

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成29年3月10日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 岩本 信之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山村 政 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D C ダイワ・ターゲットイヤー2040
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続申込期間（平成29年3月11日から平成30年3月9日まで） 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

### (3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

### (4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問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】

平成29年3月11日から平成30年3月9日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

受益権の取得申込者は、販売会社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 債券
追加型投信	海外	不動産投信 その他資産 ( )
	内外	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 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本	ファミリー ファンド	あり ( )
不動産投信	年4回	北米		
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))	年6回 (隔月)	欧州		
資産複合 ( )	年12回 (毎月)	アジア		
資産配分固定型 資産配分変更型	日々	オセアニア	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
	その他 ( )	中南米		
		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

### < 信託金の限度額 >

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

### < ファンドの特色 >

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

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

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

## 〈2016年12月時点の基本配分比率〉

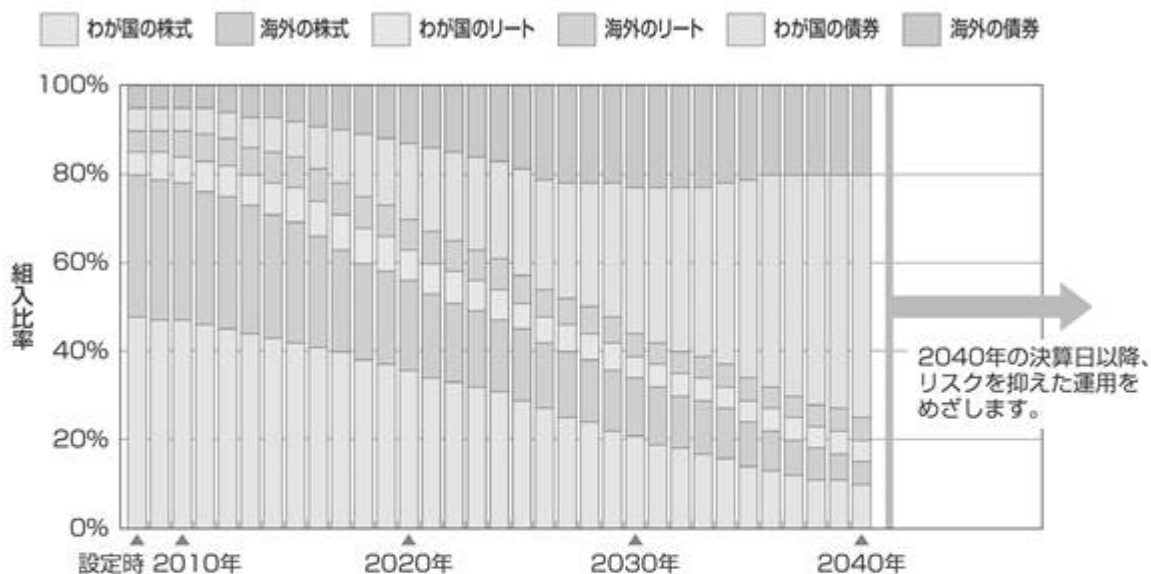
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	41%	25%	8%	7%	10%	9%

## 〈当初設定時の基本配分比率〉

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

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

## ファンドの基本配分比率のイメージ



- (注1) 2016年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2015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<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるTOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

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

### 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

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

#### 運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるMSC I 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。

#### MSC I コクサイ指数とは

MSC I コクサイ指数は、MSC I 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、MSC I コクサイ指数（円ベース）は、MSC I コクサイ指数（米ドルベース）をもとに、MSC I 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、MSC I Inc. に帰属します。また、MSC I 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、平成15年4月より算出・公表されています。

## 【算出方法の概要】

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

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

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

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

## 5

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

## 運用プロセス



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

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

## S&amp;P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

S&P先進国REIT指数は、S&P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】

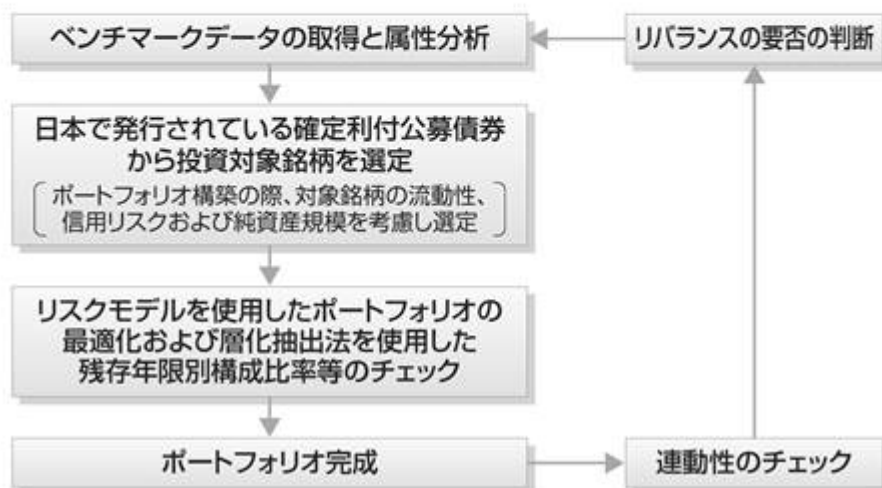
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

