付株式数 900株 (900株)
日本郵船	43,400	2,734.00	118,655,600	貸付株式数 13,000株
商船三井	32,700	3,670.00	120,009,000	
川崎汽船	24,000	2,879.00	69,096,000	貸付株式数 6,700株
N S ユナイテッド海運	2,600	2,950.00	7,670,000	
飯野海運	27,900	606.00	16,907,400	
九州旅客鉄道	43,900	3,575.00	156,942,500	
日本航空	96,800	4,300.00	416,240,000	
A N A ホールディングス	102,900	4,736.00	487,334,400	
ヤマシタヘルスケアH L D G S	5,600	1,640.00	9,184,000	
三菱倉庫	17,700	2,995.00	53,011,500	
三井倉庫H O L D	37,000	372.00	13,764,000	
住友倉庫	36,000	813.00	29,268,000	
渋沢倉庫	6,700	2,030.00	13,601,000	
ヤマタネ	5,600	2,297.00	12,863,200	
東陽倉庫	29,200	334.00	9,752,800	
日本トランスシティ	19,000	493.00	9,367,000	
東洋埠頭	6,200	1,832.00	11,358,400	
上 組	33,000	2,556.00	84,348,000	
キューソー流通システム	2,200	3,120.00	6,864,000	貸付株式数 600株
近鉄エクスプレス	10,100	2,342.00	23,654,200	
内外トランスライン	5,500	1,992.00	10,956,000	貸付株式数 1,500株
東京放送H D	33,000	2,794.00	92,202,000	貸付株式数 9,200株
日本テレビH L D S	49,500	2,008.00	99,396,000	貸付株式数 2,300株
テレビ朝日H D	14,900	2,325.00	34,642,500	貸付株式数 4,100株
スカパーJ S A T H D	40,700	502.00	20,431,400	
テレビ東京H D	4,900	2,443.00	11,970,700	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本B S 放送	5,500	1,267.00	6,968,500	
ワイヤレスゲート	4,600	1,351.00	6,214,600	貸付株式数 1,300株 (800株)
コネクシオ	4,000	2,416.00	9,664,000	
日本通信	64,700	114.00	7,375,800	貸付株式数 18,100株 (1,000株)
日本電信電話	389,800	5,375.00	2,095,175,000	
K D D I	489,400	2,890.50	1,414,610,700	
光通信	6,700	16,110.00	107,937,000	
N T T ドコモ	402,300	2,687.50	1,081,181,250	

エムティーアイ	10,200	645.00	6,579,000	貸付株式数	100株
GMOインターネット	20,600	2,135.00	43,981,000	貸付株式数	5,800株
カドカワ	16,200	1,395.00	22,599,000	貸付株式数	4,400株
ゼンリン	6,800	3,750.00	25,500,000		
東京電力HD	440,100	447.00	196,724,700		
中部電力	168,900	1,379.00	232,913,100		
関西電力	226,500	1,405.00	318,232,500		
中国電力	74,800	1,207.00	90,283,600	貸付株式数	21,600株
北陸電力	53,900	936.00	50,450,400	貸付株式数	14,500株
東北電力	129,400	1,454.00	188,147,600		
四国電力	49,500	1,275.00	63,112,500		
九州電力	121,700	1,195.00	145,431,500		
北海道電力	54,900	763.00	41,888,700		
沖縄電力	9,100	2,828.00	25,734,800		
電源開発	43,900	3,095.00	135,870,500		
イーレックス	9,300	1,067.00	9,923,100	貸付株式数	2,500株
東京瓦斯	118,200	2,598.50	307,142,700		
大阪瓦斯	107,000	2,214.50	236,951,500		
東邦瓦斯	27,300	3,095.00	84,493,500	貸付株式数	7,500株
北海道瓦斯	33,000	292.00	9,636,000	貸付株式数	5,000株
西部瓦斯	7,500	2,748.00	20,610,000		
静岡ガス	16,500	940.00	15,510,000		
メタウォーター	3,200	2,791.00	8,931,200	貸付株式数	800株 (800株)
松竹	3,600	19,210.00	69,156,000		
東宝	35,600	3,940.00	140,264,000		
エイチ・アイ・エス	8,400	4,030.00	33,852,000	貸付株式数	2,300株 (2,300株)
東映	2,000	11,680.00	23,360,000		
NTTデータ	171,300	1,352.00	231,597,600		
共立メンテナンス	9,500	4,645.00	44,127,500	貸付株式数	200株
イチネンホールディングス	7,500	1,596.00	11,970,000		
建設技術研究所	7,900	1,204.00	9,511,600		
アインホールディングス	7,800	7,370.00	57,486,000		
スバル興業	1,100	7,530.00	8,283,000		
東京テアトル	5,400	1,497.00	8,083,800		
よみうりランド	1,600	5,020.00	8,032,000		
東京都競馬	4,200	4,375.00	18,375,000		
常磐興産	6,500	1,881.00	12,226,500		
カナモト	8,200	3,460.00	28,372,000		

東京ドーム	22,400	1,131.00	25,334,400	
D T S	6,200	3,690.00	22,878,000	貸付株式数 2,000株
スクウェア・エニックス・HD	25,400	5,670.00	144,018,000	
シーイーシー	3,700	3,030.00	11,211,000	
カプコン	11,700	3,550.00	41,535,000	
西尾レントオール	4,600	3,640.00	16,744,000	
日本空港ビルデング	16,000	4,345.00	69,520,000	貸付株式数 4,400株
トランス・コスモス	5,900	2,789.00	16,455,100	
乃村工藝社	12,600	2,571.00	32,394,600	
ジャステック	6,000	1,275.00	7,650,000	
S C S K	13,300	5,320.00	70,756,000	
藤田観光	2,300	3,560.00	8,188,000	
K N T - C Tホールディングス	3,800	1,744.00	6,627,200	
日本管財	6,100	2,016.00	12,297,600	
トーカイ	2,700	4,985.00	13,459,500	
セコム	56,400	8,590.00	484,476,000	
セントラル警備保障	3,500	2,342.00	8,197,000	貸付株式数 900株 (100株)
アイネス	10,800	1,144.00	12,355,200	
丹青社	11,300	1,237.00	13,978,100	
メイテック	6,200	6,000.00	37,200,000	
T K C	5,300	4,115.00	21,809,500	
富士ソフト	7,600	3,600.00	27,360,000	
応用地質	6,700	1,486.00	9,956,200	
船井総研ホールディング	7,600	3,835.00	29,146,000	
N S D	9,100	2,350.00	21,385,000	
オ オ バ	18,800	511.00	9,606,800	
コナミホールディングス	22,400	6,560.00	146,944,000	
学 究 社	5,500	1,624.00	8,932,000	
ベネッセホールディングス	19,200	4,055.00	77,856,000	
イオンディライト	6,400	4,315.00	27,616,000	
ニチイ学館	10,500	1,476.00	15,498,000	
ダイセキ	9,400	3,075.00	28,905,000	
日鉄住金物産	4,100	6,070.00	24,887,000	
元気寿司	3,500	3,890.00	13,615,000	貸付株式数 800株 (100株)
トラスコ中山	11,500	3,290.00	37,835,000	貸付株式数 2,500株
ヤマダ電機	181,400	632.00	114,644,800	貸付株式数 50,700株

オートバックスセブン	21,100	2,140.00	45,154,000	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	9,500	1,919.00	18,230,500	
ニトリホールディングス	21,700	17,380.00	377,146,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
吉野家ホールディングス	18,000	1,918.00	34,524,000	貸付株式数 5,700株
加藤産業	8,500	4,085.00	34,722,500	
イノテック	7,200	1,065.00	7,668,000	
イエローハット	5,300	3,305.00	17,516,500	
松屋フーズ	2,900	4,130.00	11,977,000	
J B C Cホールディングス	10,600	1,157.00	12,264,200	
サガミチェーン	10,900	1,412.00	15,390,800	貸付株式数 3,000株 (2,300株)
日 伝	5,300	2,306.00	12,221,800	
関西スーパーマーケット	5,300	1,234.00	6,540,200	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ミロク情報サービス	5,100	3,015.00	15,376,500	
北沢産業	33,100	293.00	9,698,300	
因幡電機産業	6,800	5,080.00	34,544,000	
王将フードサービス	3,900	5,200.00	20,280,000	
ブレナス	6,200	2,423.00	15,022,600	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,600	2,449.00	11,265,400	
アークス	9,900	2,648.00	26,215,200	
パローホールディングス	12,500	2,615.00	32,687,500	
バイテックホールディングス	3,800	1,794.00	6,817,200	
ミスミグループ本社	63,300	3,240.00	205,092,000	
ベルク	2,700	6,600.00	17,820,000	
ファーストリテイリング	9,100	44,950.00	409,045,000	貸付株式数 2,500株
ソフトバンクグループ	246,200	9,080.00	2,235,496,000	
スズケン	24,600	4,590.00	112,914,000	
サンドラッグ	23,200	5,330.00	123,656,000	
サクスパーホールディング	6,000	1,360.00	8,160,000	貸付株式数 1,800株
ジェコス	5,100	1,394.00	7,109,400	
ベルーナ	14,200	1,362.00	19,340,400	
合計			143,644,364,120	

(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。

「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12月19日現在	平成29年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	340,203,687	405,471,667
コール・ローン	153,142,293	189,200,610
株式	81,261,530,570	92,687,655,335
投資証券	2,095,626,412	2,529,090,313
派生商品評価勘定	822,838	13,640,211
未収入金	132,605,697	1,128,731
未収配当金	105,370,223	123,218,810
差入委託証拠金	582,058,178	752,492,066
流動資産合計	84,671,359,898	96,701,897,743
資産合計	84,671,359,898	96,701,897,743
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	78,064	498,240
未払解約金	227,130,000	72,256,900
流動負債合計	227,208,064	72,755,140

負債合計		227,208,064	72,755,140
純資産の部			
元本等			
元本	1	40,367,016,462	39,738,227,827
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		44,077,135,372	56,890,914,776
元本等合計		84,444,151,834	96,629,142,603
純資産合計		84,444,151,834	96,629,142,603
負債純資産合計		84,671,359,898	96,701,897,743

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20日 至 平成29年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	38,798,220,086円	40,367,016,462円
期中追加設定元本額	5,148,416,668円	5,794,523,705円
期中一部解約元本額	3,579,620,292円	6,423,312,340円
期末元本額の内訳 ファンド名		

ダイワ外国株式インデックス V A	713,025,920円	561,940,757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)	453,992,902円	270,075,076円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	43,993,709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)	1,490,582,674円	888,111,878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)	118,469,160円	413,513,055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)	218,819,187円	927,597,200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	311,112,761円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,689,699円	1,828,241円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	182,021円	175,432円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	207,132,402円	392,436,479円
i F r e e 8資産バランス	53,397,250円	294,049,882円
DCダイワ外国株式インデッ クス	22,403,108,724円	24,119,249,594円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	544,438,422円	497,058,709円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	725,810,195円	709,194,443円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	538,721,875円	561,812,076円
大和DC海外株式インデック スファンド	1,464,751,026円	1,434,214,433円

DC ダイワ・ターゲットイ ヤー2020	7,245,662円	5,218,402円
DC ダイワ・ターゲットイ ヤー2030	14,997,798円	14,136,612円
DC ダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,621,406円	3,584,603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	150,605,980円	7,922,722円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,943,779,185円	485,331,409円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	521,063,437円	393,970,223円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	4,894,517,852円	3,763,739,239円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	227,433,106円	176,212,362円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	391,241,366円	502,490,994円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	23,106,461円	44,779,107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	464,604円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	3,000,082,219円	2,754,344,985円
ダイワライフスタイル25	23,116,958円	20,386,271円
ダイワライフスタイル50	77,484,135円	71,290,918円
ダイワライフスタイル75	58,775,327円	58,347,487円
計	40,367,016,462円	39,738,227,827円
2. 期末日における受益権の総数	40,367,016,462口	39,738,227,827口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	<p>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。</p> <p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等</p>

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12月19日現在	平成29年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	2,314,032,757	1,137,078,677
投資証券	26,449,973	15,405,148
合計	2,340,482,730	1,152,483,825

（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12月1日から平成28年12月19日まで、及び平成29年12月1日から平成29年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	平成28年12月19日 現在				平成29年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,060,857,918	-	1,061,163,756	305,838	1,377,511,961	-	1,391,142,672	13,630,711
合計	1,060,857,918	-	1,061,163,756	305,838	1,377,511,961	-	1,391,142,672	13,630,711

（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12月19日 現在				平成29年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	135,974,736	-	135,535,800	438,936	-	-	-	-
アメリカ・ドル	111,079,800	-	110,562,800	517,000	-	-	-	-
イギリス・ポンド	24,894,936	-	24,973,000	78,064	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	124,227,740	-	123,739,000	488,740
アメリカ・ドル	-	-	-	-	124,227,740	-	123,739,000	488,740
合計	135,974,736	-	135,535,800	438,936	124,227,740	-	123,739,000	488,740

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0919円 (20,919円)	2.4316円 (24,316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 SOLUTION	2,700	90.030	243,081.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,100	147.260	309,246.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,350	135.530	182,965.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	18,800	37.190	699,172.000	
	ABBOTT LABORATORIES	39,616	55.500	2,198,688.000	
	ARCONIC INC	8,933	25.300	226,004.900	
	VERISK ANALYTICS INC	3,500	95.000	332,500.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	9,200	70.500	648,600.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	6,950	89.130	619,453.500	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,579	94.830	718,716.570	
	QORVO INC	2,900	65.530	190,037.000	
	AFLAC INC	9,200	89.260	821,192.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	2,750	88.410	243,127.500	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3,500	42.630	149,205.000	
	ADOBE SYSTEMS INC	11,350	177.510	2,014,738.500	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,500	41.090	225,995.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,500	75.820	189,550.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	8,000	18.810	150,480.000	
	GARMIN LTD	2,900	58.360	169,244.000	
	AETNA INC	7,579	179.700	1,361,946.300	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,050	160.420	810,121.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16,500	154.250	2,545,125.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,751	77.810	291,865.310		
WR BERKLEY CORP	2,300	71.240	163,852.000		
AUTOZONE INC	630	697.060	439,147.800		
DOLLAR TREE INC	5,321	106.290	565,569.090		

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,900	18.610	388,949.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,650	89.540	237,281.000	
CELANESE CORP-SERIES A	3,300	106.540	351,582.000	
DR HORTON INC	8,316	50.580	420,623.280	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,100	47.200	99,120.000	
DENTSPLY SIRONA INC	5,200	66.480	345,696.000	
AUTODESK INC	4,550	108.400	493,220.000	
MOODY'S CORP	4,000	150.570	602,280.000	
DEVON ENERGY CORP	11,750	37.680	442,740.000	
ALBEMARLE CORP	2,600	129.570	336,882.000	
ATMOS ENERGY CORP	2,500	89.370	223,425.000	
ALLIANT ENERGY CORP	5,400	44.430	239,922.000	
CITIGROUP INC	62,823	74.770	4,697,275.710	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,300	118.190	1,217,357.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	11,400	76.540	872,556.000	
ALLEGHANY CORP	350	577.240	202,034.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	185.040	203,544.000	
HESS CORP	6,500	43.400	282,100.000	
DAVITA INC	3,500	70.520	246,820.000	
DANAHER CORP	14,200	94.000	1,334,800.000	
FORTIVE CORP	7,200	72.060	518,832.000	
AVNET INC	2,800	39.060	109,368.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	13,500	70.490	951,615.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,000	15.170	60,680.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,028	13.620	54,861.360	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,900	40.560	523,224.000	
BUNGE LTD	3,100	67.690	209,839.000	
TE CONNECTIVITY LTD	8,225	96.220	791,409.500	
APPLE INC	118,900	173.970	20,685,033.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8,600	74.590	641,474.000	
BOEING CO/THE	13,050	293.940	3,835,917.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,465	74.280	257,380.200	
BECTON DICKINSON AND CO	5,187	221.460	1,148,713.020	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,000	27.050	162,300.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,300	64.600	213,180.000	
CDK GLOBAL INC	2,900	70.760	205,204.000	
NISOURCE INC	7,300	26.510	193,523.000	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,350	86.210	288,803.500	
CR BARD INC	1,680	334.500	561,960.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	23,671	54.200	1,282,968.200	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	93,404	52.670	4,919,588.680	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	29,050	197.780	5,745,509.000	
ANSYS INC	1,900	148.030	281,257.000	
H&R BLOCK INC	5,100	27.200	138,720.000	
BB&T CORP	18,750	49.530	928,687.500	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	37,850	62.410	2,362,218.500	
JPMORGAN CHASE & CO	81,320	106.140	8,631,304.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	5,600	102.570	574,392.000	
CIGNA CORP	5,900	204.140	1,204,426.000	
LKQ CORP	7,200	39.510	284,472.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,000	127.600	127,600.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,550	66.620	303,121.000	
CADENCE DESIGN SYS INC	6,400	43.680	279,552.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,460	167.930	581,037.800	
DOLLAR GENERAL CORP	6,200	90.930	563,766.000	
SERVICENOW INC	3,950	129.500	511,525.000	
CATERPILLAR INC	13,500	146.690	1,980,315.000	
CMS ENERGY CORP	6,400	49.250	315,200.000	
MOSAIC CO/THE	7,550	24.920	188,146.000	
DELTA AIR LINES INC	4,400	56.100	246,840.000	
CORNING INC	21,300	32.050	682,665.000	
CISCO SYSTEMS INC	114,100	38.190	4,357,479.000	
MORGAN STANLEY	31,800	53.100	1,688,580.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,250	140.400	175,500.000	
MSCI INC	2,150	127.930	275,049.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	900	204.670	184,203.000	
MIDDLEBY CORP	1,300	130.790	170,027.000	
COTY INC-CL A	11,139	19.780	220,329.420	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,100	41.000	168,100.000	
BROADCOM LTD	9,152	265.730	2,431,960.960	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,050	137.410	144,280.500	
ACUITY BRANDS INC	1,000	165.830	165,830.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,000	125.590	251,180.000	
ARAMARK	5,850	42.460	248,391.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,900	31.000	151,900.000	

DTE ENERGY COMPANY	4,150	113.230	469,904.500	
CENTENE CORP	4,000	94.860	379,440.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,400	126.370	303,288.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	11,600	41.700	483,720.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,050	63.980	259,119.000	
GARTNER INC	2,100	122.510	257,271.000	
SPLUNK INC	3,200	82.460	263,872.000	
AGCO CORP	1,450	74.390	107,865.500	
DOMINION ENERGY INC	14,300	84.910	1,214,213.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,300	64.010	595,293.000	
SMITH (A.O.) CORP	3,400	60.730	206,482.000	
DEERE & CO	6,150	150.870	927,850.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,600	100.830	362,988.000	
TIME WARNER INC	17,633	90.250	1,591,378.250	
VMWARE INC-CLASS A	1,650	123.800	204,270.000	
CHEMOURS CO/THE	4,500	48.040	216,180.000	
NASDAQ INC	2,700	77.510	209,277.000	
VAIL RESORTS INC	950	219.840	208,848.000	
EAST WEST BANCORP INC	3,400	60.690	206,346.000	
TARGA RESOURCES CORP	5,050	46.360	234,118.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,500	156.570	234,855.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,800	104.340	187,812.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	7,000	88.240	617,680.000	
COGNEX CORP	4,200	60.970	256,074.000	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,400	112.610	270,264.000	
TELEFLEX INC	1,000	252.170	252,170.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,100	112.370	235,977.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,500	55.980	139,950.000	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	1,750	64.890	113,557.500	
IDEX CORP	1,800	131.200	236,160.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	19,150	74.050	1,418,057.500	
ROLLINS INC	2,200	46.820	103,004.000	
AMETEK INC	5,225	71.220	372,124.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,800	49.060	284,548.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,200	43.580	139,456.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,950	106.030	842,938.500	

COSTCO WHOLESALE CORP	10,050	192.730	1,936,936.500	
SCANA CORP	3,100	44.420	137,702.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,350	198.640	268,164.000	
WR GRACE & CO	1,600	71.150	113,840.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	600	312.120	187,272.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,600	25.670	195,092.000	
UGI CORP	3,900	47.930	186,927.000	
CUMMINS INC	3,700	169.630	627,631.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	16,300	66.730	1,087,699.000	
SABRE CORP	4,600	20.420	93,932.000	
CDW CORP/DE	3,750	68.450	256,687.500	
SIGNATURE BANK	1,300	135.070	175,591.000	
COSTAR GROUP INC	850	294.860	250,631.000	
SVB FINANCIAL GROUP	1,200	237.550	285,060.000	
AMERCO	170	377.680	64,205.600	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,500	129.430	194,145.000	
MERCADOLIBRE INC	1,000	318.910	318,910.000	
HANESBRANDS INC	8,500	21.460	182,410.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,800	118.240	212,832.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,566	77.090	351,992.940	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,600	37.720	173,512.000	
IPG PHOTONICS CORP	900	208.060	187,254.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,050	109.520	224,516.000	
SEATTLE GENETICS INC	2,250	52.550	118,237.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,770	233.550	413,383.500	
TRANSDIGM GROUP INC	1,200	276.550	331,860.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	8,000	37.220	297,760.000	
KINDER MORGAN INC	46,081	17.930	826,232.330	
HCA HEALTHCARE INC	6,800	88.460	601,528.000	
CABOT OIL & GAS CORP	10,550	26.640	281,052.000	
T-MOBILE US INC	6,850	62.660	429,221.000	
ZILLOW GROUP INC - C	2,500	41.220	103,050.000	
COCA-COLA CO/THE	92,950	46.190	4,293,360.500	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,300	39.190	207,707.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,000	64.440	257,760.000	
EATON VANCE CORP	2,500	55.980	139,950.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	7,600	43.460	330,296.000	
CSX CORP	20,950	52.930	1,108,883.500	