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<sup>(注1)</sup>を用いて最適化を図ります。これに加えて、層化抽出法<sup>(注2)</sup>と呼ばれる手法を併用し、残存期間構成、セクター構成等をベンチマーク構成比に合わせることで、同指数との連動をめざします。また、ベンチマークの構成銘柄変更等に対しても、リスクモデルによる最適化法と層化抽出法を使用してポートフォリオのリバランスを行ないます。

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

## NOMURA－BPI総合指数とは

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

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

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

### 運用プロセス



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

#### ①為替レート変動への対応

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

#### ②債券価格変動への対応

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

#### ③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

### シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

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

## 8

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

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

#### NOMURA－BPI総合短期指数とは

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

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

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



## ファンドの仕組み

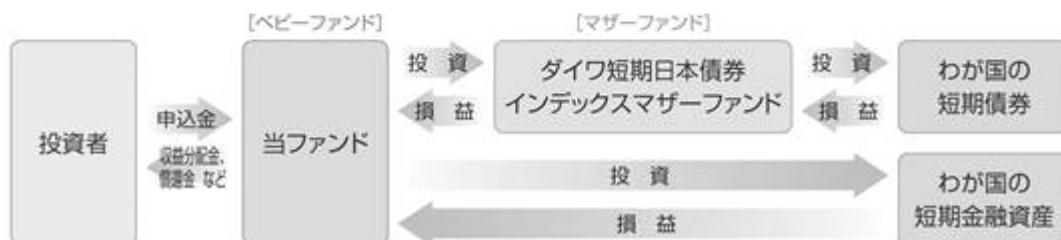
●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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

〈2040年の決算日前日まで〉



〈2040年の決算日から〉



・ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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



9

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

10

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

〈分配方針〉

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成20年2月28日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）
お取扱窓口	販売会社
	<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 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
	<p>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。</p> <p>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</p>
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（平成28年12月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

## 2 【投資方針】

## (1) 【投資方針】

## 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、2040年に近づくにしながら株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないません。

## 当初設定時の基本配分比率

トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の48%

外国株式インデックスマザーファンドの受益証券 .....信託財産の純資産総額の32%

ダイワJ - 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 5%

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 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  
.....信託財産の純資産総額の 5%

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券 .....信託財産の純資産総額の 5%

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

## (2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

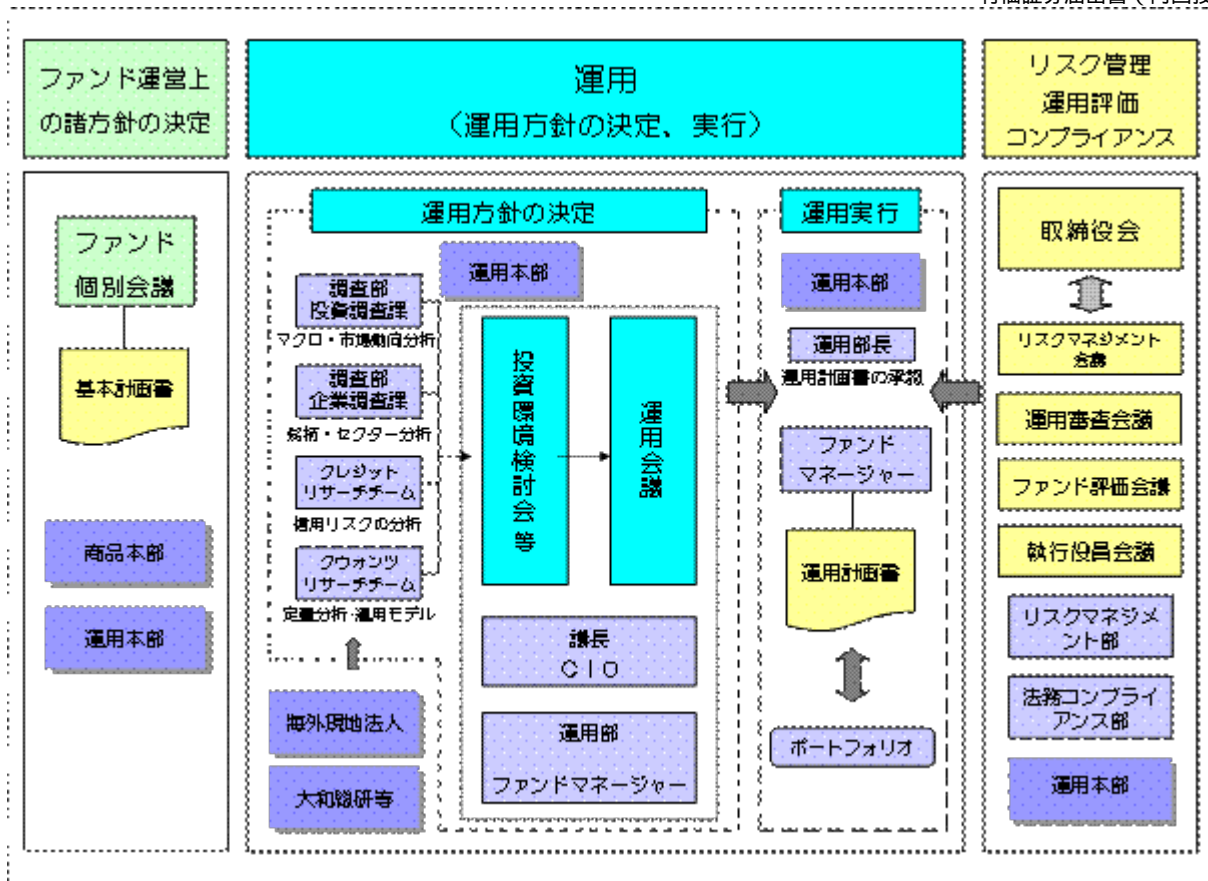
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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30～40名程度です。

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

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

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成28年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## <参考> 各マザーファンドの概要

### 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

## (2) 投資対象

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

## (3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

（注）東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

## 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

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、平成15年4月より算出・公表されています。

## [ 算出方法の概要 ]

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## (1) 投資方針

### 主要投資対象

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

### 投資態度

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

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

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

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

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

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

### (2) 投資対象

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第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ます。）の行使等により取得したものに限ります。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引



- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(注) NOMURA - B P I 総合指数とは

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。

- 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。)
  - 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。)

#### 八．約束手形

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

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

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

### (3) 主な投資制限

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

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

## (2) 投資対象

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

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

16. 預託証券（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します。

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

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

## 3 【投資リスク】

## 〈基準価額の主な変動要因〉

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

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

## (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

## 〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還

金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともありま

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

#### リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク



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

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

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

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

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

- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リーートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。



- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。
- 二．組入リートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ．カンントリー・リスク

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

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け付けを中止することがあります。

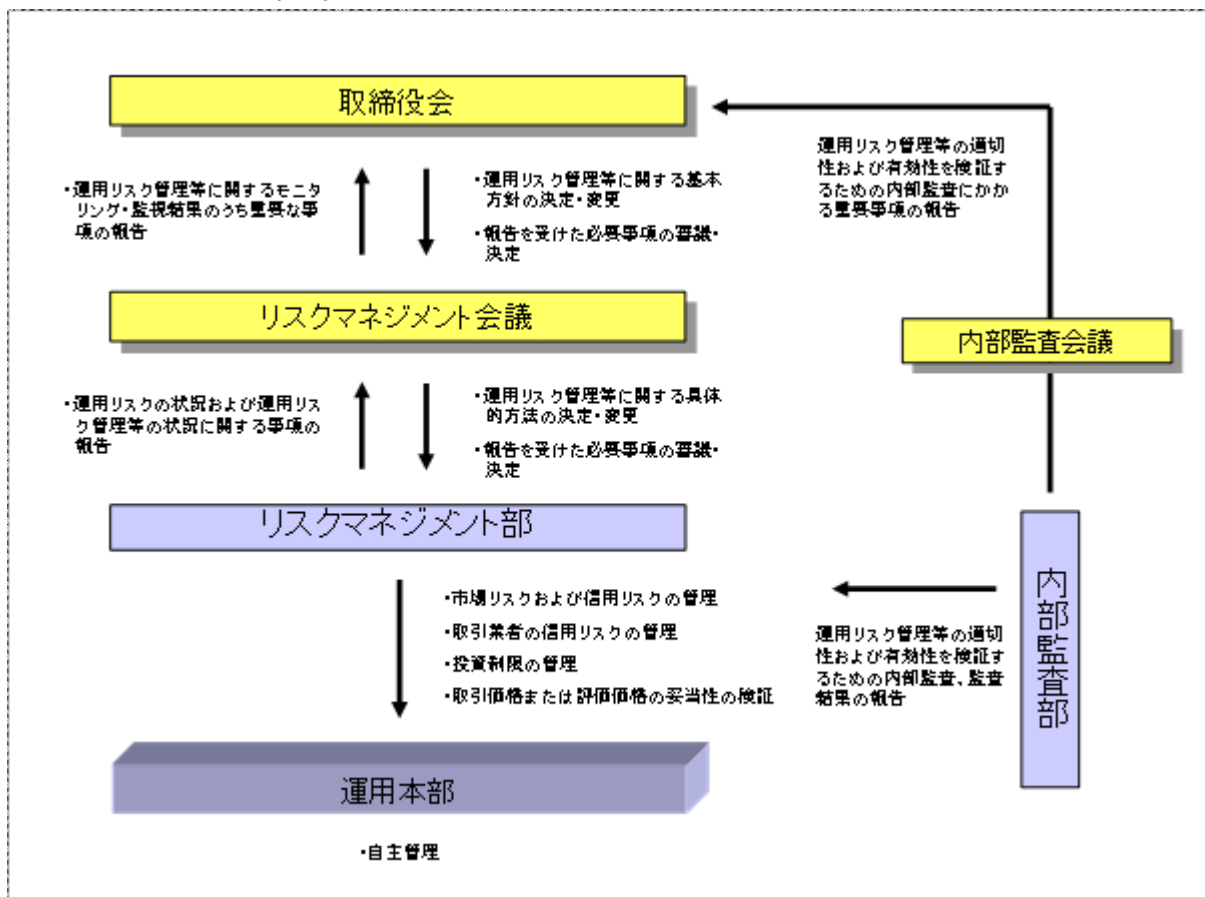
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者のご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