FLUOR CORP	3,300	50.450	166,485.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,350	159.060	373,791.000	
EXPEDIA INC	2,875	120.880	347,530.000	
AUTOLIV INC	2,000	126.030	252,060.000	
AMAZON.COM INC	9,300	1,179.140	10,966,002.000	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	5,000	25.900	129,500.000	
FLOWSERVE CORP	2,900	41.150	119,335.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,900	114.220	559,678.000	
EXXON MOBIL CORP	97,105	83.030	8,062,628.150	
FLIR SYSTEMS INC	3,100	47.380	146,878.000	
AES CORP	15,600	10.800	168,480.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	1,800	195.050	351,090.000	
EVEREST RE GROUP LTD	900	222.110	199,899.000	
EOG RESOURCES INC	13,250	98.550	1,305,787.500	
EQT CORP	5,850	54.710	320,053.500	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	3,900	57.760	225,264.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,800	93.170	354,046.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,290	67.610	492,876.900	
FORD MOTOR CO	85,323	12.580	1,073,363.340	
TESARO INC	900	80.580	72,522.000	
MACY'S INC	6,898	24.590	169,621.820	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,440	21.040	72,377.600	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	32.560	159,120.720	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,120	19.750	101,120.000	
AERCAP HOLDINGS NV	3,800	52.670	200,146.000	
FORTINET INC	3,500	43.640	152,740.000	
MARKEL CORP	320	1,147.100	367,072.000	
NEXTERA ENERGY INC	10,700	158.430	1,695,201.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	31,808	16.980	540,099.840	
US BANCORP	38,700	54.500	2,109,150.000	
UNITED RENTALS INC	1,900	164.290	312,151.000	
F5 NETWORKS INC	1,450	131.060	190,037.000	
FASTENAL CO	6,500	53.280	346,320.000	
FISERV INC	4,950	131.960	653,202.000	
GENERAL ELECTRIC CO	199,100	17.820	3,547,962.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4,350	54.000	234,900.000	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,650	31.460	177,749.000	

GENERAL MOTORS CO	31,100	40.950	1,273,545.000	
TRIPADVISOR INC	2,750	35.030	96,332.500	
GENERAL DYNAMICS CORP	5,900	198.840	1,173,156.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,160	257.170	2,098,507.200	
ALPHABET INC-CL A	6,810	1,072.000	7,300,320.000	
ALPHABET INC-CL C	7,147	1,064.190	7,605,765.930	
OWENS CORNING	2,700	87.340	235,818.000	
GENERAL MILLS INC	13,000	56.890	739,570.000	
FIRSTENERGY CORP	9,968	31.830	317,281.440	
GENUINE PARTS CO	3,500	91.980	321,930.000	
IHS MARKIT LTD	9,534	45.530	434,083.020	
FIFTH THIRD BANCORP	17,500	30.030	525,525.000	
HARRIS CORP	2,750	144.090	396,247.500	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	51.060	153,180.000	
HALLIBURTON CO	19,850	44.610	885,508.500	
HOME DEPOT INC	27,350	182.580	4,993,563.000	
ASSURANT INC	1,250	98.310	122,887.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,600	14.580	358,668.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,100	238.830	262,713.000	
HERSHEY CO/THE	3,300	114.140	376,662.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,000	50.460	201,840.000	
HUMANA INC	3,300	253.640	837,012.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,200	116.350	954,070.000	
HELMERICH & PAYNE	2,600	57.780	150,228.000	
HENRY SCHEIN INC	3,600	70.160	252,576.000	
HP INC	38,900	20.920	813,788.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	37,700	14.410	543,257.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,000	39.720	158,880.000	
HOLLYFRONTIER CORP	3,900	47.860	186,654.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	4,900	35.330	173,117.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,100	39.790	83,559.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,900	92.010	266,829.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	13,853	79.540	1,101,867.620	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,450	152.500	3,118,625.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	9,100	56.250	511,875.000	

FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,600	66.420	239,112.000	
ZOETIS INC	11,400	71.960	820,344.000	
INGERSOLL-RAND PLC	5,779	86.750	501,328.250	
CHENIERE ENERGY INC	4,700	49.600	233,120.000	
ALLEGION PLC	2,200	82.280	181,016.000	
LEGGETT & PLATT INC	3,100	46.780	145,018.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	13,023	31.650	412,177.950	
WASTE CONNECTIONS INC	6,157	70.400	433,452.800	
JUNIPER NETWORKS INC	8,900	28.400	252,760.000	
JM SMUCKER CO/THE	2,720	119.440	324,876.800	
JOHNSON & JOHNSON	61,400	142.460	8,747,044.000	
ABBVIE INC	36,429	97.450	3,550,006.050	
HOLOGIC INC	6,550	43.530	285,121.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	8,150	118.510	965,856.500	
KROGER CO	20,600	26.450	544,870.000	
KLA-TENCOR CORP	3,650	105.630	385,549.500	
LOCKHEED MARTIN CORP	6,000	322.820	1,936,920.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,100	190.110	399,231.000	
L BRANDS INC	5,600	58.110	325,416.000	
LOWE'S COS INC	19,700	86.690	1,707,793.000	
ELI LILLY & CO	22,550	86.540	1,951,477.000	
LAM RESEARCH CORP	3,700	186.320	689,384.000	
RANGE RESOURCES CORP	5,700	15.630	89,091.000	
JONES LANG LASALLE INC	1,000	148.480	148,480.000	
LOEWS CORP	6,500	49.750	323,375.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,149	76.190	392,302.310	
MCDONALD'S CORP	18,550	174.060	3,228,813.000	
3M CO	13,700	238.000	3,260,600.000	
FACEBOOK INC-A	54,150	180.180	9,756,747.000	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,804	80.990	389,075.960	
MANPOWERGROUP INC	1,500	124.820	187,230.000	
S&P GLOBAL INC	5,950	169.050	1,005,847.500	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,400	204.440	286,216.000	
CONCHO RESOURCES INC	3,450	136.400	470,580.000	
ENVISION HEALTHCARE CORP	2,636	34.300	90,414.800	
FIRST DATA CORP- CLASS A	10,300	16.480	169,744.000	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	4,300	36.560	157,208.000	
PHILLIPS 66	9,950	99.920	994,204.000	

TECHNIPFMC PLC	10,000	27.430	274,300.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	10,750	32.880	353,460.000	
MATTEL INC	7,800	15.480	120,744.000	
DXC TECHNOLOGY CO	6,538	95.250	622,744.500	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,650	101.430	268,789.500	
MYLAN NV	10,450	40.520	423,434.000	
METLIFE INC	20,850	51.410	1,071,898.500	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,100	21.620	196,742.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,100	231.030	254,133.000	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,500	50.740	126,850.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,828	93.150	356,578.200	
MONSANTO CO	10,056	117.350	1,180,071.600	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	639.940	383,964.000	
BAKER HUGHES A GE CO	9,173	30.260	277,574.980	
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,950	190.930	563,243.500	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1,940	58.450	113,393.000	
MERCK & CO. INC.	62,771	56.240	3,530,241.040	
DOWDUPONT INC	53,505	70.000	3,745,350.000	
MASCO CORP	7,400	42.310	313,094.000	
M & T BANK CORP	3,169	170.900	541,582.100	
MARSH & MCLENNAN COS	11,750	83.110	976,542.500	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,472	129.820	970,015.040	
WORKDAY INC-CLASS A	2,950	103.470	305,236.500	
SQUARE INC - A	6,000	37.030	222,180.000	
TRANSUNION	3,800	55.460	210,748.000	
VISTRA ENERGY CORP	6,200	17.310	107,322.000	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,550	61.650	218,857.500	
DELPHI TECHNOLOGIES PLC	2,066	50.950	105,262.700	
VANTIV INC - CL A	3,850	75.870	292,099.500	
NETAPP INC	6,150	57.270	352,210.500	
NIKE INC -CL B	30,050	64.790	1,946,939.500	
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,700	141.110	945,437.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,350	86.750	464,112.500	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,000	88.240	264,720.000	
ALLY FINANCIAL INC	10,200	28.700	292,740.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,830	310.470	1,189,100.100	

APTIV PLC	6,200	84.400	523,280.000	
NEWMONT MINING CORP	12,000	35.870	430,440.000	
MCKESSON CORP	4,900	162.600	796,740.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,400	52.460	335,744.000	
XYLEM INC	4,200	67.570	283,794.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	35,600	109.680	3,904,608.000	
NUCOR CORP	7,400	60.110	444,814.000	
WESTERN UNION CO	11,346	19.480	221,020.080	
NEWELL BRANDS INC	10,892	30.590	333,186.280	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,400	70.620	1,228,788.000	
LIBERTY BROADBAND-C	2,550	83.730	213,511.500	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	600	109.720	65,832.000	
PAYCHEX INC	7,550	69.770	526,763.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,120	240.200	509,224.000	
ALTRIA GROUP INC	44,250	71.670	3,171,397.500	
P G & E CORP	11,600	53.050	615,380.000	
PFIZER INC	136,363	37.200	5,072,703.600	
ALKERMES PLC	3,600	52.620	189,432.000	
XCEL ENERGY INC	11,500	50.780	583,970.000	
STRYKER CORP	7,650	154.250	1,180,012.500	
PARKER HANNIFIN CORP	3,050	194.260	592,493.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,900	155.830	607,737.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,400	125.120	175,168.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	58,617	91.890	5,386,316.130	
EXELON CORP	21,222	40.740	864,584.280	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,100	115.760	590,376.000	
NVR INC	80	3,398.630	271,890.400	
CONOCOPHILLIPS	28,250	52.170	1,473,802.500	
PEPSICO INC	32,600	119.220	3,886,572.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,900	115.730	1,145,727.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,050	90.820	367,821.000	
ACCENTURE PLC-CL A	14,200	152.660	2,167,772.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,950	50.580	98,631.000	
PENTAIR PLC	4,005	68.170	273,020.850	
QUALCOMM INC	33,600	64.760	2,175,936.000	
INVESCO LTD	9,150	36.560	334,524.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,700	100.700	171,190.000	

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,600	70.370	464,442.000	
RAYTHEON COMPANY	6,700	191.380	1,282,246.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,050	83.210	170,580.500	
RED HAT INC	4,000	128.780	515,120.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,810	388.950	703,999.500	
REPUBLIC SERVICES INC	5,350	66.090	353,581.500	
PRICELINE GROUP INC/THE	1,120	1,760.000	1,971,200.000	
ROSS STORES INC	9,000	75.960	683,640.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,100	115.270	242,067.000	
RESMED INC	3,250	85.290	277,192.500	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,100	98.990	306,869.000	
ROBERT HALF INTL INC	2,800	55.260	154,728.000	
RALPH LAUREN CORP	1,300	96.110	124,943.000	
AUTONATION INC	1,700	52.570	89,369.000	
ROCKWELL COLLINS INC	3,663	134.530	492,783.390	
REGIONS FINANCIAL CORP	27,435	17.120	469,687.200	
CHEVRON CORP	43,218	119.730	5,174,491.140	
EDISON INTERNATIONAL	7,500	69.710	522,825.000	
TESLA INC	3,040	343.450	1,044,088.000	
SYMANTEC CORP	13,900	28.980	402,822.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,472	165.710	575,345.120	
SYNOPSIS INC	3,400	87.860	298,724.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,905	322.310	1,580,930.550	
CBRE GROUP INC - A	7,100	43.250	307,075.000	
TWITTER INC	14,400	22.230	320,112.000	
SOUTHERN CO/THE	22,550	51.310	1,157,040.500	
SYSCO CORP	11,800	60.950	719,210.000	
TRAVELERS COS INC/THE	6,473	134.890	873,142.970	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,200	71.580	229,056.000	
STERICYCLE INC	1,950	66.880	130,416.000	
STEEL DYNAMICS INC	5,700	39.850	227,145.000	
SCHLUMBERGER LTD	31,652	62.090	1,965,272.680	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,900	52.420	204,438.000	
AT&T INC	140,291	38.240	5,364,727.840	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	64.700	219,980.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,930	403.820	779,372.600	
SEMPRA ENERGY	5,400	116.530	629,262.000	

TIFFANY & CO	2,800	101.340	283,752.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,100	42.020	298,342.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	22,750	101.220	2,302,755.000	
SALESFORCE.COM INC	15,450	105.480	1,629,666.000	
WESTROCK CO	5,930	63.110	374,242.300	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	21,584	37.260	804,219.840	
ANDEAVOR	3,450	111.550	384,847.500	
UNION PACIFIC CORP	18,600	130.600	2,429,160.000	
MARATHON OIL CORP	19,000	15.010	285,190.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	11,900	65.750	782,425.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,450	126.170	2,201,666.500	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,700	118.000	1,852,600.000	
UNUM GROUP	5,400	54.030	291,762.000	
SPRINT CORP	17,765	5.490	97,529.850	
ANTERO RESOURCES CORP	5,100	17.650	90,015.000	
IQVIA HOLDINGS INC	3,194	102.060	325,979.640	
VOYA FINANCIAL INC	4,500	45.570	205,065.000	
AMEREN CORPORATION	5,500	60.940	335,170.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	22,076	221.820	4,896,898.320	
VERISIGN INC	2,200	115.030	253,066.000	
VALERO ENERGY CORP	10,342	88.190	912,060.980	
ULTA BEAUTY INC	1,310	218.250	285,907.500	
FNF GROUP	5,738	39.520	226,765.760	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,000	113.440	226,880.000	
ANTHEM INC	6,050	226.210	1,368,570.500	
WALT DISNEY CO/THE	35,850	111.270	3,989,029.500	
WELLS FARGO & CO	108,472	59.870	6,494,218.640	
WASTE MANAGEMENT INC	10,000	85.870	858,700.000	
WILLIAMS COS INC	18,700	29.730	555,951.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,100	68.420	212,102.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	164.490	279,633.000	
WAL-MART STORES INC	34,650	97.110	3,364,861.500	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	85.390	247,631.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,600	115.240	530,104.000	
WYNN RESORTS LTD	1,950	166.030	323,758.500	
XEROX CORP	4,811	29.650	142,646.150	
WABTEC CORP	1,900	76.670	145,673.000	

TJX COMPANIES INC	14,850	74.170	1,101,424.500	
WATERS CORP	1,800	196.560	353,808.000	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,800	63.760	114,768.000	
ALLERGAN PLC	7,657	171.680	1,314,553.760	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,100	71.940	1,517,934.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,983	156.000	465,348.000	
WESTERN DIGITAL CORP	6,750	81.620	550,935.000	
WEC ENERGY GROUP INC	7,130	68.170	486,052.100	
WESTAR ENERGY INC	3,200	55.080	176,256.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,750	52.300	614,525.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	42,300	113.820	4,814,586.000	
PPL CORP	15,400	33.970	523,138.000	
PULTEGROUP INC	6,700	33.430	223,981.000	
PPG INDUSTRIES INC	5,950	115.090	684,785.500	
NORTHERN TRUST CORP	4,900	97.850	479,465.000	
NVIDIA CORP	13,650	191.560	2,614,794.000	
IAC/INTERACTIVECORP	1,800	121.440	218,592.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,093	144.950	1,607,930.350	
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q- A	9,550	24.820	237,031.000	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4,700	38.390	180,433.000	
TYSON FOODS INC-CL A	6,500	81.280	528,320.000	
NETFLIX INC	9,900	190.120	1,882,188.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,950	192.270	1,720,816.500	
TORCHMARK CORP	2,675	89.610	239,706.750	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,700	87.570	324,009.000	
TEXTRON INC	6,350	55.220	350,647.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	23,950	34.990	838,010.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,300	34.220	352,466.000	
NEWS CORP - CLASS A	8,337	16.020	133,558.740	
OGE ENERGY CORP	4,700	34.150	160,505.000	
OMNICOM GROUP	5,400	74.410	401,814.000	
ORACLE CORP	70,733	48.300	3,416,403.900	
MASTERCARD INC - A	21,750	153.400	3,336,450.000	
ONEOK INC	8,800	52.160	459,008.000	

CENTURYLINK INC	22,652	16.990	384,857.480	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,300	252.620	581,026.000	
YUM! BRANDS INC	7,500	82.300	617,250.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,500	111.190	277,975.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,150	239.810	275,781.500	
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,350	79.800	347,130.000	
NOBLE ENERGY INC	10,900	25.660	279,694.000	
BANK OF AMERICA CORP	228,001	29.040	6,621,149.040	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,100	93.020	381,382.000	
NORDSTROM INC	3,000	45.490	136,470.000	
AMERICAN EXPRESS CO	17,350	98.520	1,709,322.000	
ANALOG DEVICES INC	8,299	86.690	719,440.310	
ADVANCED MICRO DEVICES	18,000	10.290	185,220.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	6,000	51.980	311,880.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	21,022	59.390	1,248,496.580	
ANADARKO PETROLEUM CORP	12,700	47.520	603,504.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,150	94.630	392,714.500	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,000	125.090	500,360.000	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,500	27.810	125,145.000	
AVERY DENNISON CORP	2,100	115.910	243,411.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,600	72.080	980,288.000	
EMERSON ELECTRIC CO	14,900	67.260	1,002,174.000	
AON PLC	6,000	138.390	830,340.000	
AMGEN INC	16,850	177.040	2,983,124.000	
TAPESTRY INC	6,400	42.830	274,112.000	
EATON CORP PLC	10,136	77.290	783,411.440	
CELGENE CORP	17,800	109.410	1,947,498.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,880	224.440	870,827.200	
APPLIED MATERIALS INC	24,500	52.540	1,287,230.000	
CIT GROUP INC	3,300	49.780	164,274.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,250	112.330	252,742.500	
CME GROUP INC	7,800	151.070	1,178,346.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,844	33.060	292,382.640	
ECOLAB INC	5,900	135.190	797,621.000	
EQUIFAX INC	2,750	119.510	328,652.500	
GAP INC/THE	5,800	33.560	194,648.000	
GILEAD SCIENCES INC	30,000	75.570	2,267,100.000	

DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,148	93.920	389,580.160	
HORMEL FOODS CORP	6,850	36.790	252,011.500	
STATE STREET CORP	8,743	98.530	861,447.790	
SUNTRUST BANKS INC	11,198	65.000	727,870.000	
SCHWAB (CHARLES) CORP	27,700	51.280	1,420,456.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,350	65.330	741,495.500	
CAMPBELL SOUP CO	4,100	49.590	203,319.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,100	57.860	179,366.000	
CARDINAL HEALTH INC	7,150	63.190	451,808.500	
FEDEX CORP	5,850	240.050	1,404,292.500	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,954	96.310	1,054,979.740	
FMC CORP	3,150	92.200	290,430.000	
FLEX LTD	12,200	17.980	219,356.000	
CERNER CORP	6,700	69.420	465,114.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,800	154.170	277,506.000	
CITRIX SYSTEMS INC	3,500	87.530	306,355.000	
INTEL CORP	107,900	44.560	4,808,024.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,800	20.460	180,048.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,250	55.750	459,937.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	7,050	165.170	1,164,448.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,500	5.370	206,745.000	
ILLUMINA INC	3,350	216.550	725,442.500	
SEALED AIR CORP	4,400	48.680	214,192.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,520	369.870	932,072.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,900	107.220	310,938.000	
SNAP-ON INC	1,300	168.200	218,660.000	
CARMAX INC	4,250	67.730	287,852.500	
COMERICA INC	4,000	85.290	341,160.000	
INGREDION INC	1,600	141.120	225,792.000	
DUKE ENERGY CORP	16,078	87.840	1,412,291.520	
TARGET CORP	11,950	62.610	748,189.500	
DOVER CORP	3,500	97.480	341,180.000	
WW GRAINGER INC	1,300	229.970	298,961.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,900	66.190	191,951.000	
CINTAS CORP	2,100	158.000	331,800.000	
CA INC	7,105	33.710	239,509.550	
CONAGRA BRANDS INC	9,500	37.760	358,720.000	

CLOROX COMPANY	2,950	147.630	435,508.500	
ENERGY CORP	4,200	83.800	351,960.000	
MICROSOFT CORP	167,550	86.850	14,551,717.500	
INCYTE CORP	4,050	96.410	390,460.500	
CVS HEALTH CORP	23,174	73.080	1,693,555.920	
MEDTRONIC PLC	31,438	83.500	2,625,073.000	
MICRON TECHNOLOGY INC	24,100	42.400	1,021,840.000	
BLACKROCK INC	2,750	511.870	1,407,642.500	
CENTERPOINT ENERGY INC	9,100	28.800	262,080.000	
HASBRO INC	2,600	94.070	244,582.000	
KELLOGG CO	6,100	64.990	396,439.000	
KEYCORP	24,700	19.760	488,072.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,400	110.960	266,304.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	35,011	43.380	1,518,777.180	
KOHL'S CORP	3,900	51.350	200,265.000	
COOPER COS INC/THE	1,100	229.300	252,230.000	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	11,100	13.120	145,632.000	
APACHE CORP	8,760	39.470	345,757.200	
CHUBB LTD	10,649	148.720	1,583,719.280	
ARROW ELECTRONICS INC	2,000	78.510	157,020.000	
ALLSTATE CORP	8,350	103.970	868,149.500	
EBAY INC	23,400	38.370	897,858.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	26,150	75.650	1,978,247.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	3,250	90.230	293,247.500	
XILINX INC	5,600	67.980	380,688.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	13,510	71.550	966,640.500	
DISH NETWORK CORP-A	5,300	48.570	257,421.000	
ZIONS BANCORPORATION	4,800	50.010	240,048.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,150	129.620	667,543.000	
TOLL BROTHERS INC	3,800	47.700	181,260.000	
TRIMBLE INC	5,900	40.670	239,953.000	
LENNAR CORP-A	4,800	61.400	294,720.000	
LEAR CORP	1,550	172.400	267,220.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	6,500	49.880	324,220.000	
PROGRESSIVE CORP	13,400	55.460	743,164.000	
PRAXAIR INC	6,500	149.600	972,400.000	
PACCAR INC	7,987	69.160	552,380.920	
PVH CORP	1,750	134.040	234,570.000	

	BIOGEN INC	4,880	327.940	1,600,347.200	
	IDEXX LABORATORIES INC	2,000	156.600	313,200.000	
	STARBUCKS CORP	33,100	58.290	1,929,399.000	
	PERRIGO CO PLC	3,050	86.500	263,825.000	
	EVERSOURCE ENERGY	7,130	64.620	460,740.600	
	INTUIT INC	5,600	159.650	894,040.000	
	BORGWARNER INC	4,800	51.530	247,344.000	
	BEST BUY CO INC	6,500	65.320	424,580.000	
	BALL CORP	7,584	39.400	298,809.600	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	31,047	25.780	800,391.660	
	XL GROUP LTD	6,100	36.250	221,125.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	7,100	109.280	775,888.000	
	VULCAN MATERIALS CO	3,050	120.820	368,501.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,650	145.860	824,109.000	
	VF CORP	7,750	74.410	576,677.500	
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	8,371	58.900	493,051.900	
	VIACOM INC-CLASS B	8,171	30.240	247,091.040	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,470	274.710	403,823.700	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,200	111.870	246,114.000	
	CARNIVAL CORP	8,050	65.950	530,897.500	
	COMCAST CORP-CLASS A	108,440	39.710	4,306,152.400	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	5,200	40.170	208,884.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,800	63.040	302,592.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	26,500	7.200	190,800.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 537,294,287.420 (60,585,303,849)	
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	3.610	58,843.000	
	TUI AG-DI	10,247	14.620	149,811.140	
	BP PLC	460,700	5.052	2,327,456.400	
	UNILEVER PLC	30,110	41.960	1,263,415.600	
	BARCLAYS PLC	395,500	2.022	799,898.750	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	38,400	8.310	319,104.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	38,100	3.038	115,747.800	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,150	69.550	149,532.500	
	PRUDENTIAL PLC	60,200	18.475	1,112,195.000	

ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	83,891	2.763	231,790.830	
JOHNSON MATTHEY PLC	4,564	30.390	138,699.960	
BAE SYSTEMS PLC	74,800	5.630	421,124.000	
AVIVA PLC	96,066	5.025	482,731.650	
GLAXOSMITHKLINE PLC	114,502	12.950	1,482,800.900	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	10,000	25.180	251,800.000	
WORLDPAY GROUP PLC	47,100	4.354	205,073.400	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	8,000	6.090	48,720.000	
AUTO TRADER GROUP PLC	22,400	3.470	77,728.000	
DCC PLC	2,000	72.300	144,600.000	
CONVATEC GROUP PLC	33,000	2.058	67,914.000	
ROYAL MAIL PLC	22,400	4.443	99,523.200	
RELX PLC	24,846	17.290	429,587.340	
DIAGEO PLC	58,600	26.550	1,555,830.000	
RIO TINTO PLC	28,700	36.245	1,040,231.500	
STANDARD CHARTERED PLC	77,900	7.571	589,780.900	
TESCO PLC	191,100	2.073	396,150.300	
FRESNILLO PLC	5,000	13.360	66,800.000	
SMITH & NEPHEW PLC	20,300	12.820	260,246.000	
GLENORE PLC	285,125	3.627	1,034,290.930	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	16,200	6.205	100,521.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	6,500	17.050	110,825.000	
SMITHS GROUP PLC	9,333	14.440	134,768.520	
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	6.845	41,754.500	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	31,083	3.658	113,701.610	
PEARSON PLC	18,863	7.250	136,756.750	
SAINSBURY (J) PLC	38,125	2.361	90,013.120	
NEXT PLC	3,300	42.460	140,118.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	73,900	2.019	149,204.100	
WHITBREAD PLC	4,311	38.640	166,577.040	
IMI PLC	6,650	12.670	84,255.500	
BUNZL PLC	7,755	20.160	156,340.800	
GKN PLC	40,600	2.980	120,988.000	
VODAFONE GROUP PLC	623,683	2.300	1,434,470.900	
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,993	43.310	129,626.830	
KINGFISHER PLC	51,911	3.317	172,188.780	
WPP PLC	29,800	13.890	413,922.000	

UNITED UTILITIES GROUP PLC	15,927	8.160	129,964.320	
SEVERN TRENT PLC	5,733	20.900	119,819.700	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	15,700	67.310	1,056,767.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	11,900	11.840	140,896.000	
SCHRODERS PLC	2,800	34.720	97,216.000	
SSE PLC	23,900	13.150	314,285.000	
WEIR GROUP PLC/THE	5,400	20.190	109,026.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,700	6.265	142,215.500	
ASTRAZENECA PLC	29,750	48.810	1,452,097.500	
FERGUSON PLC	5,965	52.700	314,355.500	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	138,100	2.682	370,384.200	
3I GROUP PLC	22,991	8.915	204,964.760	
SKY PLC	24,500	10.180	249,410.000	
ASHTED GROUP PLC	11,400	18.940	215,916.000	
SAGE GROUP PLC/THE	25,614	7.815	200,173.410	
NATIONAL GRID PLC	80,234	8.686	696,912.520	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,672,965	0.664	1,111,016.050	
RSA INSURANCE GROUP PLC	24,260	6.075	147,379.500	
IMPERIAL BRANDS PLC	22,650	30.850	698,752.500	
CENTRICA PLC	128,360	1.380	177,136.800	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,000	41.600	124,800.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	53,660	49.670	2,665,292.200	
BHP BILLITON PLC	49,577	14.195	703,745.510	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,100	28.430	230,283.000	
HSBC HOLDINGS PLC	469,500	7.515	3,528,292.500	
SHIRE PLC	21,374	37.625	804,196.750	
OLD MUTUAL PLC	117,025	2.034	238,028.850	
ANGLO AMERICAN PLC	30,683	14.100	432,630.300	
MONDI PLC	8,300	18.180	150,894.000	
WM MORRISON SUPERMARKETS	50,900	2.155	109,689.500	
CARNIVAL PLC	4,511	48.300	217,881.300	
EASYJET PLC	3,500	14.170	49,595.000	
COMPASS GROUP PLC	37,389	15.340	573,547.260	
PERSIMMON PLC	7,050	26.260	185,133.000	
BT GROUP PLC	196,600	2.775	545,663.300	
COCA-COLA HBC AG-DI	4,400	23.250	102,300.000	
BURBERRY GROUP PLC	10,489	17.230	180,725.470	

	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,286	45.810	196,341.660	
	CAPITA PLC	15,090	4.044	61,023.960	
	TRAVIS PERKINS PLC	5,900	15.170	89,503.000	
	INTERTEK GROUP PLC	3,800	50.450	191,710.000	
	ITV PLC	86,800	1.657	143,827.600	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	7,199	37.800	272,122.200	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	105,700	24.285	2,566,924.500	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	87,218	24.525	2,139,021.450	
	MEGGITT PLC	17,700	4.716	83,473.200	
	G4S PLC	34,600	2.520	87,192.000	
	COBHAM PLC	55,600	1.212	67,387.200	
	ADMIRAL GROUP PLC	4,500	19.070	85,815.000	
	INVESTEC PLC	16,000	4.841	77,456.000	
	ANTOFAGASTA PLC	9,800	9.305	91,189.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	63,357	4.180	264,832.260	
	EXPERIAN PLC	22,054	16.010	353,084.540	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 44,579,749.320 (6,700,336,323)	
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	183.000	183,000.000	
	FRUTAROM	900	304.600	274,140.000	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,300	5.122	247,392.600	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	14.230	199,220.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	465.000	279,000.000	
	BANK HAPOALIM BM	24,500	23.830	583,835.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	33,400	19.290	644,286.000	
	NICE LTD	1,400	312.100	436,940.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,000	61.070	183,210.000	
	イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 3,031,023.600 (97,204,927)	
オーストラリ ア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	HEALTHSCOPE LTD	37,500	2.050	76,875.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	61,700	3.260	201,142.000	
	BHP BILLITON LIMITED	74,700	27.710	2,069,937.000	

SOUTH32 LTD	120,700	3.220	388,654.000	
ALUMINA LTD	56,900	2.250	128,025.000	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	19,700	31.870	627,839.000	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	35,500	4.860	172,530.000	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	11.440	134,992.000	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	62,600	29.690	1,858,594.000	
WESTPAC BANKING CORP	79,848	31.370	2,504,831.760	
SANTOS LTD	42,800	5.020	214,856.000	
AUSNET SERVICES	41,000	1.855	76,055.000	
AUST AND NZ BANKING GROUP	68,400	28.220	1,930,248.000	
RIO TINTO LTD	10,000	70.570	705,700.000	
ORIGIN ENERGY LTD	41,400	9.100	376,740.000	
AMCOR LIMITED	26,800	15.230	408,164.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	46,800	5.410	253,188.000	
OIL SEARCH LTD	32,900	7.420	244,118.000	
SEEK LTD	7,500	18.550	139,125.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	17,100	16.000	273,600.000	
NEWCREST MINING LTD	17,600	21.730	382,448.000	
INCITEC PIVOT LTD	38,200	3.770	144,014.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	40,550	79.940	3,241,567.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,000	35.500	213,000.000	
ORICA LTD	8,300	18.160	150,728.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	32,300	10.540	340,442.000	
CIMIC GROUP LTD	2,100	51.640	108,444.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	30,000	27.070	812,100.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	8.520	116,724.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	44,900	5.260	236,174.000	
CROWN RESORTS LTD	9,600	12.850	123,360.000	
TELSTRA CORP LTD	98,600	3.690	363,834.000	
AMP LTD	66,800	5.160	344,688.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	10,300	22.000	226,600.000	
MACQUARIE GROUP LTD	7,684	96.880	744,425.920	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,600	23.280	293,328.000	
BANK OF QUEENSLAND LTD	9,100	12.540	114,114.000	
CSL LTD	10,600	140.030	1,484,318.000	
WESFARMERS LTD	26,495	44.590	1,181,412.050	
COCHLEAR LTD	1,400	176.910	247,674.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	13,400	14.010	187,734.000	

	SUNCORP GROUP LTD	29,700	14.050	417,285.000	
	BORAL LTD	27,700	7.650	211,905.000	
	ASX LTD	4,700	55.370	260,239.000	
	COMPUTERSHARE LTD	10,400	16.250	169,000.000	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	4.090	57,260.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	54,900	7.300	400,770.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	9,500	23.080	219,260.000	
	CHALLENGER LTD	13,900	13.880	192,932.000	
	AGL ENERGY LTD	15,500	24.520	380,060.000	
	BRAMBLES LTD	37,300	9.960	371,508.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	45.260	63,364.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,300	68.970	227,601.000	
	TPG TELECOM LTD	8,700	6.440	56,028.000	
	REA GROUP LTD	1,200	77.600	93,120.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,400	44.300	62,020.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 27,024,694.730 (2,328,717,944)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	6,700	38.000	254,600.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	440	772.700	339,988.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,696	31.580	148,299.680	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	5,187	78.580	407,594.460	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	10,700	27.760	297,032.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,150	104.680	329,742.000	
	BCE INC	3,430	61.350	210,430.500	
	FRANCO-NEVADA CORP	4,300	97.910	421,013.000	
	SUNCOR ENERGY INC	38,830	43.660	1,695,317.800	
	METRO INC	5,500	40.720	223,960.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	8,100	63.720	516,132.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	27,900	82.160	2,292,264.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	10,150	119.430	1,212,214.500	
	TORONTO-DOMINION BANK	43,200	71.830	3,103,056.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	6,700	34.930	234,031.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	34,050	101.920	3,470,376.000	
	TOURMALINE OIL CORP	5,400	20.660	111,564.000	
	VERMILION ENERGY INC	2,800	42.650	119,420.000	

TRANSCANADA CORP	20,550	61.590	1,265,674.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	11,629	44.460	517,025.340	
BOMBARDIER INC-B	45,400	3.070	139,378.000	
BARRICK GOLD CORP	27,300	18.130	494,949.000	
CAE INC	5,800	22.540	130,732.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,704	56.900	381,457.600	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	19,400	25.320	491,208.000	
EMPIRE CO LTD 'A'	3,900	24.010	93,639.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	78.510	125,616.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,450	59.570	205,516.500	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	9,700	10.050	97,485.000	
LINAMAR CORP	1,100	72.500	79,750.000	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	5,400	16.470	88,938.000	
HYDRO ONE LTD	7,200	22.590	162,648.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,160	68.180	351,808.800	
EMERA INC	1,300	47.980	62,374.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,800	37.430	104,804.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,600	64.330	553,238.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,500	55.360	304,480.000	
KINROSS GOLD CORP	29,500	5.190	153,105.000	
BANK OF MONTREAL	15,300	100.630	1,539,639.000	
POWER CORP OF CANADA	8,100	32.620	264,222.000	
METHANEX CORP	2,200	74.010	162,822.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,900	135.200	256,880.000	
CAMECO CORP	9,200	12.970	119,324.000	
TELUS CORP	5,400	48.000	259,200.000	
POWER FINANCIAL CORP	5,700	34.990	199,443.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,400	30.670	410,978.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,600	163.690	261,904.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	24,800	3.940	97,712.000	
AGRIUM INC	3,300	141.740	467,742.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	26,100	42.560	1,110,816.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	640	667.000	426,880.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,400	72.070	605,388.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,100	110.580	121,638.000	
BLACKBERRY LTD	11,900	13.950	166,005.000	

SUN LIFE FINANCIAL INC	14,250	52.240	744,420.000	
ENBRIDGE INC	38,100	49.890	1,900,809.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	20,750	56.230	1,166,772.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	46,000	26.700	1,228,200.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	7,100	25.390	180,269.000	
GOLDCORP INC	19,959	15.970	318,745.230	
ENCANA CORP	23,100	14.270	329,637.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,400	230.050	782,170.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,500	58.980	147,450.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,200	40.760	211,952.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,550	103.350	1,813,792.500	
CGI GROUP INC - CLASS A	5,000	69.480	347,400.000	
HUSKY ENERGY INC	8,458	16.470	139,303.260	
ONEX CORPORATION	2,000	93.880	187,760.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,100	29.230	295,223.000	
FINNING INTERNATIONAL INC	3,900	31.500	122,850.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,200	56.310	236,502.000	
IGM FINANCIAL INC	1,900	44.410	84,379.000	
OPEN TEXT CORP	6,200	42.170	261,454.000	
CI FINANCIAL CORP	6,400	29.490	188,736.000	
SAPUTO INC	4,800	44.480	213,504.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	15,800	17.120	270,496.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,800	67.150	658,070.000	
FORTIS INC	9,900	46.820	463,518.000	
LUNDIN MINING CORP	16,100	7.480	120,428.000	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	13,300	8.290	110,257.000	
CENOVUS ENERGY INC	24,000	10.860	260,640.000	
DOLLARAMA INC	2,500	154.900	387,250.000	
ATCO LTD -CLASS I	1,700	44.740	76,058.000	
ALTAGAS LTD	3,900	29.040	113,256.000	
FIRST CAPITAL REALTY INC	3,800	20.850	79,230.000	
KEYERA CORP	4,400	35.320	155,408.000	
INTER PIPELINE LTD	8,800	27.200	239,360.000	
ARC RESOURCES LTD	8,300	13.880	115,204.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 41,611,958.170	

(3,646,039,775)

		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
シンガポール・ドル					
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	31,300	26.050	815,365.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	41,500	24.580	1,020,070.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,470	10.510	131,059.700	
	KEPPEL CORP LTD	34,500	7.530	259,785.000	
	UOL GROUP LTD	13,200	8.540	112,728.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	11,200	12.150	136,080.000	
	CAPITALAND LTD	59,000	3.500	206,500.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	42,000	1.500	63,000.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	2.590	106,190.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,300	40.940	94,162.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	74,200	12.300	912,660.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	153,000	1.340	205,020.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	188,650	3.750	707,437.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	35,000	3.190	111,650.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	22,700	3.020	68,554.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.380	62,472.000	
	SATS LTD	16,000	5.250	84,000.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	19,000	7.520	142,880.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,800	1.910	89,388.000	
	STARHUB LTD	16,000	2.920	46,720.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	37,200	3.120	116,064.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	63,000	3.360	211,680.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 5,703,465.200 (476,581,552)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFY AG-REG	850	134.100	113,985.000	
	UBS GROUP AG-REG	85,500	18.010	1,539,855.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	200	663.500	132,700.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,900	74.000	288,600.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHE IN	16,480	244.100	4,022,768.000	

	PARGESA HOLDING SA-BR	950	84.350	80,132.500	
	SIKA AG-BR	50	7,630.000	381,500.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	69,500.000	139,000.000	
	ABB LTD-REG	46,400	25.770	1,195,728.000	
	SWISS RE AG	7,550	92.500	698,375.000	
	NESTLE SA-REG	72,550	84.300	6,115,965.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	420	666.000	279,720.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	970	223.300	216,601.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	56,120	17.470	980,416.400	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,200	59.000	306,800.000	
	SGS SA-REG	130	2,457.000	319,410.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	500	218.400	109,200.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,200	124.300	149,160.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	740	394.300	291,782.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,522	302.000	1,063,644.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,200	152.600	183,120.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	27.450	156,465.000	
	NOVARTIS AG-REG	51,750	83.800	4,336,650.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	50	1,923.000	96,150.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	12,200	89.050	1,086,410.000	
	SWISSCOM AG-REG	620	523.000	324,260.000	
	GEBERIT AG-REG	850	425.100	361,335.000	
	GIVAUDAN-REG	220	2,201.000	484,220.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	220	685.500	150,810.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,200	152.900	183,480.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,750	259.900	454,825.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,300	75.300	97,890.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	10,540	53.800	567,052.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	770	341.400	262,878.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,250	173.900	217,375.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,650	87.950	145,117.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	5,770.000	132,710.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 27,666,089.400 (3,144,251,060)	
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	296.900	564,110.000	
	ERICSSON LM-B SHS	71,030	55.100	3,913,753.000	

	VOLVO AB-B SHS	36,600	157.200	5,753,520.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,500	545.500	818,250.000	
	SKF AB-B SHARES	8,750	183.000	1,601,250.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	5,450	266.800	1,454,060.000	
	NORDEA BANK AB	70,850	100.300	7,106,255.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,150	330.100	1,369,915.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	105.000	939,750.000	
	GETINGE AB-B SHS	5,600	120.400	674,240.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	35,050	97.900	3,431,395.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	35,200	112.800	3,970,560.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	20,900	200.100	4,182,090.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	22,600	174.300	3,939,180.000	
	SKANSKA AB-B SHS	7,650	171.900	1,315,035.000	
	SANDVIK AB	26,250	144.100	3,782,625.000	
	INVESTOR AB-B SHS	10,550	383.100	4,041,705.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,700	352.600	5,535,820.000	
	SECURITAS AB-B SHS	7,400	143.100	1,058,940.000	
	TELIA CO AB	60,000	37.440	2,246,400.000	
	ALFA LAVAL AB	7,000	192.300	1,346,100.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	313.700	2,854,670.000	
	ASSA ABLOY AB-B	23,300	167.800	3,909,740.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	900	625.500	562,950.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	4,200	190.800	801,360.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	14,100	242.300	3,416,430.000	
	BOLIDEN AB	6,500	270.000	1,755,000.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	9,750	81.200	791,700.000	
	KINNEVIK AB - B	5,300	281.600	1,492,480.000	
	HEXAGON AB-B SHS	6,200	410.900	2,547,580.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,000	202.100	808,400.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クロー ナ 77,985,263.000 (1,035,644,293)	
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	43,800	329.500	14,432,100.000	
	DANSKE BANK A/S	17,550	239.200	4,197,960.000	
	ISS A/S	3,900	232.600	907,140.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	85	9,975.000	847,875.000	