### (3) その他の留意点

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

### (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

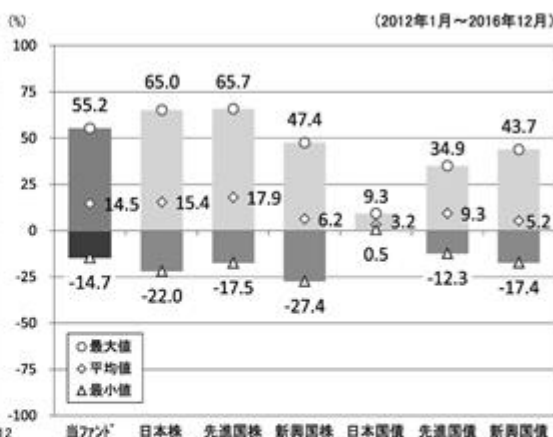
## 参 考 情 報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

## ※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）  
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）  
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）  
日本国債：NOMURA-BPI国債  
先進国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）  
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー 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.が開発した指数です。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。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー 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0.3888%(税抜0.36%)
第19計算期間から第28計算期間まで	年率0.3672%(税抜0.34%)
第29計算期間から第33計算期間まで	年率0.3024%(税抜0.28%)
第34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0.165% (税抜)	年率0.165% (税抜)	年率0.03% (税抜)

< 第19計算期間から第28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29計算期間から第33計算期間まで >

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

< 第34計算期間以降 >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.095% (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、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

#### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

#### ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

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

#### <注1> 個別元本について

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

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

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

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

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

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

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



## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成28年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	29,252,841	99.79
内 日本	29,252,841	99.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	60,236	0.21
純資産総額	29,313,077	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（平成28年12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	12,841,097	0.9419 12,095,530	0.9248 11,875,446	40.51
2 外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	3,587,335	2.0918 7,504,346	2.0719 7,432,599	25.36
3 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	2,282,858	1.2651 2,888,089	1.2677 2,893,979	9.87
4 外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	967,368	2.7053 2,617,091	2.7085 2,620,116	8.94
5 ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	937,785	2.4435 2,291,560	2.5380 2,380,098	8.12
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	950,718	2.1601 2,053,715	2.1569 2,050,603	7.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。



## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.79%
合計	99.79%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年12月18日)	681,848	681,848	0.6054	0.6054
第2計算期間末 (平成21年12月18日)	1,176,672	1,176,672	0.6991	0.6991
第3計算期間末 (平成22年12月20日)	952,605	952,605	0.7319	0.7319
第4計算期間末 (平成23年12月19日)	1,354,908	1,354,908	0.6293	0.6293
第5計算期間末 (平成24年12月18日)	3,373,491	3,373,491	0.7645	0.7645
第6計算期間末 (平成25年12月18日)	9,736,661	9,736,661	1.1001	1.1001
第7計算期間末 (平成26年12月18日)	13,831,791	13,831,791	1.2972	1.2972
第8計算期間末 (平成27年12月18日)	22,270,544	22,270,544	1.3817	1.3817
平成27年12月末日	22,864,160	-	1.3873	-