	H LUNDBECK A/S	1,700	301.200	512,040.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,000	419.000	2,095,000.000	
	TDC A/S	19,300	38.000	733,400.000	
	CARLSBERG AS-B	2,450	737.000	1,805,650.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,200	344.300	1,790,360.000	
	COLOPLAST-B	2,800	483.500	1,353,800.000	
	DSV A/S	4,500	485.600	2,185,200.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,675	173.000	462,775.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	150	10,460.000	1,569,000.000	
	TRYG A/S	2,500	151.900	379,750.000	
	PANDORA A/S	2,550	624.500	1,592,475.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,350	555.000	1,304,250.000	
	GENMAB A/S	1,300	1,032.000	1,341,600.000	
	ORSTED A/S	4,450	346.800	1,543,260.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 39,053,635.000 (695,545,240)	
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	2.950	76,700.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.670	193,368.630	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	6.605	154,557.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	7.650	153,765.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	13,500	13.890	187,515.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,800	10.050	88,440.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 854,345.630 (67,424,956)	
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	56.750	1,736,550.000	
	DNB ASA	22,550	152.600	3,441,130.000	
	ORKLA ASA	19,050	84.900	1,617,345.000	
	TELENOR ASA	18,000	175.500	3,159,000.000	
	STATOIL ASA	26,073	169.400	4,416,766.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,160	365.000	1,518,400.000	
	MARINE HARVEST	9,900	136.200	1,348,380.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,850	151.100	732,835.000	

	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,800	211.000	379,800.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 18,350,206.200 (246,993,776)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	19,350	106.500	2,060,775.000	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,800	31.205	118,579.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	48,650	16.540	804,671.000	
	COMMERZBANK AG	24,685	12.560	310,043.600	
	VOLKSWAGEN AG	800	169.100	135,280.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	4,300	169.200	727,560.000	
	MAN SE	850	94.380	80,223.000	
	SIEMENS AG-REG	17,950	116.450	2,090,277.500	
	E.ON SE	51,700	9.387	485,307.900	
	UNIPER SE	4,900	26.005	127,424.500	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,800	85.950	670,410.000	
	GEA GROUP AG	4,200	39.970	167,874.000	
	OSRAM LICHT AG	2,360	72.950	172,162.000	
	CONTINENTAL AG	2,550	222.600	567,630.000	
	BASF SE	21,350	93.670	1,999,854.500	
	K+S AG-REG	4,400	20.050	88,220.000	
	ALLIANZ SE-REG	10,650	197.150	2,099,647.500	
	THYSSENKRUPP AG	10,200	23.445	239,139.000	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,200	111.850	469,770.000	
	RWE AG	11,900	16.805	199,979.500	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	5,650	29.785	168,285.250	
	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	900	89.350	80,415.000	
	BRENTAG AG	3,650	52.870	192,975.500	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	9,650	64.180	619,337.000	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,000	58.100	174,300.000	
	HOCHTIEF AG	500	147.050	73,525.000	
	SAP SE	22,992	97.350	2,238,271.200	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,620	186.300	674,406.000	
	SCHAEFFLER AG	3,800	13.760	52,288.000	
	ZALANDO SE	2,600	45.430	118,118.000	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,500	89.990	314,965.000	
	KION GROUP AG	1,650	67.610	111,556.500	

WIRECARD AG	2,800	91.990	257,572.000	
COVESTRO AG	2,850	86.410	246,268.500	
INNOGY SE	3,400	32.215	109,531.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,550	70.920	251,766.000	
METRO AG	4,100	16.385	67,178.500	
DRILLISCH AG	1,300	69.050	89,765.000	
LINDE AG - TENDER	4,300	192.900	829,470.000	
BEIERSDORF AG	2,300	99.510	228,873.000	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,500	43.410	65,115.000	
MERCK KGAA	3,100	90.530	280,643.000	
ADIDAS AG	4,410	172.250	759,622.500	
HENKEL AG & CO KGAA	2,400	101.850	244,440.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	77,900	15.065	1,173,563.500	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,050	87.050	439,602.500	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	22,500	71.010	1,597,725.000	
QIAGEN N.V.	5,248	27.165	142,561.920	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	26,200	22.700	594,740.000	
HANNOVER RUECK SE	1,400	107.200	150,080.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	22,600	40.355	912,023.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	4,450	98.160	436,812.000	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	5,550	29.050	161,227.500	
LANXESS AG	2,200	64.680	142,296.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,250	150.050	187,562.500	
AXEL SPRINGER SE	1,200	67.720	81,264.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	8,400	36.955	310,422.000	
SYMRISE AG	3,000	71.060	213,180.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,500	4.212	69,498.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,200	73.750	88,500.000	
HUGO BOSS AG -ORD	1,450	70.550	102,297.500	
RTL GROUP	1,000	67.990	67,990.000	
VONOVIA SE	10,900	41.350	450,715.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	22,076	32.700	721,885.200	
NN GROUP NV	7,500	37.365	280,237.500	
ARCELORMITTAL	15,600	26.130	407,628.000	
UNILEVER NV-CVA	37,950	48.525	1,841,523.750	
HEINEKEN NV	6,100	86.390	526,979.000	

RELX NV	22,719	19.320	438,931.080	
AEGON NV	40,744	5.302	216,024.680	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	29,483	18.240	537,769.920	
AKZO NOBEL	5,800	74.420	431,636.000	
KONINKLIJKE DSM NV	4,350	80.420	349,827.000	
WOLTERS KLUWER	6,900	44.360	306,084.000	
BOSKALIS WESTMINSTER	2,100	30.560	64,176.000	
ING GROEP NV	90,350	15.475	1,398,166.250	
KONINKLIJKE KPN NV	78,250	2.925	228,881.250	
ASML HOLDING NV	9,100	145.850	1,327,235.000	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	9,900	26.735	264,676.500	
VOPAK	1,600	36.420	58,272.000	
RANDSTAD HOLDING NV	2,850	51.280	146,148.000	
HEINEKEN HOLDING NV	2,600	81.680	212,368.000	
ALTICE NV - A	11,500	8.152	93,748.000	
JCDECAUX SA	1,600	33.640	53,824.000	
TOTAL SA	55,550	46.510	2,583,630.500	
MICHELIN (CGDE)	3,950	120.600	476,370.000	
AIR LIQUIDE SA	9,952	108.400	1,078,796.800	
KERING	1,790	388.850	696,041.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	13,200	71.210	939,972.000	
BOUYGUES SA	5,000	43.495	217,475.000	
BNP PARIBAS	26,050	62.920	1,639,066.000	
PEUGEOT SA	13,750	17.195	236,431.250	
NATIXIS	22,950	6.636	152,296.200	
THALES SA	2,550	86.280	220,014.000	
DANONE	14,200	71.200	1,011,040.000	
CARREFOUR SA	12,800	17.110	219,008.000	
SUEZ	8,875	14.580	129,397.500	
VIVENDI	23,741	22.420	532,273.220	
L'OREAL	5,850	187.250	1,095,412.500	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	11,500	47.000	540,500.000	
LEGRAND SA	6,317	63.320	399,992.440	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,300	48.785	63,420.500	
PERNOD RICARD SA	4,917	129.100	634,784.700	
SOCIETE BIC SA	700	91.560	64,092.000	
EURAZEO SA	1,116	75.270	84,001.320	
REXEL SA	7,050	15.120	106,596.000	

SOCIETE GENERALE SA	18,000	43.195	777,510.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,560	245.150	1,608,184.000	
ACCOR SA	4,400	42.160	185,504.000	
CAPGEMINI SE	3,750	97.050	363,937.500	
VALEO SA	5,650	60.430	341,429.500	
PUBLICIS GROUPE	4,750	57.560	273,410.000	
BUREAU VERITAS SA	6,050	22.710	137,395.500	
EIFFAGE	1,700	91.690	155,873.000	
SODEXO SA	2,150	111.150	238,972.500	
IPSEN	900	101.200	91,080.000	
INGENICO GROUP	1,350	86.340	116,559.000	
AMUNDI SA	1,500	70.900	106,350.000	
TELEPERFORMANCE	1,400	119.850	167,790.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,600	63.640	101,824.000	
ZODIAC AEROSPACE	4,800	24.850	119,280.000	
FAURECIA	1,900	65.480	124,412.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	270	508.600	137,322.000	
SEB SA	500	150.000	75,000.000	
ESSILOR INTERNATIONAL	4,850	112.450	545,382.500	
DASSAULT AVIATION SA	60	1,303.400	78,204.000	
AXA SA	45,500	25.275	1,150,012.500	
LAGARDERE SCA	2,650	27.415	72,649.750	
EDENRED	5,350	23.725	126,928.750	
RENAULT SA	4,500	83.850	377,325.000	
HERMES INTERNATIONAL	730	439.800	321,054.000	
STMICROELECTRONICS NV	14,600	18.305	267,253.000	
REMY COINTREAU	550	115.450	63,497.500	
ATOS SE	2,150	128.600	276,490.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,050	89.070	271,663.500	
WENDEL	680	141.800	96,424.000	
ORANGE	46,800	14.660	686,088.000	
ALSTOM	3,650	33.435	122,037.750	
CNP ASSURANCES	3,750	19.280	72,300.000	
SANOFI	26,675	73.550	1,961,946.250	
VINCI SA	11,650	87.030	1,013,899.500	
AIRBUS SE	13,550	85.250	1,155,137.500	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,450	20.925	239,591.250	
CREDIT AGRICOLE SA	27,000	14.145	381,915.000	

BIOMERIEUX	1,000	73.750	73,750.000	
ENGIE	42,873	14.540	623,373.420	
IMERYS SA	900	78.010	70,209.000	
EDF	12,750	10.485	133,683.750	
SES	8,350	13.200	110,220.000	
SAFRAN SA	7,850	86.110	675,963.500	
ILIAD SA	600	203.150	121,890.000	
ARKEMA	1,550	103.950	161,122.500	
ADP	750	158.000	118,500.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	18.540	75,087.000	
SCOR SE	4,150	34.845	144,606.750	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	10,450	10.735	112,180.750	
BOLLORE	19,000	4.466	84,854.000	
UCB SA	3,000	64.050	192,150.000	
KBC GROEP NV	5,800	70.930	411,394.000	
COLRUYT SA	1,600	42.960	68,736.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,850	90.320	167,092.000	
SOLVAY SA	1,700	116.850	198,645.000	
UMICORE	4,500	39.500	177,750.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	17,810	93.950	1,673,249.500	
AGEAS	4,140	41.490	171,768.600	
PROXIMUS	3,500	27.700	96,950.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,200	56.740	68,088.000	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	21,750	1.950	42,412.500	
PRYSMIAN SPA	4,800	26.800	128,640.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	29,043	15.450	448,714.350	
MEDIOBANCA SPA	13,015	9.350	121,690.250	
TENARIS SA	11,250	12.790	143,887.500	
UNICREDIT SPA	47,306	16.150	763,991.900	
TELECOM ITALIA SPA	266,282	0.733	195,317.840	
TELECOM ITALIA-RSP	134,950	0.604	81,509.800	
INTESA SANPAOLO-RSP	21,000	2.682	56,322.000	
INTESA SANPAOLO	314,397	2.802	880,940.390	
ATLANTIA SPA	10,607	26.620	282,358.340	
POSTE ITALIANE SPA	11,800	6.365	75,107.000	
RECORDATI SPA	2,600	36.570	95,082.000	
ENI SPA	59,100	13.940	823,854.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	14,300	6.355	90,876.500	
LEONARDO SPA	9,525	9.915	94,440.370	

ENEL SPA	189,634	5.355	1,015,490.070	
SNAM SPA	53,200	4.076	216,843.200	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,850	50.450	194,232.500	
TERNA SPA	32,400	5.030	162,972.000	
EXOR NV	2,500	50.500	126,250.000	
CNH INDUSTRIAL NV	24,300	11.030	268,029.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	25,050	15.020	376,251.000	
FERRARI NV	2,835	88.600	251,181.000	
TELEFONICA SA	106,627	8.251	879,779.370	
ENDESA SA	7,650	18.350	140,377.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	155,512	7.149	1,111,755.280	
IBERDROLA SA	135,734	6.581	893,265.450	
BANCO DE SABADELL SA	122,909	1.643	201,939.480	
BANKINTER SA	15,100	7.858	118,655.800	
REPSOL SA	28,700	15.155	434,948.500	
GRIFOLS SA	6,700	24.215	162,240.500	
BANCO SANTANDER SA	378,250	5.624	2,127,278.000	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	15,800	18.495	292,221.000	
AMADEUS IT GROUP SA	10,100	60.100	607,010.000	
GAS NATURAL SDG SA	8,450	19.160	161,902.000	
MAPFRE SA	25,450	2.657	67,620.650	
CAIXABANK S.A	81,600	3.903	318,484.800	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE- DI	15,200	7.173	109,029.600	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,376	32.330	173,806.080	
AENA SME SA	1,600	169.850	271,760.000	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	25,300	29.955	757,861.500	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	5,600	11.690	65,464.000	
ENAGAS SA	5,400	25.005	135,027.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,000	18.895	188,950.000	
FERROVIAL SA	11,700	18.330	214,461.000	
BANKIA SA	24,105	3.954	95,311.170	
UPM-KYMMENE OYJ	12,400	25.790	319,796.000	
NOKIA OYJ	138,950	3.920	544,684.000	
WARTSILA OYJ ABP	3,350	52.800	176,880.000	

	STORA ENSO OYJ-R SHS	13,100	13.210	173,051.000	
	METSO OYJ	2,400	29.850	71,640.000	
	ELISA OYJ	3,250	33.120	107,640.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	10,350	45.630	472,270.500	
	FORTUM OYJ	10,450	17.260	180,367.000	
	KONE OYJ-B	7,850	43.640	342,574.000	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	2,650	36.130	95,744.500	
	NESTE OYJ	2,950	51.650	152,367.500	
	ORION OYJ-CLASS B	2,450	30.740	75,313.000	
	OMV AG	3,550	49.950	177,322.500	
	ERSTE GROUP BANK AG	6,650	35.020	232,883.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	48.680	138,738.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	29.425	100,045.000	
	ANDRITZ AG	1,600	45.850	73,360.000	
	AIB GROUP PLC	20,000	5.590	111,800.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	22,060	6.976	153,890.560	
	JERONIMO MARTINS	6,000	16.045	96,270.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,500	2.928	144,936.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	11,650	15.500	180,575.000	
	KERRY GROUP PLC-A	3,850	94.080	362,208.000	
	CRH PLC	19,400	28.540	553,676.000	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	1,900	98.000	186,200.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 94,034,878.200 (12,464,323,105)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	33,000	65.300	2,154,900.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	55,000	61.850	3,401,750.000	
	MTR CORP	34,500	45.450	1,568,025.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	34,000	125.700	4,273,800.000	
	SINO LAND CO	74,000	13.540	1,001,960.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	63,169	95.900	6,057,907.100	
	WHARF HOLDINGS LTD	28,000	26.600	744,800.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	12,500	73.050	913,125.000	
	FIRST PACIFIC CO	56,000	5.350	299,600.000	
	CLP HOLDINGS LTD	38,000	79.000	3,002,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	27,924	49.850	1,392,011.400	

HANG LUNG GROUP LTD	21,000	28.350	595,350.000	
HONG KONG & CHINA GAS	199,256	15.180	3,024,706.080	
HANG SENG BANK LTD	17,900	185.700	3,324,030.000	
WHEELLOCK & CO LTD	20,000	53.300	1,066,000.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	133,000	11.240	1,494,920.000	
WH GROUP LTD	194,500	8.420	1,637,690.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	27,300	226.400	6,180,720.000	
MINTH GROUP LTD	18,000	44.400	799,200.000	
LI & FUNG LTD	132,000	4.430	584,760.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	18.460	849,160.000	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	5,800	106.400	617,120.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	16,500	29.300	483,450.000	
NWS HOLDINGS LTD	35,500	13.820	490,610.000	
KERRY PROPERTIES LTD	14,500	33.300	482,850.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	29,040	32.750	951,060.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	14,000	40.400	565,600.000	
SJM HOLDINGS LTD	47,000	6.840	321,480.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	26,200	25.200	660,240.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	61,669	66.000	4,070,154.000	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	15,000	65.800	987,000.000	
PCCW LTD	95,000	4.620	438,900.000	
AIA GROUP LTD	281,200	61.950	17,420,340.000	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	98,000	7.710	755,580.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	28,000	50.600	1,416,800.000	
SANDS CHINA LTD	57,200	40.650	2,325,180.000	
SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	16.340	490,200.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	31,500	46.150	1,453,725.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	20,000	23.900	478,000.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	87,500	38.850	3,399,375.000	
WYNN MACAU LTD	38,000	24.650	936,700.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 83,110,778.580 (1,199,288,535)	
合計			92,687,655,335 [92,687,655,335]	

(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	580,767.020	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,137	1,197,659.970	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,550	459,405.500	
		GGP INC	14,400	335,664.000	
		VORNADO REALTY TRUST	3,827	297,893.680	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,750	450,120.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,500	558,110.000	
		EQUINIX INC	1,808	827,792.800	
		AMERICAN TOWER CORP	9,750	1,391,910.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	17,293	348,281.020	
		KIMCO REALTY CORP	10,000	184,700.000	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	12,000	143,880.000	
		INVITATION HOMES INC	7,400	178,340.000	
		VENTAS INC	8,300	533,275.000	
		WEYERHAEUSER CO	16,964	607,989.760	
		AGNC INVESTMENT CORP	9,000	185,670.000	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,900	125,304.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	9,250	1,023,512.500	
		IRON MOUNTAIN INC	5,610	211,384.800	
		VEREIT INC	22,300	176,393.000	
		PROLOGIS INC	12,262	809,046.760	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,100	278,964.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,150	200,079.000	
		DUKE REALTY CORP	8,000	222,560.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,480	369,689.200	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,600	211,200.000	
		WELLTOWER INC	8,400	562,296.000	
		HCP INC	10,700	287,081.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	145,233.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,600	268,060.000			
MACERICH CO/THE	2,700	176,796.000			
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	26,600	325,584.000			
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3,400	147,084.000			
REALTY INCOME CORP	6,450	370,230.000			
PUBLIC STORAGE	3,600	761,616.000			
REGENCY CENTERS CORP	3,500	245,000.000			

	SL GREEN REALTY CORP	2,250	232,267.500	
	UDR INC	6,300	247,968.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	4,750	543,685.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,000	262,680.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 16,485,172.510 (1,858,868,053)	

イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	17,062	167,890.080	
	SEGRO PLC	23,750	136,443.750	
	HAMMERSON PLC	19,200	102,528.000	
	BRITISH LAND CO PLC	22,100	148,291.000	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 555,152.830 (83,439,470)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENLEASE GROUP	13,300	213,997.000	
	TRANSURBAN GROUP-RTS	3,875	4,340.000	
	TRANSURBAN GROUP	47,800	611,840.000	
	SYDNEY AIRPORT	25,100	183,230.000	
	APA GROUP	26,700	232,023.000	
	SCENTRE GROUP	124,222	532,912.380	
	DEXUS	23,950	244,769.000	
	GPT GROUP	44,060	235,280.400	
	MIRVAC GROUP	84,400	205,936.000	
	STOCKLAND	57,000	267,330.000	
	WESTFIELD CORP	45,496	425,387.600	
	GOODMAN GROUP	41,700	366,960.000	
	VICINITY CENTRES	76,973	217,833.590	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 3,741,838.970 (322,434,264)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,500	46,755.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,000	63,210.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,900	97,344.000	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル	

			207,309.000	
			(18,164,415)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	60,100	112,387.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	57,400	153,832.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	63,200	133,984.000	
	SUNTEC REIT	53,000	112,360.000	
シンガポール・ドル	小計		シンガポール・ドル	
			512,563.000	
			(42,829,764)	
ユーロ			ユーロ	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,350	498,317.500	
	ICADE	900	73,332.000	
	GECINA SA	1,150	170,027.500	
	KLEPIERRE	5,200	185,146.000	
	FONCIERE DES REGIONS	750	69,915.000	
ユーロ	小計		ユーロ	
			996,738.000	
			(132,117,622)	
香港・ドル			香港・ドル	
	LINK REIT	52,000	3,619,200.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	64,500	457,950.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	87,000	859,560.000	
香港・ドル	小計		香港・ドル	
			4,936,710.000	
			(71,236,725)	
投資証券	合計		2,529,090,313	
			[2,529,090,313]	
合計			2,529,090,313	
			[2,529,090,313]	

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	602銘柄	97.0%	3.0%	65.7%
	投資証券	40銘柄			
イギリス・ポンド	株式	99銘柄	98.8%	1.2%	7.1%
	投資証券	4銘柄			
イスラエル・シケル	株式	9銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式	56銘柄	87.8%	12.2%	2.8%
	投資証券	13銘柄			
カナダ・ドル	株式	88銘柄	99.5%	0.5%	3.8%
	投資証券	3銘柄			
シンガポール・ドル	株式	22銘柄	91.8%	8.2%	0.5%
	投資証券	4銘柄			
スイス・フラン	株式	37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	9銘柄	100%	-%	0.3%
ユーロ	株式	239銘柄	99.0%	1.0%	13.2%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	株式	41銘柄	94.4%	5.6%	1.3%
	投資証券	3銘柄			

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。

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,972,263,132	1,059,519,229
投資証券	2 255,690,211,900	217,100,972,800
派生商品評価勘定	20,425,856	25,700,200
未収入金	-	1,607,086,927