平成28年1月末日	21,583,615	-	1.3096	-
2月末日	20,788,493	-	1.2405	-
3月末日	22,404,650	-	1.2948	-
4月末日	22,320,698	-	1.2883	-
5月末日	22,823,938	-	1.3089	-
6月末日	21,555,511	-	1.2151	-
7月末日	21,955,435	-	1.2719	-
8月末日	22,564,718	-	1.2662	-
9月末日	24,827,580	-	1.2555	-
10月末日	25,345,511	-	1.2823	-
11月末日	27,680,899	-	1.3513	-
第9計算期間末 (平成28年12月19日)	28,966,940	28,966,940	1.4141	1.4141
12月末日	29,313,077	-	1.4043	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	39.5
第2計算期間	15.5
第3計算期間	4.7

第4計算期間	14.0
第5計算期間	21.5
第6計算期間	43.9
第7計算期間	17.9
第8計算期間	6.5
第9計算期間	2.3

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	126,328	0
第2計算期間	556,781	0
第3計算期間	701,153	1,082,781
第4計算期間	974,376	122,837
第5計算期間	4,521,213	2,261,666
第6計算期間	4,772,167	334,316
第7計算期間	2,261,839	449,310
第8計算期間	6,366,392	910,747
第9計算期間	5,468,224	1,102,640

(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（平成28年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	125,687,468,790	99.35
内 日本	125,687,468,790	99.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	822,219,580	0.65
純資産総額	126,509,688,370	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	728,640,000	0.58
内 日本	728,640,000	0.58

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

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

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

(2) 投資資産（平成28年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

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

15	武田薬品	日本	株式	医薬品	222,600	4,644.00 1,033,754,400	4,835.00 1,076,271,000	0.85
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	421,000	2,125.91 895,011,534	2,490.00 1,048,290,000	0.83
17	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	234,400	4,545.31 1,065,421,837	4,453.00 1,043,783,200	0.83
18	キーエンス	日本	株式	電気機器	12,900	73,460.00 947,634,000	80,200.00 1,034,580,000	0.82
19	キヤノン	日本	株式	電気機器	304,500	2,904.21 884,331,947	3,295.00 1,003,327,500	0.79
20	三菱電機	日本	株式	電気機器	605,000	1,254.95 759,245,320	1,629.50 985,847,500	0.78
21	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	607,200	1,569.50 953,000,400	1,623.50 985,789,200	0.78
22	三菱地所	日本	株式	不動産業	417,000	1,875.65 782,146,550	2,327.50 970,567,500	0.77
23	信越化学	日本	株式	化学	106,700	7,037.67 750,920,156	9,067.00 967,448,900	0.76
24	村田製作所	日本	株式	電気機器	59,600	13,356.88 796,070,316	15,650.00 932,740,000	0.74
25	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	47,200	17,465.00 824,348,000	19,230.00 907,656,000	0.72
26	日立	日本	株式	電気機器	1,360,000	473.40 643,824,000	632.00 859,520,000	0.68
27	任天堂	日本	株式	その他製品	35,000	27,305.70 955,699,500	24,540.00 858,900,000	0.68
28	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	200,500	3,631.85 728,186,515	4,214.00 844,907,000	0.67
29	富士重工業	日本	株式	輸送用機器	176,300	3,818.70 673,238,420	4,772.00 841,303,600	0.67
30	花王	日本	株式	化学	151,300	5,658.51 856,133,705	5,541.00 838,353,300	0.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.35%
合計	99.35%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.11%
鉱業	0.36%
建設業	3.03%
食料品	4.44%
繊維製品	0.71%
パルプ・紙	0.23%
化学	6.49%
医薬品	4.75%
石油・石炭製品	0.51%
ゴム製品	0.91%
ガラス・土石製品	0.95%
鉄鋼	1.27%
非鉄金属	0.90%
金属製品	0.69%
機械	4.96%
電気機器	12.25%
輸送用機器	9.71%
精密機器	1.55%
その他製品	1.79%
電気・ガス業	1.89%
陸運業	4.29%
海運業	0.22%
空運業	0.54%
倉庫・運輸関連業	0.21%
情報・通信業	7.66%
卸売業	4.34%
小売業	4.73%
銀行業	8.46%
証券、商品先物取引業	1.22%
保険業	2.60%
その他金融業	1.30%
不動産業	2.61%
サービス業	3.66%
合計	99.35%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

## 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 2017年3月	買建	48	740,110,920	728,640,000	0.58%

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

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

## 外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（平成28年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		79,694,426,950	96.31
	内 香港	1,019,135,371	1.23
	内 シンガポール	382,674,021	0.46
	内 イスラエル	222,003,299	0.27
	内 ノルウェー	218,262,214	0.26
	内 スウェーデン	931,960,687	1.13
	内 デンマーク	540,187,892	0.65
	内 イギリス	5,894,856,122	7.12
	内 アイルランド	152,143,927	0.18
	内 オランダ	1,085,682,616	1.31
	内 ベルギー	384,921,453	0.47
	内 フランス	3,214,649,177	3.88
	内 ドイツ	3,048,314,830	3.68
	内 スイス	2,848,900,246	3.44
	内 ポルトガル	46,509,343	0.06
	内 スペイン	1,025,953,373	1.24
	内 イタリア	681,454,909	0.82

	内 フィンランド	315,642,657	0.38
	内 オーストリア	65,951,097	0.08
	内 カナダ	3,298,023,047	3.99
	内 アメリカ	52,007,237,041	62.85
	内 オーストラリア	2,251,683,205	2.72
	内 ニュージーランド	58,280,423	0.07
投資証券		2,065,603,483	2.50
	内 香港	38,895,792	0.05
	内 シンガポール	25,344,428	0.03
	内 イギリス	82,491,238	0.10
	内 フランス	114,644,254	0.14
	内 カナダ	17,522,934	0.02
	内 アメリカ	1,585,327,136	1.92
	内 オーストラリア	201,377,701	0.24
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		986,342,381	1.19
純資産総額		82,746,372,814	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	784,595,097	0.95
内 アメリカ	784,595,097	0.95

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

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

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

## (2) 投資資産(平成28年12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	122,100	12,983.97 1,585,343,396	13,597.87 1,660,300,867	2.01
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	167,750	7,116.37 1,193,771,755	7,327.22 1,229,141,323	1.49



3	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	93,805	10,006.49 938,658,888	10,524.87 987,285,571	1.19
4	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	61,900	13,102.79 811,063,023	13,453.43 832,767,323	1.01
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	81,770	9,193.39 751,743,566	10,005.32 818,135,515	0.99
6	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	9,120	88,825.95 810,092,708	89,132.32 812,886,790	0.98
7	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	203,300	3,617.01 735,339,048	3,693.89 750,969,443	0.91
8	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	52,550	14,080.14 739,911,688	13,553.61 712,242,284	0.86
9	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	108,372	6,041.17 654,693,827	6,388.31 692,314,105	0.84
10	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	138,991	4,599.02 639,223,112	4,969.46 690,710,687	0.83
11	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,017	89,795.15 630,092,579	91,187.20 639,860,632	0.77
12	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,690	91,961.86 615,224,881	93,527.49 625,698,916	0.76
13	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	72,100	7,800.54 562,419,150	8,365.88 603,180,128	0.73
14	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	230,601	2,363.58 545,044,396	2,562.78 590,979,631	0.71
15	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	42,768	12,737.01 544,736,726	13,724.85 586,984,462	0.71
16	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	92,404	5,936.33 548,540,674	6,260.17 578,464,989	0.70
17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	57,667	9,655.85 556,824,254	9,825.93 566,631,992	0.68
18	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	27,550	18,368.14 506,042,345	18,993.69 523,276,283	0.63
19	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	136,963	3,718.36 509,277,850	3,784.76 518,372,098	0.63
20	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,000	4,113.26 440,119,023	4,270.52 456,946,004	0.55

21	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	65,423	6,467.52 423,124,875	6,917.17 452,542,419	0.55
22	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	92,750	4,793.56 444,603,015	4,845.98 449,465,016	0.54
23	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	54,570	8,170.60 445,870,111	8,164.78 445,552,268	0.54
24	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	51,600	8,000.41 412,821,182	8,502.93 438,751,420	0.53
25	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	27,850	15,099.43 420,519,231	15,737.79 438,297,702	0.53
26	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	16,220	25,857.14 419,402,876	26,725.14 433,481,771	0.52
27	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	62,471	7,244.51 452,571,978	6,877.56 429,648,650	0.52
28	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	459,300	903.47 414,965,608	929.78 427,050,710	0.52
29	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	34,700	11,610.55 402,886,373	12,180.19 422,652,746	0.51
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	114,400	3,474.89 397,528,182	3,548.28 405,923,850	0.49

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

#### 八 . 投資株式の業種別投資比率

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 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 2017年3月	買建	12	787,940,224	784,595,097	0.95%

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

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

#### ダイワJ-REITマザーファンド

##### (1) 投資状況（平成28年12月30日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	276,115,139,000	98.92
内 日本	276,115,139,000	98.92

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,011,408,924	1.08
純資産総額	279,126,547,924	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)	2,973,075,000	1.07
内 日本	2,973,075,000	1.07

(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(平成28年12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	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	32,293	639,610.40 20,654,938,902	647,000.00 20,893,571,000	7.49
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	29,944	617,786.16 18,498,989,055	637,000.00 19,074,328,000	6.83
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	95,670	169,316.45 16,198,505,262	176,800.00 16,914,456,000	6.06
4	日本リテールファンド	日本	投資証券	58,370	246,357.44 14,379,883,832	236,600.00 13,810,342,000	4.95
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	69,595	183,399.32 12,763,675,872	177,900.00 12,380,950,500	4.44
6	オリックス不動産投資	日本	投資証券	57,739	181,066.52 10,454,600,321	184,500.00 10,652,845,500	3.82
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	43,529	247,733.54 10,783,593,547	238,900.00 10,399,078,100	3.73
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	34,747	281,824.34 9,792,550,558	295,600.00 10,271,213,200	3.68
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	30,875	271,492.44 8,382,329,282	309,000.00 9,540,375,000	3.42