未収配当金	1,045,322,377	1,163,416,707
流動資産合計	261,728,223,265	220,956,695,863
資産合計	261,728,223,265	220,956,695,863
負債の部		
流動負債		
前受金	19,071,800	33,300,000
未払金	3,138,607,753	189,094,400
未払解約金	18,444,000	23,048,500
流動負債合計	3,176,123,553	245,442,900
負債合計	3,176,123,553	245,442,900
純資産の部		
元本等		
元本	1 105,872,694,601	93,103,935,587
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	152,679,405,111	127,607,317,376
元本等合計	258,552,099,712	220,711,252,963
純資産合計	258,552,099,712	220,711,252,963
負債純資産合計	261,728,223,265	220,956,695,863

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20日 至 平成29年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	89,610,737,405円	105,872,694,601円
期中追加設定元本額	24,593,354,604円	15,004,810,266円
期中一部解約元本額	8,331,397,408円	27,773,569,280円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	9,781,847,232円	9,847,773,031円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	90,876,052,371円	76,300,634,662円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	426,116,567円	394,808,043円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	18,797円	27,123円
iFree J-REIT イ ンデックス	33,242,209円	124,681,806円
iFree 8資産バランス	45,191,617円	302,411,577円
DC・ダイワJ-REIT オープン	3,226,297,529円	3,533,542,169円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,357,905円	3,354,287円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,855,028円	5,785,265円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	900,684円	1,256,105円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	51,513,007円	55,539,603円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	188,297,819円	777,631,926円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	- 円	1,417,548円

	ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	- 円	245,822,040円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,235,003,836円	1,509,250,402円
計		105,872,694,601円	93,103,935,587円
2.	期末日における受益権の総数	105,872,694,601口	93,103,935,587口
3.	2 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。 投資証券 377,400,000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。 投資証券 332,400,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、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)における不動産投信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得ます。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	2,912,964,927	452,415,989
合計	2,912,964,927	452,415,989

(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16日から平成28年12月19日まで、及び平成29年9月16日から平成29年12月18日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	平成28年12月19日 現在			平成29年12月18日 現在		
	契約額等 （円）	うち	時価 （円）	契約額等 （円）	うち	時価 （円）

		1年超				1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	2,667,788,200	-	2,688,378,000	20,589,800	3,028,450,000	-	3,054,350,000	25,900,000
合計	2,667,788,200	-	2,688,378,000	20,589,800	3,028,450,000	-	3,054,350,000	25,900,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信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. 不動産投信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12月19日現在	平成29年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.4421円	2.3706円
(1万口当たり純資産額)	(24,421円)	(23,706円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	9,468	4,378,950,000	
	MCUBS MidCity投資法人	5,767	2,191,460,000	
	森ヒルズリート	30,607	4,168,673,400	
	産業ファンド	7,740	3,769,380,000	
	アドバンス・レジデンス	26,379	7,293,793,500	
	ケネディクスレジデンシャル	6,462	2,096,919,000	
	API投資法人	12,890	6,129,195,000	
	GLP投資法人	49,881	6,190,232,100	

コンフォリア・レジデンシャル	10,391	2,531,247,600	
日本プロロジスリート	35,835	8,639,818,500	
星野リゾート・リート	4,326	2,387,952,000	
ONEリート投資法人	3,115	775,946,500	
イオンリート投資	27,056	3,184,491,200	
ヒューリックリート投資法	19,349	3,167,431,300	
日本リート投資法人	7,655	2,564,425,000	
インベスコ・オフィス・Jリート	15,787	1,747,620,900	
日本ヘルスケア投資法	1,382	224,989,600	
積水ハウス・リート投資	17,872	2,384,124,800	
トーセイ・リート投資法人	4,580	490,518,000	
ケネディクス商業リート	10,360	2,413,880,000	
ヘルスケア&メディカル投資	3,511	373,921,500	
サムティ・レジデンシャル	4,948	446,309,600	
ジャパン・シニアリビング	1,569	253,550,400	
野村不動産マスターF	81,739	11,688,677,000	
いちごホテルリート投資	4,503	554,769,600	
ラサールロジポート投資	21,494	2,476,108,800	
スターアジア不動産投	5,917	655,603,600	
マリモ地方創生リート	1,590	185,076,000	
三井不ロジパーク	4,607	1,665,430,500	
大江戸温泉リート	4,755	410,356,500	
さくら総合リート	6,849	637,641,900	
投資法人みらい	3,625	652,500,000	
森トラスト・ホテルリート投	6,171	867,025,500	
三菱地所物流REIT	2,641	728,387,800	
日本ビルファンド	27,591	15,285,414,000	
ジャパンリアルエステイト	26,931	14,461,947,000	
日本リテールファンド	54,811	11,159,519,600	
オリックス不動産投資	54,970	8,547,835,000	
日本プライムリアルティ	17,988	6,646,566,000	
プレミアム投資法人	25,734	2,730,377,400	
東急リアル・エステート	19,102	2,685,741,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	4,574	1,820,452,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	62,839	10,267,892,600	
森トラスト総合リート	20,363	3,241,789,600	
インヴィンシブル投資法人	78,142	3,848,493,500	
フロンティア不動産投資	9,692	4,366,246,000	
平和不動産リート	17,743	1,680,262,100	
日本ロジスティクスファンド投資法人	18,980	3,964,922,000	

福岡リート投資法人	13,828	2,342,463,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	8,328	5,321,592,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	21,602	2,445,346,400	
いちごオフィスリート投資法人	22,062	1,740,691,800	
大和証券オフィス投資法人	6,144	3,526,656,000	
阪急リート投資法人	11,675	1,542,267,500	
スタートプロシード投資法人	4,489	740,236,100	
大和ハウスリート投資法人	29,303	7,841,482,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	82,234	6,529,379,600	
日本賃貸住宅投資法人	32,047	2,592,602,300	
ジャパンエクセレント投資法人	25,514	3,444,390,000	
投資証券 合計		217,100,972,800	
合計		217,100,972,800	

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) 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。

日本ビルファンド

600口

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。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	302,428,959	50,262,799
コール・ローン	92,651,825	91,529,565
投資信託受益証券	-	46,049,379
投資証券	6,092,393,296	13,832,110,951
派生商品評価勘定	-	471,338
未収入金	1,401	59,471

未収配当金		11,121,665	33,086,895
差入委託証拠金		-	13,517,642
流動資産合計		6,498,597,146	14,067,088,040
資産合計		6,498,597,146	14,067,088,040
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,100	8,995
未払金		307,456,138	50,712,789
未払解約金		10,011,000	1,061,000
流動負債合計		317,473,238	51,782,784
負債合計		317,473,238	51,782,784
純資産の部			
元本等			
元本	1	2,861,359,942	6,102,884,330
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		3,319,763,966	7,912,420,926
元本等合計		6,181,123,908	14,015,305,256
純資産合計		6,181,123,908	14,015,305,256
負債純資産合計		6,498,597,146	14,067,088,040

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20日 至 平成29年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

	<p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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12月19日現在	平成29年12月18日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	1,288,622,228円	2,861,359,942円
期中追加設定元本額	1,695,507,019円	3,616,858,632円
期中一部解約元本額	122,769,305円	375,334,244円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	1,071,680,040円	3,150,065,335円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	109,360,983円	405,524,115円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	- 円	204,326,703円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	- 円	142,134,165円
D-I's グローバルREI Tインデックス	1,488,344円	1,191,277円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	23,511円	28,535円
iFree 外国REITイ ンデックス	45,690,995円	62,916,833円
iFree 8資産バランス	51,307,248円	313,141,173円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	1,275,948,091円	1,502,563,697円

DC ダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,847,988円	3,481,750円
DC ダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,708,895円	6,017,065円
DC ダイワ・ターゲットイ ヤー2040	946,555円	1,160,118円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	278,156,453円	279,188,081円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	17,200,839円	22,068,351円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)(ダ イワSMA専用)	- 円	4,515,104円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)(ダ イワSMA専用)	- 円	4,562,028円
計	2,861,359,942円	6,102,884,330円
2. 期末日における受益権の総数	2,861,359,942口	6,102,884,330口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、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)における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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12月19日現在	平成29年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	-	443,823
投資証券	78,564,867	170,662,826
合計	78,564,867	171,106,649

(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12月1日から平成28年12月19日まで、及び平成29年12月1日から平成29年12月18日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	平成28年12月19日 現在				平成29年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	-	-	-	-	58,109,738	-	58,581,076	471,338
合計	-	-	-	-	58,109,738	-	58,581,076	471,338

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信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. 不動産投信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12月19日 現在				平成29年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	78,779,958	-	78,773,858	6,100	68,504,245	-	68,495,250	8,995
アメリカ・ドル	52,932,825	-	52,929,000	3,825	50,738,625	-	50,733,000	5,625
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	7,323,812	-	7,323,600	212

カナダ・ドル	1,675,511	-	1,675,420	91	-	-	-	-
シンガポール・ドル	4,399,180	-	4,398,840	340	10,441,808	-	10,438,650	3,158
ユーロ	17,196,993	-	17,196,798	195	-	-	-	-
香港・ドル	2,575,449	-	2,573,800	1,649	-	-	-	-
合計	78,779,958	-	78,773,858	6,100	68,504,245	-	68,495,250	8,995

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.1602円	2.2965円
(1万口当たり純資産額)	(21,602円)	(22,965円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REIT ETF	4,800.000	アメリカ・ドル 408,384.000
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 408,384.000 (46,049,379)
投資信託受益証券 合計				46,049,379 [46,049,379]
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	7,100	アメリカ・ドル 271,930.000
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	7,700	60,368.000
		URBAN EDGE PROPERTIES	10,882	280,646.780
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	10,900	242,852.000
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,600	2,652,236.000
		SIMON PROPERTY GROUP INC	32,847	5,512,055.070
		BOSTON PROPERTIES INC	16,200	2,096,442.000
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	16,455	721,387.200
		GGP INC	65,677	1,530,930.870
		VORNADO REALTY TRUST	18,164	1,413,885.760
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	4,500	99,405.000
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	4,600	122,452.000
		NEXPOINT RESIDENTIAL	1,600	42,592.000
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	5,100	284,121.000
		EQUITY RESIDENTIAL	38,600	2,534,476.000
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	21,400	424,790.000
		EPR PROPERTIES	6,800	457,096.000
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,700	17,374.000
		CITY OFFICE REIT INC	2,100	27,531.000
		GLOBAL NET LEASE INC	6,333	135,652.860
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6,329	168,414.690
		CHATHAM LODGING TRUST	4,500	103,860.000
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	6,000	169,500.000
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2,600	103,324.000
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5,200	359,372.000
		FOREST CITY REALTY TRUST- A	28,100	687,045.000
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	10,900	216,583.000		
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,600	45,152.000		
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	2,213	22,705.380		
HOST HOTELS & RESORTS INC	77,700	1,564,878.000		
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,808	596,478.000		

GRAMERCY PROPERTY TRUST	16,695	463,453.200	
CORESITE REALTY CORP	3,500	413,455.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	16,400	563,012.000	
RLJ LODGING TRUST	18,171	400,852.260	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	27,608.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	19,100	356,597.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3,800	59,660.000	
CYRUSONE INC	9,600	570,720.000	
KIMCO REALTY CORP	44,500	821,915.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,800	14,850.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	21,050	660,970.000	
WHITESTONE REIT	3,000	44,190.000	
TIER REIT INC	4,500	89,415.000	
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	237	2,571.450	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,000	34,290.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	20,900	752,609.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	15,300	308,601.000	
QUALITY CARE PROPERTIES	9,300	136,896.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	17,000	485,010.000	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	57,911	694,352.890	
INVITATION HOMES INC	30,197	727,747.700	
JBG SMITH PROPERTIES	9,732	340,036.080	
ALEXANDER & BALDWIN INC	4,600	131,836.000	
CLIPPER REALTY INC	1,400	14,168.000	
GLADSTONE LAND CORP	900	11,799.000	
INFRAREIT INC	3,700	75,443.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	18,360	129,070.800	
CORECIVIC INC	11,824	261,073.920	
STORE CAPITAL CORP	17,500	453,775.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	10,000	150,100.000	
LIFE STORAGE INC	4,800	433,344.000	
SELECT INCOME REIT	6,400	164,224.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	4,200	164,892.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	7,782	79,532.040	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	3,100	64,015.000	
PARAMOUNT GROUP INC	21,200	336,656.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	13,100	271,301.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	8,000	244,640.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	12,400	285,324.000	

STAG INDUSTRIAL INC	9,500	266,285.000	
VENTAS INC	37,679	2,420,875.750	
CARETRUST REIT INC	7,203	127,709.190	
GEO GROUP INC/THE	12,800	304,384.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	31,900	579,304.000	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	9,600	180,288.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	18,987	377,841.300	
UMH PROPERTIES INC	2,900	42,833.000	
IRON MOUNTAIN INC	27,700	1,043,736.000	
TERRENO REALTY CORP	5,400	200,988.000	
VEREIT INC	101,208	800,555.280	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	46,700	401,153.000	
SUN COMMUNITIES INC	8,300	786,591.000	
ACADIA REALTY TRUST	8,611	239,730.240	
ALEXANDER'S INC	400	159,076.000	
PROLOGIS INC	56,246	3,711,111.080	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,900	1,315,116.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	18,500	340,955.000	
SAUL CENTERS INC	1,000	63,120.000	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	15,945	89,770.350	
MACK-CALI REALTY CORP	9,300	204,414.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	9,600	893,376.000	
COUSINS PROPERTIES INC	43,607	413,830.430	
DDR CORP	31,156	276,042.160	
DUKE REALTY CORP	37,200	1,034,904.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	3,600	325,512.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,967	1,740,286.930	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	12,400	398,536.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,600	1,003,200.000	
GETTY REALTY CORP	3,403	95,352.060	
WELLTOWER INC	39,000	2,610,660.000	
HCP INC	49,000	1,314,670.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	11,000	569,250.000	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	16,900	516,633.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	12,900	431,376.000	
EQUITY COMMONWEALTH	12,975	397,424.250	
KILROY REALTY CORP	10,400	783,328.000	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	11,800	336,890.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	15,400	677,754.000	

LTC PROPERTIES INC	4,100	191,142.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	22,400	223,328.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,928	1,229,776.800	
MACERICH CO/THE	11,500	753,020.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,100	832,013.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,200	339,108.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15,800	683,508.000	
REALTY INCOME CORP	29,017	1,665,575.800	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	10,100	305,020.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	6,600	74,382.000	
PUBLIC STORAGE	15,800	3,342,648.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,000	257,200.000	
REGENCY CENTERS CORP	15,520	1,086,400.000	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	7,300	107,456.000	
ISTAR INC	6,500	74,815.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	9,900	259,578.000	
SL GREEN REALTY CORP	10,400	1,073,592.000	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	25,100	495,725.000	
TAUBMAN CENTERS INC	6,200	392,956.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,500	57,375.000	
UDR INC	28,200	1,109,952.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,300	100,061.000	
WP CAREY INC	11,300	798,458.000	
WASHINGTON REIT	7,800	253,968.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	12,400	413,788.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8,300	56,274.000	
AGREE REALTY CORP	3,000	155,070.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,250	571,050.000	
CUBESMART	19,200	564,288.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	23,426	400,116.080	
DIGITAL REALTY TRUST INC	21,578	2,469,817.880	
CEDAR REALTY TRUST INC	6,900	41,676.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	13,200	1,155,792.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,475	61,438.000	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	10,100	57,570.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	8,250	164,257.500	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	7,000	125,300.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,500	40,425.000	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	14,400	613,152.000	

	EDUCATION REALTY TRUST INC	7,700	278,740.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,500	54,175.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	20,442	234,469.740	
	NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	5,249	73,328.530	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	38,200	534,418.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11,400	121,410.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	16,900	694,928.000	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	9,800	582,512.000	
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	24,300	322,704.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	93,103	87,051.300	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 87,261,210.600 (9,839,574,108)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	185,420	112,920.780	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	41,940	22,647.600	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	51,710	45,246.250	
	REGIONAL REIT LTD	26,150	27,065.250	
	NEWRIVER REIT PLC	31,400	104,656.200	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	13,450	15,097.620	
	LXI REIT PLC	21,160	22,006.400	
	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	7,570	7,674.080	
	REGIONAL REIT LTD	3,268	13,072.000	
	RDI REIT PLC	142,100	49,365.540	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	80,301	790,161.840	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	42,780	58,009.680	
	SEGRO PLC	106,280	610,578.600	
	HAMMERSON PLC	84,130	449,254.200	
	UNITE GROUP PLC	25,870	198,422.900	
	BRITISH LAND CO PLC	109,810	736,825.100	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	34,590	234,174.300	
	INTU PROPERTIES PLC	92,710	227,603.050	
	DERWENT LONDON PLC	11,910	361,706.700	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	56,760	65,557.800	
	WORKSPACE GROUP PLC	12,280	117,888.000	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	22,370	109,903.810	
	SHAFTESBURY PLC	23,030	230,760.600	
	BIG YELLOW GROUP PLC	15,460	132,028.400	

	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	70,520	126,301.320	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	43,330	25,998.000	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	141,220	206,322.420	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 5,101,248.440 (766,717,641)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	9,340	136,831.000	イスラエル・シュケル
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 136,831.000 (4,388,170)	
オーストラリ ア・ドル			オーストラリア・ドル	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	16,890	48,136.500	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	137,150	141,950.250	
	RURAL FUNDS GROUP	23,540	53,435.800	
	VIVA ENERGY REIT	39,300	88,032.000	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	18,120	77,553.600	
	PROPERTYLINK GROUP	49,060	49,795.900	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	1,512	1,398.600	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	74,350	179,183.500	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26,190	93,236.400	
	NATIONAL STORAGE REIT	44,140	69,961.900	
	INDUSTRIA REIT	11,760	30,458.400	
	GDI PROPERTY GROUP	41,860	54,836.600	
	SCENTRE GROUP	569,140	2,441,610.600	
	ARENA REIT	27,010	63,473.500	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15,310	51,135.400	
	BWP TRUST	51,670	165,344.000	
	DEXUS	107,880	1,102,533.600	
	GPT GROUP	190,370	1,016,575.800	
	INVESTA OFFICE FUND	50,660	239,621.800	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	33,790	145,972.800	
	MIRVAC GROUP	392,990	958,895.600	
	STOCKLAND	261,640	1,227,091.600	
	WESTFIELD CORP	205,450	1,920,957.500	
	ABACUS PROPERTY GROUP	34,450	144,690.000	
	GOODMAN GROUP	172,260	1,515,888.000	
	VICINITY CENTRES	346,530	980,679.900	

	CHARTER HALL GROUP	49,480	316,177.200	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	16,330	46,377.200	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 13,225,003.950 (1,139,598,591)	
カナダ・ドル	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7,700	109,109.000	カナダ・ドル
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	8,900	109,203.000	
	SLATE RETAIL REIT - U	1,700	22,015.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	3,500	49,525.000	
	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	700	8,330.000	
	SLATE OFFICE REIT	2,800	22,764.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	5,600	63,056.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	2,400	17,400.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2,200	110,044.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2,500	22,050.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,500	32,585.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	4,300	56,760.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,800	92,460.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,700	24,990.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,900	42,746.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6,600	205,722.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6,800	256,972.000	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	3,900	180,453.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	9,490	135,327.400	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	15,166	319,547.620	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2,300	31,395.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,800	419,328.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4,200	95,088.000		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,400	102,144.000		
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	2,300	58,259.000		
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3,700	51,578.000		
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	4,800	200,640.000		
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 2,839,491.020 (248,796,204)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	74,028	105,860.040	シンガポール・ドル
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	53,400	75,294.000	

	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	200,500	238,595.000	
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	73,900	100,504.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	120,300	137,142.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	269,975	504,853.250	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	251,300	673,484.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	285,300	604,836.000	
	SUNTEC REIT	244,300	517,916.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	211,900	279,708.000	
	KEPPEL REIT	184,700	230,875.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	52,760	74,919.200	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	134,300	162,503.000	
	ESR-REIT	117,379	65,732.240	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	76,400	126,824.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	54,400	119,680.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	126,900	97,713.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	51,100	81,760.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	36,300	105,996.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	165,200	68,558.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	119,380	241,147.600	
	CACHE LOGISTICS TRUST	100,200	84,669.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	202,000	329,260.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	70,200	50,193.000	
	SPH REIT	70,500	74,025.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	64,900	43,158.500	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	78,100	30,459.000	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	64,200	54,891.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	118,473	99,517.320	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 5,380,073.150 (449,558,913)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	29,160	51,030.000	
	INVESTORE PROPERTY LTD	10,250	14,965.000	
	ARGOSY PROPERTY LTD	71,630	78,793.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	145,350	204,216.750	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	34,800	76,560.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	107,550	150,570.000	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	100,590	135,796.500	

ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 711,931.250 (56,185,614)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	12,690	ユーロ 164,462.400
	HAMBORNER REIT AG	8,120	80,038.840
	WERELDHAVE NV	4,150	162,846.000
	UNIBAIL-RODAMCO SE	10,670	2,262,573.500
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	5,010	177,354.000
	NSI NV	1,731	60,688.860
	VASTNED RETAIL NV	1,480	61,079.600
	ICADE	4,850	395,178.000
	ALTAREA	350	69,930.000
	GECINA SA	4,931	729,048.350
	KLEPIERRE	22,300	793,991.500
	FONCIERE DES REGIONS	5,630	524,828.600
	MERCIALYS	5,660	100,861.200
	AEDIFICA	1,808	142,850.080
	COFINIMMO	2,080	228,488.000
	BEFIMMO	2,310	127,257.900
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1,230	27,238.350
	RETAIL ESTATES	660	48,371.400
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,670	154,274.600
	BENI STABILI SPA	109,650	84,156.370
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	30,400	33,136.000
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	9,600	83,721.600
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	34,400	283,249.600
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	11,170	170,677.600	
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	6,960	127,368.000	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	35,650	399,993.000	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	33,100	47,664.000	
GREEN REIT PLC	74,190	115,736.400	
HIBERNIA REIT PLC	70,990	106,485.000	
ユーロ 小計			ユーロ 7,763,548.750 (1,029,058,387)
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	103,000	香港・ドル 529,420.000
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	91,000	474,110.000
	FORTUNE REIT	140,000	1,331,400.000

	PROSPERITY REIT	124,000	409,200.000	
	LINK REIT	236,500	16,460,400.000	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	74,000	240,500.000	
	CHAMPION REIT	216,000	1,222,560.000	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 20,667,590.000 (298,233,323)	
投資証券	合計		13,832,110,951 [13,832,110,951]	
合計			13,878,160,330 [13,878,160,330]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 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	投資信託 1銘柄 受益証券 投資証券 158銘柄	0.5%	99.5%	71.4%
イギリス・ポンド	投資証券 27銘柄	-%	100%	5.5%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 28銘柄	-%	100%	8.2%
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	-%	100%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券 29銘柄	-%	100%	3.2%
ニュージーランド・ドル	投資証券 7銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 29銘柄	-%	100%	7.4%
香港・ドル	投資証券 7銘柄	-%	100%	2.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	84,027,735	163,546,995
国債証券	11,610,339,360	12,069,320,560
地方債証券	1,235,850,800	1,129,848,000
特殊債券	1,029,950,700	920,279,300
社債券	916,698,400	1,124,225,300
未収入金	105,201,200	-
未収利息	52,041,502	49,739,724
前払費用	1,193,873	925,410
流動資産合計	15,035,303,570	15,457,885,289
資産合計	15,035,303,570	15,457,885,289
負債の部		
流動負債		
未払金	104,477,000	82,295,170
未払解約金	33,763,707	3,237,000
流動負債合計	138,240,707	85,532,170
負債合計	138,240,707	85,532,170
純資産の部		
元本等		
元本	11,776,318,682	12,102,682,064
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,120,744,181	3,269,671,055
元本等合計	14,897,062,863	15,372,353,119
純資産合計	14,897,062,863	15,372,353,119
負債純資産合計	15,035,303,570	15,457,885,289

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20日 至 平成29年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	12,066,650,337円	11,776,318,682円
期中追加設定元本額	1,822,199,066円	2,838,779,099円
期中一部解約元本額	2,112,530,721円	2,512,415,717円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	34,845円	50,696円
iFree 日本債券イン デックス	43,708,353円	96,637,058円
iFree 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	87,248,594円	565,941,197円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,310,465,771円	5,146,920,747円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,079,954,504円	2,677,084,156円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/安定コース）	662,333,867円	858,932,360円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/6分散コー ス）	508,103,224円	614,116,560円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/成長コース）	413,870,204円	496,813,535円
	120,775,083円	154,223,264円

DC ダイワ・ターゲットイ ヤー2020	62,143,213円	62,710,608円
DC ダイワ・ターゲットイ ヤー2030	38,460,348円	46,788,441円
DC ダイワ・ターゲットイ ヤー2040	2,109,162円	3,511,254円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	2,476,281,789円	759,134,105円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	238,982,327円	221,878,439円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	271,158,712円	195,536,040円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	460,688,686円	202,403,604円
計	11,776,318,682円	12,102,682,064円
2. 期末日における受益権の総数	11,776,318,682口	12,102,682,064口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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12月19日現在	平成29年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	120,367,060	11,838,220
地方債証券	2,089,500	75,300
特殊債券	1,477,700	63,000
社債券	482,300	203,800
合計	124,416,560	11,496,120

（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12月1日から平成28年12月19日まで、及び平成29年12月1日から平成29年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.2650円	1.2702円
（1万口当たり純資産額）	（12,650円）	（12,702円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 7 3 2年国債	125,000,000	125,376,250	
	3 7 5 2年国債	100,000,000	100,343,000	
	3 7 6 2年国債	20,000,000	20,072,800	
	3 7 7 2年国債	25,000,000	25,096,750	
	3 8 0 2年国債	60,000,000	60,271,200	
	1 1 9 5年国債	41,000,000	41,150,470	
	1 2 0 5年国債	10,000,000	10,060,500	
	1 2 1 5年国債	55,000,000	55,236,500	
	1 2 2 5年国債	83,000,000	83,399,230	
	1 2 3 5年国債	100,000,000	100,540,000	
	1 2 4 5年国債	35,000,000	35,206,150	
	1 2 5 5年国債	150,000,000	150,972,000	
	1 2 6 5年国債	124,000,000	124,876,680	
	1 2 8 5年国債	137,000,000	138,082,300	
	1 2 9 5年国債	110,000,000	110,931,700	
	1 3 0 5年国債	127,000,000	128,122,680	
	1 3 1 5年国債	60,000,000	60,563,400	
	1 3 2 5年国債	20,000,000	20,203,400	
	1 3 3 5年国債	130,000,000	131,397,500	
	1 4 0年国債	60,000,000	85,567,200	
	2 4 0年国債	23,000,000	31,682,730	
	3 4 0年国債	19,000,000	26,290,300	
	4 4 0年国債	30,000,000	41,686,500	
	5 4 0年国債	35,000,000	46,729,900	
	6 4 0年国債	28,000,000	36,618,960	
	7 4 0年国債	31,000,000	38,676,220	
	8 4 0年国債	23,000,000	26,503,590	
	9 4 0年国債	30,000,000	24,848,100	
	1 0 4 0年国債	19,000,000	18,674,910	
	3 0 0 1 0年国債	8,000,000	8,164,320	
	3 0 1 1 0年国債	35,000,000	35,864,500	
	3 0 2 1 0年国債	54,000,000	55,252,800	

305	10年国債	100,000,000	102,888,000	
306	10年国債	10,000,000	10,345,800	
308	10年国債	100,000,000	103,584,000	
309	10年国債	103,000,000	106,175,490	
310	10年国債	30,000,000	30,931,500	
311	10年国債	42,000,000	43,072,260	
312	10年国債	94,000,000	97,764,700	
313	10年国債	34,000,000	35,585,080	
314	10年国債	77,000,000	80,087,700	
315	10年国債	90,000,000	94,190,400	
316	10年国債	56,000,000	58,410,240	
317	10年国債	40,000,000	41,846,400	
318	10年国債	33,000,000	34,398,870	
319	10年国債	140,000,000	146,893,600	
320	10年国債	35,000,000	36,582,700	
321	10年国債	65,000,000	68,121,300	
322	10年国債	140,000,000	146,125,000	
323	10年国債	70,000,000	73,229,100	
324	10年国債	80,000,000	83,328,800	
325	10年国債	160,000,000	166,992,000	
326	10年国債	20,000,000	20,814,400	
328	10年国債	60,000,000	62,264,400	
329	10年国債	50,000,000	52,502,500	
330	10年国債	81,000,000	85,216,050	
331	10年国債	73,000,000	75,955,040	
332	10年国債	35,000,000	36,467,550	
333	10年国債	53,000,000	55,297,020	
334	10年国債	156,000,000	162,982,560	
335	10年国債	140,000,000	145,510,400	
336	10年国債	18,000,000	18,734,760	
337	10年国債	30,000,000	30,802,200	
338	10年国債	152,000,000	157,259,200	
339	10年国債	45,000,000	46,558,800	
340	10年国債	130,000,000	134,551,300	
341	10年国債	15,000,000	15,415,350	
342	10年国債	40,000,000	40,446,400	
343	10年国債	152,000,000	153,617,280	
344	10年国債	48,000,000	48,483,360	
345	10年国債	150,000,000	151,417,500	

346	10年国債	143,000,000	144,255,540
347	10年国債	130,000,000	131,047,800
348	10年国債	150,000,000	151,093,500
2	30年国債	9,000,000	11,454,390
3	30年国債	4,000,000	5,057,280
4	30年国債	8,000,000	10,781,040
5	30年国債	8,000,000	10,116,480
6	30年国債	9,000,000	11,665,260
7	30年国債	12,000,000	15,476,160
8	30年国債	5,000,000	6,101,750
9	30年国債	11,000,000	12,791,900
10	30年国債	15,000,000	16,773,900
11	30年国債	9,000,000	10,882,170
12	30年国債	11,000,000	13,977,920
13	30年国債	11,000,000	13,823,260
14	30年国債	22,000,000	29,066,840
15	30年国債	21,000,000	28,130,130
16	30年国債	26,000,000	34,900,060
17	30年国債	17,000,000	22,573,620
18	30年国債	20,000,000	26,257,800
19	30年国債	15,000,000	19,709,100
20	30年国債	16,000,000	21,604,480
21	30年国債	16,000,000	21,068,960
22	30年国債	17,000,000	22,992,670
23	30年国債	16,000,000	21,656,640
24	30年国債	15,000,000	20,352,300
25	30年国債	17,000,000	22,465,500
26	30年国債	32,000,000	42,938,240
27	30年国債	32,000,000	43,621,760
28	30年国債	34,000,000	46,459,300
29	30年国債	43,000,000	58,140,730
30	30年国債	56,000,000	74,856,320
31	30年国債	38,000,000	50,180,520
32	30年国債	49,000,000	65,930,970
33	30年国債	55,000,000	70,767,950
34	30年国債	50,000,000	66,592,500
35	30年国債	56,000,000	72,297,680
36	30年国債	59,000,000	76,241,570
37	30年国債	57,000,000	72,577,530

3 8	3 0 年国債	39,000,000	48,832,680	
3 9	3 0 年国債	37,000,000	47,219,400	
4 0	3 0 年国債	29,000,000	36,356,430	
4 1	3 0 年国債	29,000,000	35,692,910	
4 2	3 0 年国債	33,000,000	40,632,240	
4 3	3 0 年国債	37,000,000	45,575,860	
4 4	3 0 年国債	42,000,000	51,754,500	
4 5	3 0 年国債	28,000,000	33,161,800	
4 6	3 0 年国債	40,000,000	47,376,400	
4 7	3 0 年国債	44,000,000	53,192,920	
4 8	3 0 年国債	45,000,000	52,137,450	
4 9	3 0 年国債	45,000,000	52,130,250	
5 0	3 0 年国債	44,000,000	44,306,240	
5 1	3 0 年国債	45,000,000	39,503,250	
5 2	3 0 年国債	47,000,000	43,601,900	
5 3	3 0 年国債	40,000,000	38,072,000	
5 4	3 0 年国債	45,000,000	45,106,650	
5 5	3 0 年国債	32,000,000	32,038,080	
5 6	3 0 年国債	50,000,000	50,000,000	
4 1	2 0 年国債	40,000,000	40,824,000	
4 2	2 0 年国債	22,000,000	22,754,160	
4 3	2 0 年国債	14,000,000	14,748,160	
4 4	2 0 年国債	32,000,000	33,899,840	
4 5	2 0 年国債	20,000,000	21,142,400	
4 6	2 0 年国債	19,000,000	20,112,070	
4 7	2 0 年国債	23,000,000	24,480,740	
4 8	2 0 年国債	9,000,000	9,714,960	
4 9	2 0 年国債	4,000,000	4,291,280	
5 0	2 0 年国債	30,000,000	31,988,700	
5 1	2 0 年国債	25,000,000	26,868,250	
5 2	2 0 年国債	19,000,000	20,590,300	
5 3	2 0 年国債	13,000,000	14,159,860	
5 4	2 0 年国債	14,000,000	15,305,360	
5 5	2 0 年国債	41,000,000	44,712,140	
5 6	2 0 年国債	12,000,000	13,147,680	
5 7	2 0 年国債	24,000,000	26,180,880	
5 8	2 0 年国債	35,000,000	38,359,650	
5 9	2 0 年国債	3,000,000	3,273,000	
6 1	2 0 年国債	40,000,000	42,331,600	

6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,791,520	
6 3	2 0 年国債	30,000,000	33,142,200	
6 4	2 0 年国債	35,000,000	39,037,250	
6 5	2 0 年国債	42,000,000	47,041,680	
6 6	2 0 年国債	30,000,000	33,420,300	
6 7	2 0 年国債	19,000,000	21,368,350	
6 8	2 0 年国債	25,000,000	28,587,250	
6 9	2 0 年国債	12,000,000	13,646,520	
7 0	2 0 年国債	18,000,000	20,916,000	
7 1	2 0 年国債	17,000,000	19,531,980	
7 2	2 0 年国債	53,000,000	60,800,540	
7 3	2 0 年国債	30,000,000	34,368,300	
7 4	2 0 年国債	22,000,000	25,358,080	
7 5	2 0 年国債	14,000,000	16,200,800	
7 6	2 0 年国債	25,000,000	28,566,250	
7 8	2 0 年国債	17,000,000	19,509,710	
7 9	2 0 年国債	14,000,000	16,172,240	
8 0	2 0 年国債	20,000,000	23,254,000	
8 1	2 0 年国債	65,000,000	75,367,500	
8 2	2 0 年国債	28,000,000	32,683,840	
8 5	2 0 年国債	31,000,000	36,473,670	
8 6	2 0 年国債	6,000,000	7,158,660	
8 7	2 0 年国債	20,000,000	23,696,800	
8 8	2 0 年国債	33,000,000	39,534,330	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	17,842,350	
9 0	2 0 年国債	37,000,000	44,180,960	
9 1	2 0 年国債	12,000,000	14,434,080	
9 2	2 0 年国債	45,000,000	53,528,850	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	21,328,740	
9 4	2 0 年国債	45,000,000	53,737,650	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	36,519,300	
9 6	2 0 年国債	23,000,000	27,561,590	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	30,303,750	
9 8	2 0 年国債	34,000,000	40,881,940	
9 9	2 0 年国債	53,000,000	63,938,140	
1 0 0	2 0 年国債	35,000,000	42,693,000	
1 0 1	2 0 年国債	18,000,000	22,334,940	
1 0 2	2 0 年国債	10,000,000	12,447,700	
1 0 3	2 0 年国債	21,000,000	25,921,140	

104	20年国債	34,000,000	41,257,640	
105	20年国債	38,000,000	46,255,500	
106	20年国債	16,000,000	19,646,880	
107	20年国債	20,000,000	24,418,400	
108	20年国債	48,000,000	57,556,800	
109	20年国債	35,000,000	42,076,650	
110	20年国債	27,000,000	33,060,690	
111	20年国債	35,000,000	43,380,050	
112	20年国債	29,000,000	35,613,450	
113	20年国債	64,000,000	78,774,400	
114	20年国債	45,000,000	55,539,900	
115	20年国債	22,000,000	27,413,100	
116	20年国債	27,000,000	33,737,310	
117	20年国債	37,000,000	45,786,390	
118	20年国債	13,000,000	15,960,360	
119	20年国債	13,000,000	15,641,210	
120	20年国債	60,000,000	70,716,600	
121	20年国債	56,000,000	68,175,520	
122	20年国債	10,000,000	12,049,300	
123	20年国債	42,000,000	52,309,740	
124	20年国債	45,000,000	55,473,750	
125	20年国債	25,000,000	31,533,500	
126	20年国債	21,000,000	25,944,870	
127	20年国債	23,000,000	28,118,190	
128	20年国債	32,000,000	39,175,680	
129	20年国債	34,000,000	41,177,060	
130	20年国債	28,000,000	33,972,680	
131	20年国債	27,000,000	32,398,110	
132	20年国債	25,000,000	30,025,000	
133	20年国債	47,000,000	57,124,270	
134	20年国債	15,000,000	18,261,150	
135	20年国債	20,000,000	24,055,600	
136	20年国債	40,000,000	47,559,200	
137	20年国債	18,000,000	21,682,080	
138	20年国債	24,000,000	28,217,040	
139	20年国債	32,000,000	38,070,720	
140	20年国債	60,000,000	72,325,200	
141	20年国債	48,000,000	57,895,200	
142	20年国債	30,000,000	36,643,200	

	1 4 3	2 0 年国債	48,000,000	57,264,480	
	1 4 4	2 0 年国債	24,000,000	28,260,720	
	1 4 5	2 0 年国債	65,000,000	78,534,950	
	1 4 6	2 0 年国債	58,000,000	70,159,700	
	1 4 7	2 0 年国債	74,000,000	88,416,680	
	1 4 8	2 0 年国債	59,000,000	69,590,500	
	1 4 9	2 0 年国債	67,000,000	79,017,790	
	1 5 0	2 0 年国債	56,000,000	65,200,240	
	1 5 1	2 0 年国債	64,000,000	72,380,160	
	1 5 2	2 0 年国債	69,000,000	77,968,620	
	1 5 3	2 0 年国債	72,000,000	82,529,280	
	1 5 4	2 0 年国債	67,000,000	75,632,280	
	1 5 5	2 0 年国債	59,000,000	64,510,600	
	1 5 6	2 0 年国債	63,000,000	62,153,910	
	1 5 7	2 0 年国債	77,000,000	73,088,400	
	1 5 8	2 0 年国債	63,000,000	62,945,820	
	1 5 9	2 0 年国債	60,000,000	60,882,600	
	1 6 0	2 0 年国債	54,000,000	55,700,460	
	1 6 1	2 0 年国債	69,000,000	69,730,020	
	1 6 2	2 0 年国債	60,000,000	60,480,000	
国債証券 合計				12,069,320,560	
地方債証券	7 5 1	東京都公債	100,000,000	102,150,800	
	2 1 - 3 5	兵庫県公債	100,000,000	102,953,800	
	3	兵庫県公債 1 2 年	100,000,000	103,349,200	
	2 8 - 1	静岡県公債	100,000,000	99,673,200	
	2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	103,619,400	
	2 1 - 2	埼玉県公債	100,000,000	102,204,400	
	7 6	共同発行地方	100,000,000	102,177,800	
	1 1 6	共同発行地方	100,000,000	103,706,900	
	1 1 7	共同発行地方	100,000,000	103,363,400	
	2 1 - 6	大阪市公債	100,000,000	102,961,800	
	2 5 - 6	大阪市公債	100,000,000	103,687,300	
地方債証券 合計				1,129,848,000	
特殊債券	5	日本政策投資 C O	100,000,000	102,130,700	
	9 8	政保道路機構	100,000,000	102,715,900	
	1 2 2	政保道路機構	100,000,000	102,598,000	
	1 9 0	政保道路機構	100,000,000	103,226,500	
	2 6 1	政保道路機構	100,000,000	102,543,900	
	3 6	地方公共団体	100,000,000	103,710,400	

	1 4 政保地方公共 6	100,000,000	100,439,700	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	102,977,900	
	い 7 8 9 利付商工債	100,000,000	99,936,300	
特殊債券	合計		920,279,300	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,215,400	
	2 5 東日本高速道	100,000,000	100,312,400	
	2 7 東日本高速道	100,000,000	100,296,000	
	3 3 中日本高速道	100,000,000	103,643,600	
	1 明治安田 2 0 1 4 基	100,000,000	100,397,300	
	3 5 みずほ B K	100,000,000	100,292,500	
	6 2 トヨタファイナンス	100,000,000	100,300,500	
	1 6 4 オリックス	100,000,000	101,769,500	
	4 4 野村ホールディング	100,000,000	101,634,700	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	113,238,100	
	7 0 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,125,300	
社債券	合計		1,124,225,300	
合計			15,243,673,160	

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12月19日現在	平成29年12月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	305,109,849	123,036,300
コール・ローン	406,948,440	793,027,061
国債証券	157,499,588,611	165,664,776,804
派生商品評価勘定	12,516,966	1,926,259
未収利息	1,215,567,069	1,252,417,864
前払費用	30,994,874	26,076,341

流動資産合計		159,470,725,809	167,861,260,629
資産合計		159,470,725,809	167,861,260,629
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	1,432,087
未払解約金		169,556,883	54,270,025
流動負債合計		169,556,883	55,702,112
負債合計		169,556,883	55,702,112
純資産の部			
元本等			
元本	1	58,881,648,354	59,323,594,737
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		100,419,520,572	108,481,963,780
元本等合計		159,301,168,926	167,805,558,517
純資産合計		159,301,168,926	167,805,558,517
負債純資産合計		159,470,725,809	167,861,260,629

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20日 至 平成29年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
----------------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	57,214,334,756円	58,881,648,354円
期中追加設定元本額	5,154,067,833円	6,379,737,514円
期中一部解約元本額	3,486,754,235円	5,937,791,131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	1,415,320,560円	937,476,924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	31,459,334円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	337,557,046円	232,118,354円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	78,887,258円	64,271,557円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,120,399,794円	758,526,259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)	61,945,238円	257,923,135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)	128,166,415円	551,455,042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	406,568,796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	78,031,637円	592,031,307円
iFree 8資産バランス	41,183,907円	253,214,157円
DCダイワ外国債券インデッ クス	37,918,206,213円	39,940,525,208円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	586,993,041円	632,009,821円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	260,230,135円	300,452,088円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	160,681,582円	192,336,290円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	251,367,408円	273,754,216円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	201,924,480円	221,997,497円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	60,112,470円	68,923,747円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	12,290,657円	11,218,839円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	15,684,745円	17,808,259円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	932,613円	1,323,903円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,682,564,879円	480,519,859円