10	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	19,966	462,831.59 9,240,895,678	460,500.00 9,194,343,000	3.29
11	GLP投資法人	日本	投資証券	65,251	130,539.87 8,517,857,520	134,600.00 8,782,784,600	3.15
12	API投資法人	日本	投資証券	15,214	536,918.22 8,168,673,875	551,000.00 8,382,914,000	3.00
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	86,036	83,854.50 7,214,505,767	78,600.00 6,762,429,600	2.42
14	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	11,386	614,529.76 6,997,035,860	590,000.00 6,717,740,000	2.41
15	森ヒルズリート	日本	投資証券	40,038	153,246.67 6,135,690,523	157,900.00 6,322,000,200	2.26
16	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	9,260	627,532.73 5,810,953,164	672,000.00 6,222,720,000	2.23
17	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	11,344	504,480.67 5,722,828,801	499,500.00 5,666,328,000	2.03
18	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	11,081	444,758.19 4,928,365,507	511,000.00 5,662,391,000	2.03
19	森トラスト総合リート	日本	投資証券	30,189	181,023.35 5,464,913,981	184,400.00 5,566,851,600	1.99
20	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	20,126	236,030.42 4,750,348,367	246,400.00 4,959,046,400	1.78
21	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	23,900	174,728.43 4,176,009,636	196,100.00 4,686,790,000	1.68
22	産業ファンド	日本	投資証券	8,063	531,283.35 4,283,737,730	557,000.00 4,491,091,000	1.61
23	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	84,068	56,261.27 4,729,773,123	52,700.00 4,430,383,600	1.59
24	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	29,862	143,152.00 4,274,805,045	148,300.00 4,428,534,600	1.59
25	プレミア投資法人	日本	投資証券	30,120	134,523.36 4,051,843,667	138,200.00 4,162,584,000	1.49
26	イオンリート投資	日本	投資証券	29,948	124,666.02 3,733,498,148	127,900.00 3,830,349,200	1.37
27	東急リアル・エステート	日本	投資証券	22,358	138,234.09 3,090,637,905	148,100.00 3,311,219,800	1.19
28	積水ハウス・SIレジデンシャル投資法人	日本	投資証券	25,283	120,389.50 3,043,807,736	129,900.00 3,284,261,700	1.18
29	福岡リート投資法人	日本	投資証券	17,084	187,941.09 3,210,785,589	184,800.00 3,157,123,200	1.13

30	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	11,744	235,804.94 2,769,293,322	262,500.00 3,082,800,000	1.10
----	----------------	----	------	--------	-----------------------------	-----------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.92%
合計	98.92%

(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 2017年3月	買建	1,618	2,848,537,944	2,973,075,000	1.07%

(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 (平成28年12月30日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	6,228,289,584	98.40
内 ガーンジィ	3,127,196	0.05
内 マン島	3,276,412	0.05
内 香港	103,101,185	1.63

内 シンガポール	181,135,449	2.86
内 イスラエル	1,863,141	0.03
内 イギリス	313,024,525	4.95
内 アイルランド	12,966,139	0.20
内 オランダ	28,808,125	0.46
内 ベルギー	43,921,447	0.69
内 フランス	277,781,175	4.39
内 ドイツ	11,804,408	0.19
内 スペイン	47,171,278	0.75
内 イタリア	4,348,605	0.07
内 カナダ	112,918,462	1.78
内 アメリカ	4,539,327,350	71.72
内 オーストラリア	514,855,408	8.13
内 ニュージーランド	28,859,279	0.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	101,333,841	1.60
純資産総額	6,329,623,425	100.00

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

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

## (2) 投資資産（平成28年12月30日現在）

### 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	16,347	21,236.35 347,151,162	20,499.91 335,112,032	5.29
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	7,700	24,561.91 189,127,223	25,674.39 197,692,849	3.12
3	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	27,446	6,002.49 164,744,613	6,088.93 167,116,836	2.64
4	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	7,000	19,292.95 135,050,701	20,455.64 143,189,508	2.26
5	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	18,500	7,483.43 138,444,171	7,661.54 141,738,625	2.24
6	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	5,150	25,936.69 133,574,338	27,386.64 141,041,196	2.23