ダイワ世界バランスファンド 60VA	193,317,673円	167,029,144円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	7,166,577,248円	6,370,904,816円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	519,632,367円	349,081,593円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	334,968,931円	135,747,380円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	393,370,357円	349,320,791円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	103,674,791円	127,522,458円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	8,299,785円	20,761,833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	5,596,721,299円	5,465,139,568円
ダイワライフスタイル25	34,708,067円	34,460,276円
ダイワライフスタイル50	55,186,341円	59,917,401円
ダイワライフスタイル75	14,379,536円	16,517,496円
計	58,881,648,354円	59,323,594,737円
2. 期末日における受益権の総数	58,881,648,354口	59,323,594,737口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>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。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成28年12月19日現在	平成29年12月18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)
国債証券	1,427,392,937	656,591,608
合計	1,427,392,937	656,591,608

(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12月1日から平成28年12月19日まで、及び平成29年12月1日から平成29年12月18日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成28年12月19日 現在				平成29年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	325,129,314	-	337,646,280	12,516,966	785,504,328	-	785,998,500	494,172
アメリカ・ドル	210,905,918	-	220,040,040	9,134,122	315,000,980	-	316,293,600	1,292,620
イギリス・ポンド	8,712,427	-	9,103,460	391,033	87,408,770	-	87,156,600	252,170
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	11,529,794	-	11,697,360	167,566
カナダ・ドル	10,550,171	-	11,101,860	551,689	16,170,933	-	16,278,720	107,787
シンガポール・ドル	2,763,722	-	2,847,250	83,528	8,296,250	-	8,343,000	46,750
スイス・フラン	1,669,693	-	1,719,900	50,207	-	-	-	-
スウェーデン・クローナ	3,224,261	-	3,308,540	84,279	-	-	-	-
デンマーク・クローネ	4,979,808	-	5,113,950	134,142	8,895,027	-	8,869,380	25,647
ノルウェー・クローネ	1,884,240	-	1,939,080	54,840	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	3,985,788	-	4,104,040	118,252	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	6,030,456	-	6,377,490	347,034	-	-	-	-
ユーロ	66,843,880	-	68,276,100	1,432,220	338,202,574	-	337,359,840	842,734

南アフリカ・ ランド	3,578,950	-	3,714,570	135,620	-	-	-	-
合計	325,129,314	-	337,646,280	12,516,966	785,504,328	-	785,998,500	494,172

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成28年12月19日現在	平成29年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.7054円	2.8286円
(1万口当たり純資産額)	(27,054円)	(28,286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	2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	アメリカ・ドル 3,161,000.000	アメリカ・ドル 3,196,434.810	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,096,000.000	3,152,471.040	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,621,000.000	2,697,873.930	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,136,499.600	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	4,280,000.000	4,439,986.400	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,189,313.050	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,906,713.380	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,595,121.900	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,280,737.480	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,645,055.370	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,541,500.640	
2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,148,952.360	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,165,000.000	2,157,877.150	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,861,000.000	1,853,649.050	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,426,000.000	1,417,800.500	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,214,650.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190228	1,843,000.000	1,834,208.890	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190331	300,000.000	298,908.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190430	559,000.000	554,868.990	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,423,442.860	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,362,247.100	

1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,351,433.520	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,784,000.000	1,757,436.240	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,487,867.760	
1% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,872,000.000	1,846,185.120	
1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,182,705.300	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	874,567.720	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,091,619.520	
1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,331,216.700	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,866,764.280	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,352,490.260	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,313,938.500	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,942,317.600	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,140,651.200	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,582,492.200	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,425,709.070	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,430,606.650	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,129,827.950	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,833,841.340	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	2,768,000.000	2,814,474.720	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	2,003,881.780	

2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,889,109.300	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,333,087.400	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,172,784.830	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,638,000.000	2,626,129.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,504,701.480	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20181231	2,026,000.000	2,020,772.920	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,030,754.040	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,381,373.060	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190131	2,185,000.000	2,178,160.950	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,654,839.720	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,373,000.000	2,365,287.750	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,734,797.640	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190331	2,383,000.000	2,377,590.590	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,843,257.690	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,412,000.000	5,489,770.440	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190430	2,975,000.000	2,968,246.750	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,425,991.230	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,241,000.000	2,230,825.860	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,730,278.840	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2,885,000.000	2,876,633.500	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,496,430.800	
8.875% United States Treasury Note/Bond 20190215	904,000.000	978,959.680	
8.125% United States Treasury Note/Bond 20190815	724,000.000	798,289.640	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	755,723.880	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,575,553.760	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	795,218.220	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,089,517.950	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	841,194.900	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	945,210.440	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	905,569.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	941,119.740	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	605,383.240	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,362,247.680	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	991,000.000	1,323,678.700	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,626,000.000	2,113,539.840	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	757,124.580	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	707,002.200	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	680,943.570	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	849,000.000	978,073.470	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,429,353.470	

4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	760,000.000	1,001,353.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,570,156.500	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,293,657.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,922,079.880	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,933,558.210	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,882,611.640	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,402,839.680	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,782,812.850	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,635,478.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,574,033.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,761,328.290	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,437,454.260	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,759,388.400	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,671,895.900	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,026,000.000	2,196,771.540	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,998,000.000	4,151,043.440	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,610,249.920	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,308,372.720	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,267,481.280	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,142,393.610	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,315,855.700	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,854,348.120	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,162,000.000	5,195,036.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	4,047,680.340	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190831	2,989,000.000	2,978,359.160	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,298,554.120	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,398,383.400	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,633,772.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,169,934.900	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,157,419.460	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	3,921,000.000	3,914,530.350	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,924,080.160	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,866,808.100	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,295,763.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,175,179.550	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,193,663.240	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,912,828.420	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,370,305.280	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,633,021.550	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,624,220.560	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,757,917.480	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,784,126.250	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,760,785.440	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,848,762.490	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,721,032.840	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	4,070,162.200	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,576,028.840	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,572,402.080	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,797,937.820	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,984,738.060	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,980,833.280	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,820,774.320	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,112,459.350	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,166,383.590	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,620,961.250	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,701,092.050	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,415,562.200	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,827,417.800	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,427,182.640	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,833,521.480	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,813,486.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,067,296.920	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,934,692.650	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,525,820.360	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,066,959.520	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	2,687,000.000	2,667,250.550	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181215	2,151,000.000	2,140,481.610	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,023,981.250	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	2,492,000.000	2,487,315.040	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190115	2,146,000.000	2,131,664.720	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,068,825.460	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,087,611.920	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	2,065,000.000	2,040,715.600	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,508,960.480	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,298,353.040	
1% United States Treasury Note/Bond 20190315	2,100,000.000	2,079,399.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,220,318.800	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,262,000.000	2,187,240.900	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,930,222.180	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,051,178.910	

0.875% United States Treasury Note/Bond 20190415	1,905,000.000	1,882,140.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,029,000.000	5,703,011.970	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,399,064.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,011,294.800	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,289,811.070	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190515	2,507,000.000	2,474,960.540	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,641,761.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,427,525.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190615	2,100,000.000	2,071,356.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,423,025.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,872,260.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190715	2,500,000.000	2,458,100.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,232,472.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,172,750.800	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,500,000.000	2,456,150.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,577,715.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,582,044.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,641,000.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,293,488.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190915	2,600,000.000	2,557,022.000	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,392,074.600	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,938,602.420	
1% United States Treasury Note/Bond 20191015	2,147,000.000	2,114,709.120	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,347,430.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,909,280.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,419,900.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,650,000.000	3,782,860.000	
1% United States Treasury Note/Bond 20191115	1,400,000.000	1,377,950.000	
1% United States Treasury Note/Bond 20181130	1,000,000.000	993,320.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,477,350.800	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,369,808.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20191215	1,440,000.000	1,426,435.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	1,992,960.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,400,000.000	1,392,832.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,502,325.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200115	1,500,000.000	1,485,405.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,700,000.000	1,688,032.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	4,040,000.000	4,005,579.200	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	2,982,940.100	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,481,537.600	

3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,875,000.000	4,116,877.500	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,130,000.000	2,107,613.700	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,300,000.000	2,282,106.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	2,982,007.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,284,176.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315	1,900,000.000	1,889,379.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190331	1,850,000.000	1,837,198.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,250,000.000	4,218,422.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	900,000.000	891,063.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200415	850,000.000	842,528.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,710,203.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,700,000.000	2,869,803.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	2,968,800.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,954,280.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	4,000,000.000	3,963,560.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	2,952,180.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190531	4,000,000.000	3,968,560.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	2,000,000.000	1,968,740.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615	2,700,000.000	2,674,350.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190630	4,000,000.000	3,965,760.000	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	2,950,530.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,361,360.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715	2,000,000.000	1,979,600.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,000,000.000	992,770.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,844,186.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815	1,300,000.000	1,286,129.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,866,012.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,973,750.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,800,000.000	2,832,368.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,100,000.000	2,051,427.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190831	600,000.000	594,066.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,952,020.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915	1,000,000.000	985,970.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,468,750.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190930	1,000,000.000	991,830.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,400,000.000	3,367,564.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015	1,000,000.000	991,600.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,482,800.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	2,300,000.000	2,278,610.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	1,800,000.000	1,822,356.000	

	2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,494,505.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20201115	3,600,000.000	3,580,452.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 632,943,974.800 (71,370,762,599)	
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	2,368,942.800	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	2,121,000.000	2,282,217.210	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,549,699.950	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,432,000.000	1,904,416.800	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,517,417.700	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	610,000.000	604,363.600	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	460,000.000	437,092.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	200,000.000	201,600.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	600,000.000	631,260.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	810,000.000	814,463.100	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	500,000.000	497,475.000	
	8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,383,946.700	
	6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,413,820.200	
	4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,823,874.000	
	5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,892,285.440	
	4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,872,638.400	

4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,247,859.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,888,469.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	3,001,810.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,276,688.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,589,908.320	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,596,000.000	2,491,036.800	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,480,000.000	2,071,556.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,487,972.800	
4.5% United Kingdom Gilt 20190307	873,000.000	916,414.290	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,821,776.600	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,577,400.980	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,870,000.000	2,672,978.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,428,000.000	1,509,538.800	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,244,000.000	2,184,464.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,953,695.950	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,335,694.700	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	1,633,000.000	1,824,077.330	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,352,000.000	2,107,227.200	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,350,849.100	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,066,000.000	2,712,658.000	

	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,098,039.700	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,752,458.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20190722	2,251,000.000	2,297,685.740	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,842,000.000	2,064,182.040	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	2,925,385.200	
	イギリス・ボンド 小計		イギリス・ボンド 78,355,340.450 (11,776,807,669)	
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	2,557,643.550	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,420,000.000	2,710,206.400	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,409,000.000	2,547,276.600	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,493,802.140	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,401,589.080	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,071,822.610	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,532,178.890	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,314,000.000	1,395,704.520	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,532,839.540	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,358,000.000	1,644,728.120	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,229,375.680	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	2,011,000.000	2,042,150.390	

	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	863,000.000	957,265.490	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	542,222.790	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,176,781.500	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	712,000.000	729,899.680	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,142,000.000	2,184,390.180	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,978,000.000	1,922,002.820	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	932,000.000	887,347.880	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	700,000.000	695,674.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,200,000.000	2,233,242.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	100,000.000	99,972.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 41,588,115.860 (3,583,647,943)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 425,000.000	カナダ・ドル 508,776.000	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	591,880.820	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,370,419.960	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,685,575.010	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,630,792.480	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1,524,000.000	1,573,316.640	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,831,817.480	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,876,000.000	1,962,258.480	

3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	1,007,920.360	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,833,629.690	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	2,008,242.110	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,239,830.970	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,469,489.500	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190301	853,000.000	856,343.760	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,627,000.000	1,633,068.710	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,197,000.000	1,368,290.700	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,194,529.480	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,719,000.000	1,716,232.410	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,831,000.000	1,790,553.210	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,102,400.760	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,237,000.000	1,203,477.300	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,434,164.400	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,150,534.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840,000.000	801,150.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190201	1,620,000.000	1,603,557.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190501	900,000.000	891,162.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	700,000.000	678,825.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190801	1,360,000.000	1,343,040.800	

	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20191101	500,000.000	497,250.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	607,200.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	600,000.000	601,410.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,600,000.000	1,589,184.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 40,776,323.030 (3,572,821,424)	
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	727,180.800	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	872,676.520	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	466,689.000	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	599,000.000	607,811.290	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	667,731.400	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	387,720.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	505,147.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	431,600.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	516,777.500	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	368,000.000	422,103.360	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	135,500.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	415,000.000	415,747.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	124,000.000	128,092.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	226,598.400	

	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	318,000.000	343,945.620	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	254,375.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	190,000.000	187,283.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	200,782.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	150,000.000	149,601.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 7,647,361.390 (639,013,517)	
スイス・フラン	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	404,000.000	499,788.400	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	497,000.000	711,902.800	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	517,000.000	545,776.220	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	407,000.000	438,912.870	
	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	362,000.000	395,224.360	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 2,591,604.650 (294,535,869)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,095,000.000	10,577,121.200	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	8,385,000.000	8,916,776.700	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,745,866.400	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,858,423.650	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,616,505.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,919,829.550	

	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	5,934,804.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,950,000.000	2,959,735.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 57,529,062.300 (763,985,947)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	19,875,122.640	デンマーク・クローネ
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	9,366,230.970	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	8,050,000.000	9,122,662.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,308,599.160	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	8,363,000.000	9,454,287.870	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	2,600,000.000	2,632,708.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	1,500,000.000	1,533,480.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 57,293,091.140 (1,020,389,953)	
ノルウェー・クローネ	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	7,075,000.000	7,482,873.750	ノルウェー・クローネ
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,679,255.300	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,224,000.000	5,465,401.040	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,530,912.750	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,491,723.550	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,365,050.000	

	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,526,452.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 35,541,668.390 (478,390,857)	
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	2,641,726.900	
	5.5% Poland Government Bond 20191025	1,912,000.000	2,046,796.000	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,478,000.000	2,461,397.400	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,218,449.850	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,113,812.600	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	2,999,438.100	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,370,000.000	2,230,170.000	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,301,904.000	
	Poland Government Bond 20190425	400,000.000	392,100.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	1,300,000.000	1,291,680.000	
	Poland Government Bond 20200725	300,000.000	285,900.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,035,321.300	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,461,747.200	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,223,836.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,377,301.250	
	3.25% Poland Government Bond 20190725	1,840,000.000	1,890,600.000	
3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,627,662.650		

ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 33,599,843.250 (1,057,723,066)	
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	673,468.770	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	536,895.270	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	788,914.620	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,638,266.000	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,176,185.880	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,961,984.000	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,540,177.060	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	650,000.000	637,000.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	863,152.500	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	706,438.400	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	594,719.940	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,044,000.000	1,047,925.440	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	985,985.000	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	477,000.000	446,624.640	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	557,784.100	
3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	664,318.080		
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	602,988.000		
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,072,241.940		

4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	869,452.210	
3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	648,000.000	654,006.960	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	733,315.000	
3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	705,474.000	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,161,580.500	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	787,905.200	
3.759% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190315	768,000.000	774,650.880	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	700,245.000	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	910,218.900	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	639,580.500	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	353,408.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500,000.000	504,875.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	755,895.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	350,000.000	347,683.000	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	500,000.000	509,610.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 26,902,969.790 (742,521,966)	
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	20,520,060.660	
5.75% Mexican Bonos 20260305	13,290,000.000	11,919,269.400	
8% Mexican Bonos 20471107	4,000,000.000	4,119,840.000	
8% Mexican Bonos 20231207	10,633,000.000	10,934,870.870	
10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	25,236,009.480	
7.5% Mexican Bonos 20270603	10,668,000.000	10,692,109.680	

10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	8,480,178.840	
8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	9,541,437.840	
8.5% Mexican Bonos 20181213	22,092,000.000	22,308,501.600	
8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	10,513,821.580	
8% Mexican Bonos 20200611	18,928,000.000	19,192,992.000	
6.5% Mexican Bonos 20210610	27,826,000.000	27,060,506.740	
7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,256,298.100	
6.5% Mexican Bonos 20220609	13,099,000.000	12,651,407.170	
7.75% Mexican Bonos 20421113	15,654,000.000	15,715,989.840	
7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	7,050,382.080	

メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 229,193,675.880 (1,356,826,562)
ユーロ		ユーロ	ユーロ
0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000		443,309.760
0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000		415,457.280
0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000		293,800.950
0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000		419,224.110
Finland Government Bond 20230915	200,000.000		200,904.000
Finland Government Bond 20220415	270,000.000		273,588.300
0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000		301,146.000
0.25% Austria Government Bond 20191018	527,000.000		535,263.360
1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000		941,163.840
0.75% Austria Government Bond 20261020	926,000.000		957,521.040
1.5% Austria Government Bond 20470220	734,000.000		759,719.360
1.5% Austria Government Bond 20861102	150,000.000		138,357.000

Austria Government Bond 20230715	300,000.000	301,350.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	582,569.400	
2.1% Austria Government Bond 21170920	170,000.000	191,632.500	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	405,084.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,463,437.940	
1% Belgium Government Bond 20310622	924,000.000	940,835.280	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	627,024.600	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,355,758.930	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	744,000.000	757,830.960	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	190,000.000	211,555.500	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	150,000.000	152,413.500	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,000,000.000	1,028,650.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	650,000.000	668,629.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	260,000.000	300,050.400	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	314,163.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,354,269.080	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,567,000.000	2,491,294.950	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,079,951.060	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,817,062.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,599,192.090	

5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,357,865.280	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,899,107.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,240,783.640	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,040,776.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,506,042.690	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	2,811,513.780	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,647,574.340	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,246,208.250	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,110,176.720	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	2,214,729.220	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,559,187.880	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,557,201.300	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,902,166.200	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,562,711.850	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	3,091,377.170	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,442,733.480	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,728,000.000	2,323,399.680	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,791,450.360	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,542,201.600	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,991,432.000	

2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,801,321.470	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,745,572.640	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,959,000.000	2,664,377.130	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,760,493.300	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,654,751.040	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,278,534.820	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,295,415.760	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,242,319.040	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,812,351.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,603,888.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	700,000.000	713,419.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	400,000.000	415,464.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20181214	950,000.000	957,590.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20190315	1,000,000.000	1,010,230.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20190614	400,000.000	404,900.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20190913	100,000.000	101,339.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20191213	1,000,000.000	1,014,540.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190222	1,438,000.000	1,468,945.760	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190412	1,113,000.000	1,132,355.070	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,172,305.010	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,759,319.160	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,485,097.760	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,608,360.720	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,427,258.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	360,000.000	366,742.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	400,000.000	406,604.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	764,937.260	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,444,926.050	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,225,000.000	3,250,502.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	4,021,268.840	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,703,830.250	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,709,000.000	4,310,371.170	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,075,000.000	3,281,301.750	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,364,000.000	2,255,455.840	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,690,436.500	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,824,000.000	4,281,240.480	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,697,000.000	4,646,907.180	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,734,000.000	4,499,371.140	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	3,263,000.000	3,532,719.580	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,380,000.000	3,706,237.600	

4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	1,984,950.300	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,997,276.140	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,383,831.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,550,000.000	4,052,822.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	4,157,330.100	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,499,000.000	4,255,518.790	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	3,019,650.720	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,238,000.000	3,135,147.060	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,693,414.500	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,535,321.600	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190525	2,264,000.000	2,318,449.200	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,355,548.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,794,031.780	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2,322,000.000	2,373,710.940	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2,792,000.000	2,865,820.480	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3,070,000.000	3,111,936.200	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,101,000.000	2,230,064.430	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,240,105.640	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	3,420,000.000	3,690,658.800	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20190225	1,592,000.000	1,605,086.240	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,737,000.000	2,782,352.090	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,079,000.000	1,091,548.770	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	587,000.000	590,263.720	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,170,000.000	2,200,922.500	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,400,000.000	2,371,200.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	2,000,000.000	2,023,460.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	620,000.000	674,758.400	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200225	700,000.000	708,939.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,619,950.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,300,000.000	1,431,976.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	500,000.000	503,355.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	500,000.000	506,140.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	764,816.200	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,866,925.200	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,111,455.850	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	953,416.030	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,347,000.000	1,448,887.080	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,268,736.600	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,349,000.000	2,155,121.930	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,661,865.590	

2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,610,488.100	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,462,277.600	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,534,455.350	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115	924,000.000	944,180.160	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,084,000.000	1,526,738.120	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,717,178.800	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,401,438.780	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,304,064.920	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,367,355.720	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,218,996.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,239,528.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	200,000.000	200,748.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,616,153.560	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,628,991.600	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,410,800.640	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,965,577.840	
1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,481,529.600	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,510,910.280	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,691,227.800	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,702,587.880	

1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,634,884.200	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,540,524.940	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,591,000.000	1,652,730.800	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,565,784.320	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	788,698.260	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,362,081.600	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,387,166.460	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,287,093.100	
0.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190415	812,000.000	816,563.440	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,692,949.680	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	881,505.240	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,517,008.640	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	689,871.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,363,228.300	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	648,000.000	583,109.280	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191015	858,000.000	862,839.120	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	700,000.000	702,891.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,010,000.000	2,086,882.500	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	300,000.000	314,235.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	350,000.000	361,452.000	

0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	120,000.000	121,316.400	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	600,000.000	645,288.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,000,000.000	1,021,980.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	711,921.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	700,000.000	710,353.000	
0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015	100,000.000	100,592.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,454,000.000	3,284,139.120	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,100,565.700	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,655,000.000	2,363,257.250	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190201	2,074,000.000	2,181,474.680	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,113,119.210	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,363,781.820	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,376,346.400	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	3,084,252.740	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,734,000.000	2,360,147.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,738,476.560	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190301	2,708,000.000	2,865,470.200	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	2,531,000.000	2,727,557.460	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,660,313.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,761,829.550	

4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,811,929.600	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,456,676.540	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,549,619.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,396,284.480	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,662,018.240	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,399,108.800	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	2,039,253.330	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,358,468.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,810,000.000	2,302,392.400	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,266,663.440	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,363,000.000	1,810,922.690	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,651,339.300	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20181201	2,111,000.000	2,189,296.990	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,940,197.350	
2.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190501	1,100,000.000	1,142,922.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,567,378.460	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,222,343.360	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,709,034.120	
1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	1,246,000.000	1,283,080.960	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,573,842.200	

5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,792,856.000	
4% Belgium Government Bond 20220328	1,377,000.000	1,637,555.940	
4% Belgium Government Bond 20190328	821,000.000	869,972.650	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	1,945,292.160	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,686,167.360	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,704,270.060	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,354,613.260	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,603,072.240	
4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	970,094.800	
3% Belgium Government Bond 20190928	1,123,000.000	1,195,467.190	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,517,385.660	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	753,000.000	1,155,711.930	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,759,751.350	
3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	777,186.540	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	684,000.000	735,867.720	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	570,000.000	638,542.500	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,544,697.180	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	887,231.700	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	608,927.760	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	731,435.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	892,006.150	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	539,029.080	
2% IRISH TREASURY 20450218	681,000.000	740,362.770	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,117,111.030	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	350,000.000	370,359.500	
IRISH TREASURY 20221018	50,000.000	50,276.500	

4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,035,000.000	1,159,965.900	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,287,024.750	
3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,390,783.680	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,535,999.080	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,073,000.000	1,662,302.330	
4.35% Austria Government Bond 20190315	989,000.000	1,050,525.690	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,211,271.250	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	935,303.410	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	1,029,448.320	
3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	553,987.800	
1.95% Austria Government Bond 20190618	738,000.000	766,442.520	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	890,883.770	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,062,898.060	
2.4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	759,414.690	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,033,932.840	
4.375% Finland Government Bond 20190704	416,000.000	448,735.040	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	859,422.830	
3.375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	690,744.400	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	519,900.120	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	479,314.130	
1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	667,434.960	

1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	485,078.520	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	550,980.320	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	595,368.340	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,952,000.000	2,826,769.280	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,836,734.650	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,552,000.000	1,579,470.400	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,943,567.360	
1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,250,000.000	1,293,125.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,843,704.040	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190131	1,672,000.000	1,683,887.920	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,793,994.300	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,052,000.000	1,097,477.960	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	850,000.000	944,137.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,730,000.000	1,742,006.200	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	580,000.000	586,559.800	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	1,825,452.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	550,000.000	569,602.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,800,000.000	1,799,190.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	300,000.000	301,056.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	300,000.000	302,517.000	

5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	2,952,232.620	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,162,125.340	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,608,000.000	2,304,826.800	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,108,857.960	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,573,369.880	
4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,929,638.000	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,373,000.000	1,927,650.810	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,310,616.770	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,789,000.000	2,280,259.400	
4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,920,912.320	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,980,752.850	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,725,730.100	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,447,161.820	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,277,030.240	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,601,000.000	1,960,344.450	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,270,000.000	1,719,681.600	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,049,000.000	1,563,156.860	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190430	1,836,000.000	1,914,654.240	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,357,735.400	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,378,186.730	

	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,966,367.000	
ユーロ 小計			ユーロ 513,825,245.290 (68,107,536,263)	
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	2,991,043.640	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,699,187.760	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	16,434,000.000	17,724,069.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	5,329,313.440	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,439,431.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,126,842.400	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,244,824.930	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	5,539,000.000	5,378,645.950	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	13,452,000.000	11,895,603.600	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,653,073.480	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	8,862,000.000	7,816,638.480	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	7,944,000.000	7,006,210.800	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	8,243,000.000	7,302,556.130	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	4,166,000.000	3,791,684.900	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	2,179,000.000	1,987,553.060	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 104,386,678.570 (899,813,169)	
国債証券 合計			165,664,776.804	

		[165,664,776,804]	
合計		165,664,776,804	[165,664,776,804]

- (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 243銘柄	100%	43.1%
イギリス・ポンド	国債証券 41銘柄	100%	7.1%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	100%	2.2%
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	100%	2.2%
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 7銘柄	100%	0.6%
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 17銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券 33銘柄	100%	0.4%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 300銘柄	100%	41.1%
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19日から平成30年6月18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】

DCダイワ・ターゲットイヤー2030

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 平成30年6月18日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		270,552
コール・ローン		588,975
親投資信託受益証券		226,896,309
未収入金		13,000
流動資産合計		227,768,836
資産合計		227,768,836
負債の部		
流動負債		
未払解約金		9,294
未払受託者報酬		36,640
未払委託者報酬		378,995
その他未払費用		9,080
流動負債合計		434,009
負債合計		434,009
純資産の部		
元本等		
元本		1 159,419,043
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		67,915,784
（分配準備積立金）		38,008,586
元本等合計		227,334,827
純資産合計		227,334,827
負債純資産合計		227,768,836

(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19日 至 平成30年6月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,603,497
営業収益合計	1,603,497
営業費用	
支払利息	125
受託者報酬	36,640
委託者報酬	378,995
その他費用	9,080
営業費用合計	424,840
営業利益又は営業損失（ ）	2,028,337
経常利益又は経常損失（ ）	2,028,337
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,028,337
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	138,421
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	70,139,829
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,994,083
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,994,083
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,328,212
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,328,212
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	67,915,784

(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19日 至 平成30年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(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6月18日現在
1. 1 期首元本額	159,762,139円
期中追加設定元本額	9,527,385円
期中一部解約元本額	9,870,481円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	159,419,043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19日 至 平成30年6月18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6月18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6月18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6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4260円 (14,260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、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券及び「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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6月18日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,405,565,961
コール・ローン	7,413,719,604

株式	2 3	143,338,626,920
未収入金		4,869,533
未収配当金		930,001,240
未収利息		451,675
その他未収収益	4	17,235,087
流動資産合計		155,110,470,020
資産合計		155,110,470,020
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		19,583,460
前受金		270,000
未払金		693,118,919
未払解約金		72,807,900
受入担保金		9,176,946,135
その他未払費用		146,531
流動負債合計		9,962,872,945
負債合計		9,962,872,945
純資産の部		
元本等		
元本	1	130,428,818,246
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		14,718,778,829
元本等合計		145,147,597,075
純資産合計		145,147,597,075
負債純資産合計		155,110,470,020

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19日 至 平成30年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成29年12月19日
期首元本額	128,399,557,544円
期中追加設定元本額	9,131,255,059円
期中一部解約元本額	7,101,994,357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	4,152,912,004円
ファンド	

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	9,718,504,606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	61,170,480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)	1,165,714,659円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	59,978,575円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,595,237,470円
D-I's TOPIX イン デックス	27,076,578円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	21,813,789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	505,006,837円
iFree 8資産バランス	889,206,014円
DCダイワ日本株式インデッ クス	62,922,582,860円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,334,930,943円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,510,392,046円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,440,855,600円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,403,802,944円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	14,753,126円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	48,545,108円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	14,282,313円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	334,996円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	343,410円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	684,622円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	2,185,320円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	4,842,830円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	10,343,078円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	234,779,386円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	164,962,864円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,949,417,954円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	48,616,584円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	37,979,271円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	856,720,435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TOP PIXファンド	103,399,957円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	7,611,662,973円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	88,676,383円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	1,721,014,002円

	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX		1,348,705,621円
	ダイワライフスタイル25		174,040,116円
	ダイワライフスタイル50		615,588,461円
	ダイワライフスタイル75		519,964,237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)		13,621,819,572円
	計		130,428,818,246円
2.	期末日における受益権の総数		130,428,818,246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	8,656,436,600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	753,000,000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16,256,952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6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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

種 類	平成30年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 株価指数 先物取引 買 建	1,768,860,000	-	1,749,330,000	19,530,000
合計	1,768,860,000	-	1,749,330,000	19,530,000

(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6月18日現在
1口当たり純資産額	1.1128円
(1万口当たり純資産額)	(11,128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6月18日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	

預金		667,490,000
金銭信託		62,857,312
コール・ローン		136,836,724
株式		99,028,281,161
投資証券		2,484,567,453
派生商品評価勘定		1,139,589
未収入金		604,133
未収配当金		182,956,468
差入委託証拠金		795,716,344
流動資産合計		103,360,449,184
資産合計		103,360,449,184
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,299,198
未払金		39,373,894
未払解約金		65,240,500
その他未払費用		4,309
流動負債合計		105,917,901
負債合計		105,917,901
純資産の部		
元本等		
元本	1	41,796,030,432
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		61,458,500,851
元本等合計		103,254,531,283
純資産合計		103,254,531,283
負債純資産合計		103,360,449,184

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19日 至 平成30年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成29年12月19日
期首元本額	39,738,227,827円
期中追加設定元本額	3,825,962,688円
期中一部解約元本額	1,768,160,083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	518,834,432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)	228,462,733円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	27,312,346円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	727,475,955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)	547,424,957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)	1,332,544,707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)	488,810,724円
D-I's 外国株式インデッ クス	1,010,751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)	536,742,294円
iFree 8資産バランス	405,411,266円
DCダイワ外国株式インデッ クス	25,708,934,630円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	542,582,707円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	767,007,247円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	622,100,357円
大和DC海外株式インデック スファンド	1,467,586,997円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	4,277,573円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	12,987,127円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,783,334円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	76,716円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	157,568円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	668,959円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	2,223,951円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	323,855,425円

ダイワ世界バランスファンド 60VA	378,861,282円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,419,057,893円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専用）	168,314,746円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	592,138,249円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	62,228,321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）	454,673円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,737,758,055円
ダイワライフスタイル25	19,963,541円
ダイワライフスタイル50	70,913,871円
ダイワライフスタイル75	59,441,318円
計	41,796,030,432円
2. 期末日における受益権の総数	41,796,030,432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6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	1,602,280,927	-	1,600,987,258	1,293,669
合計	1,602,280,927	-	1,600,987,258	1,293,669

(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30年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	98,243,940	-	99,378,000	1,134,060
アメリカ・ドル	98,243,940	-	99,378,000	1,134,060
合計	98,243,940	-	99,378,000	1,134,060

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.4704円
(1万口当たり純資産額)	(24,704円)

「ダイワ」- REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年6月18日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	741,584,852
コール・ローン	1,614,387,219
投資証券 2	209,130,111,920
派生商品評価勘定	21,585,600
未収入金	54,771,424
未収配当金	1,318,386,836

流動資産合計		212,880,827,851
資産合計		212,880,827,851
負債の部		
流動負債		
前受金		19,080,000
未払解約金		33,638,000
その他未払費用		36,628
流動負債合計		52,754,628
負債合計		52,754,628
純資産の部		
元本等		
元本	1	84,332,707,170
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		128,495,366,053
元本等合計		212,828,073,223
純資産合計		212,828,073,223
負債純資産合計		212,880,827,851

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19日 至 平成30年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成29年12月19日
期首元本額	93,103,935,587円
期中追加設定元本額	2,626,807,773円
期中一部解約元本額	11,398,036,190円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ-REITオープン	8,716,715,558円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	68,142,761,531円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	427,493,307円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	29,232円
iFree J-REIT イ ンデックス	123,189,086円
iFree 8資産バランス	399,539,969円
DC・ダイワJ-REIT オープン	3,555,290,176円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,004,643円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,419,246円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,334,004円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	54,969,888円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	930,375,961円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	127,005,207円

	ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス		351,439,370円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT		1,494,139,992円
	計		84,332,707,170円
2.	期末日における受益権の総数		84,332,707,170口
3.	2 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。	
		投資証券	372,000,000円

(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6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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

不動産投信関連

種 類	平成30年6月18日 現在		
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)
		(円)	
市場取引		うち 1年超	

不動産投信 指数先物取引				
買 建	3,079,620,000	-	3,101,400,000	21,780,000
合計	3,079,620,000	-	3,101,400,000	21,780,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信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. 不動産投信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6月18日現在
1口当たり純資産額	2.5237円
(1万口当たり純資産額)	(25,237円)

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年6月18日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	36,673,865
金銭信託	46,543,297
コール・ローン	101,322,057
投資信託受益証券	137,456,643
投資証券	16,506,382,110
派生商品評価勘定	727,581
未収入金	327,983
未収配当金	32,860,969
差入委託証拠金	37,401,429

流動資産合計		16,899,695,934
資産合計		16,899,695,934
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,225,447
未払金		51,267,381
未払解約金		8,637,000
その他未払費用		2,049
流動負債合計		61,131,877
負債合計		61,131,877
純資産の部		
元本等		
元本	1	7,655,077,887
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,183,486,170
元本等合計		16,838,564,057
純資産合計		16,838,564,057
負債純資産合計		16,899,695,934

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19日 至 平成30年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成29年12月19日
期首元本額	6,102,884,330円
期中追加設定元本額	1,745,879,348円
期中一部解約元本額	193,685,791円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	4,000,878,969円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	539,964,683円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	323,038,547円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	227,542,963円
D-I's グローバルREI Tインデックス	1,222,466円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	35,023円
iFree 外国REITイ ンデックス	70,426,843円
iFree 8資産バランス	453,719,542円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	1,584,037,239円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,424,485円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,256,261円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,336,304円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	284,336,411円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	25,922,759円

ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	128,533,234円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	4,402,158円
計	7,655,077,887円
2. 期末日における受益権の総数	7,655,077,887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6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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. 不動産投信関連

種 類	平成30年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	164,349,578	-	163,574,748	774,830
合計	164,349,578	-	163,574,748	774,830

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信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. 不動産投信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30年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	113,771,336	-	114,048,300	276,964
アメリカ・ドル	86,904,911	-	87,273,800	368,889
イギリス・ポンド	2,932,920	-	2,932,800	120
オーストラリア・ドル	2,055,015	-	2,055,000	15
シンガポール・ドル	9,022,600	-	8,983,700	38,900
ユーロ	12,855,890	-	12,803,000	52,890
合計	113,771,336	-	114,048,300	276,964

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1997円 (21,997円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年6月18日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	88,430,200
コール・ローン	192,507,416
国債証券	12,589,752,430
地方債証券	1,142,605,300
特殊債券	919,041,500
社債券	1,347,239,800
未収利息	49,176,088
前払費用	2,248,605
流動資産合計	16,331,001,339
資産合計	16,331,001,339
負債の部	
流動負債	
未払金	169,594,260
未払解約金	9,589,000

その他未払費用		1,209
流動負債合計		179,184,469
負債合計		179,184,469
純資産の部		
元本等		
元本	1	12,655,250,834
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,496,566,036
元本等合計		16,151,816,870
純資産合計		16,151,816,870
負債純資産合計		16,331,001,339

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年12月19日 至 平成30年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成29年12月19日
期首元本額	12,102,682,064円
期中追加設定元本額	1,428,103,938円
期中一部解約元本額	875,535,168円
期末元本額の内訳	

ファンド名	
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	57,799円
iFree 日本債券イン デックス	103,797,372円
iFree 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	789,060,901円 5,612,258,443円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,946,999,651円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	959,066,637円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/安定コース）	640,020,258円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/6分散コー ス）	526,145,380円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/成長コース）	165,385,708円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	59,345,262円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	49,747,942円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	4,614,008円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	509,049,395円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	213,509,760円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	42,778,078円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	33,414,240円
計	12,655,250,834円
2. 期末日における受益権の総数	12,655,250,834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6月18日現在
----	--------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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6月18日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額	1.2763円
(1万口当たり純資産額)	(12,763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6月18日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	458,867,272
金銭信託	196,986,695
コール・ローン	428,828,613
国債証券	162,077,309,954
派生商品評価勘定	6,008,458
未収入金	1,582,574
未収利息	1,224,797,649
前払費用	33,014,803
流動資産合計	164,427,396,018

資産合計		164,427,396,018
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		937,302
未払解約金		52,989,717
その他未払費用		13,916
流動負債合計		53,940,935
負債合計		53,940,935
純資産の部		
元本等		
元本	1	60,455,977,437
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		103,917,477,646
元本等合計		164,373,455,083
純資産合計		164,373,455,083
負債純資産合計		164,427,396,018

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19日 至 平成30年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
----------------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成29年12月19日
期首元本額	59,323,594,737円
期中追加設定元本額	3,467,654,167円
期中一部解約元本額	2,335,271,467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	854,523,679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)	206,824,310円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	57,761,758円

ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	662,292,154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)	353,138,235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)	887,267,104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)	641,273,428円
D-I's 外国債券インデッ クス	935,352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	435,441,531円
iFree 8資産バランス	369,690,770円
DCダイワ外国債券インデッ クス	41,140,933,233円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	719,164,381円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	346,006,305円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	225,103,257円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	301,519,563円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コ ース)	247,547,179円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	78,267,023円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	11,128,249円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	18,338,361円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,700,379円

ダイワ世界バランスファンド 40VA	337,001,995円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	168,856,742円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,143,693,045円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	80,686,083円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	23,409,864円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(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	139,518,065円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	26,769,670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)	369,220円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,480,616,302円
ダイワライフスタイル25	35,961,351円
ダイワライフスタイル50	63,382,926円
ダイワライフスタイル75	17,973,867円
計	60,455,977,437円
2. 期末日における受益権の総数	60,455,977,437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6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	566,122,004	-	571,193,160	5,071,156
アメリカ・ドル	256,557,192	-	260,638,400	4,081,208
オーストラリア・ドル	16,985,074	-	16,996,770	11,696
カナダ・ドル	10,541,009	-	10,544,940	3,931
メキシコ・ペソ	15,871,398	-	15,662,080	209,318
ユーロ	246,044,325	-	247,738,050	1,693,725
南アフリカ・ランド	20,123,006	-	19,612,920	510,086
合計	566,122,004	-	571,193,160	5,071,156

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.7189円
(1万口当たり純資産額)	(27,189円)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2018年7月31日

資産総額	211,574,281円
負債総額	160,169円
純資産総額（ - ）	211,414,112円
発行済数量	147,724,850口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.4311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

2018年7月31日

資産総額	154,306,540,300円
負債総額	8,724,934,058円
純資産総額（ - ）	145,581,606,242円
発行済数量	132,014,973,309口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1028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

2018年7月31日

資産総額	105,589,106,017円
負債総額	46,264,695円
純資産総額（ - ）	105,542,841,322円
発行済数量	42,114,783,865口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.5061円

(参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

2018年7月31日

資産総額	218,588,587,627円
負債総額	2,847,553,568円
純資産総額（ - ）	215,741,034,059円
発行済数量	83,792,929,371口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.5747円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2018年7月31日

資産総額	17,328,501,160円
負債総額	49,321,547円
純資産総額（ - ）	17,279,179,613円
発行済数量	7,692,847,393口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.2461円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

純資産額計算書

2018年7月31日

資産総額	16,402,228,947円
負債総額	3,369,915円
純資産総額（ - ）	16,398,859,032円
発行済数量	12,867,482,547口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2744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

2018年7月31日

資産総額	166,824,045,405円
負債総額	18,897,515円
純資産総額（ - ）	166,805,147,890円
発行済数量	60,844,846,082口

1 単位当たり純資産額 (/)

2.7415円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2018年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

取締役会は、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。

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7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	182,094
追加型株式投資信託	702	15,543,648
株式投資信託 合計	783	15,725,742
単位型公社債投資信託	26	101,114
追加型公社債投資信託	14	1,494,713
公社債投資信託 合計	40	1,595,828
総合計	823	17,321,570

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	1
建物	229	213
器具備品	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

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。

剰余金の配当の総額	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
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。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	平成30年3月31日
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係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、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。

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、記載していません。

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、記載していません。

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」には含めていません。

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いません。

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	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(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

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		719
	709	
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、記載を省略していません。

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いません。

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成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。

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼ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

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（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。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 (2018年3月 末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	(注1)
東海東京証券株式会社	6,000	
第一生命保険株式会社	60,000	(注2)
株式会社みずほ銀行	1,404,065	(注3)

(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) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注3) 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いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<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

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

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

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

委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

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まれます。）を掲載することがあります。

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	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成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30年2月2日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2030の平成28年12月20日から平成29年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2030の平成29年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . 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27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2030の平成29年12月19日から平成30年6月18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、DCダイワ・ターゲットイヤー2030の平成30年6月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年12月19日から平成30年6月18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。