7	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	18,700	7,092.37 132,628,758	7,418.08 138,718,156	2.19
8	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	18,079	7,116.95 128,667,810	7,190.92 130,004,782	2.05
9	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	8,000	14,611.34 116,890,959	14,406.31 115,250,546	1.82
10	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	8,964	11,614.98 104,117,411	11,980.99 107,397,653	1.70
11	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	276,500	357.18 98,782,022	388.05 107,297,484	1.70
12	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	8,000	10,900.20 87,202,317	11,463.78 91,710,247	1.45
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	3,367	25,239.42 84,981,236	26,736.78 90,022,754	1.42
14	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	13,417	6,589.14 88,406,775	6,596.82 88,509,651	1.40
15	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	30,277	2,990.29 90,537,462	2,855.16 86,445,979	1.37
16	LINK REIT	香港	投資証券	114,000	793.73 90,486,827	747.99 85,271,544	1.35
17	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	37,300	2,037.17 75,988,987	2,184.18 81,470,194	1.29
18	HCP INC	アメリカ	投資証券	23,600	3,447.40 81,359,016	3,420.14 80,715,455	1.28
19	WESTFIELD CORP	オーストラリア	投資証券	99,000	767.25 75,961,988	782.86 77,503,219	1.22
20	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	5,300	12,413.98 65,794,367	12,243.09 64,888,425	1.03
21	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	5,728	10,927.57 62,593,739	11,251.76 64,450,133	1.02
22	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	41,550	1,403.11 58,302,627	1,500.07 62,327,909	0.98
23	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	21,400	3,026.87 64,777,212	2,886.62 61,773,715	0.98
24	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	3,700	16,492.65 61,022,821	16,314.42 60,363,371	0.95
25	UDR INC	アメリカ	投資証券	13,500	3,987.10 53,826,767	4,172.67 56,331,069	0.89
26	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	6,300	8,290.82 52,232,252	8,805.47 55,474,518	0.88



27	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	17,900	3,015.92 53,986,218	3,040.38 54,422,963	0.86
28	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	4,000	12,953.92 51,815,917	12,866.32 51,465,282	0.81
29	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	82,500	558.37 46,069,401	597.26 49,274,676	0.78
30	MACERICH CO/THE	アメリカ	投資証券	6,100	8,061.92 49,178,001	8,066.93 49,208,288	0.78

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.40%
合計	98.40%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ダイワ日本債券インデックスマザーファンド( B P I )

#### (1) 投資状況 (平成28年12月30日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		11,914,437,560	78.10
	内 日本	11,914,437,560	78.10
地方債証券		1,236,542,800	8.11
	内 日本	1,236,542,800	8.11
特殊債券		930,288,600	6.10
	内 日本	930,288,600	6.10

社債券		917,271,400	6.01
	内 日本	917,271,400	6.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		256,200,348	1.68
純資産総額		15,254,740,708	100.00

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

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

## (2) 投資資産 (平成28年12月30日現在)

### 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	180,000,000	100.84 181,521,540	100.85 181,540,800	0.100000 2020/09/20	1.19
2	344 10年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.82 181,478,700	100.67 181,218,600	0.100000 2026/09/20	1.19
3	116 5年国債	日本	国債証券	163,000,000	100.77 164,256,730	100.77 164,263,250	0.200000 2018/12/20	1.08
4	334 10年国債	日本	国債証券	156,000,000	104.84 163,558,200	104.74 163,403,760	0.600000 2024/06/20	1.07
5	341 10年国債	日本	国債証券	158,000,000	102.74 162,344,120	102.64 162,171,200	0.300000 2025/12/20	1.06
6	127 5年国債	日本	国債証券	159,000,000	100.90 160,440,540	100.92 160,477,110	0.100000 2021/03/20	1.05
7	333 10年国債	日本	国債証券	153,000,000	104.75 160,281,270	104.66 160,129,800	0.600000 2024/03/20	1.05
8	338 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	103.51 157,343,560	103.40 157,180,160	0.400000 2025/03/20	1.03
9	126 5年国債	日本	国債証券	154,000,000	100.87 155,349,860	100.89 155,376,760	0.100000 2020/12/20	1.02
10	343 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	100.90 153,377,120	100.75 153,146,080	0.100000 2026/06/20	1.00
11	339 10年国債	日本	国債証券	145,000,000	103.53 150,120,150	103.42 149,966,250	0.400000 2025/06/20	0.98
12	128 5年国債	日本	国債証券	147,000,000	100.93 148,375,920	100.96 148,414,140	0.100000 2021/06/20	0.97

13	325 10年国債	日本	国債証券	137,000,000	105.14 144,053,860	105.10 143,993,850	0.800000 2022/09/20	0.94
14	340 10年国債	日本	国債証券	135,000,000	103.61 139,874,850	103.48 139,700,700	0.400000 2025/09/20	0.92
15	319 10年国債	日本	国債証券	129,000,000	106.06 136,821,270	105.97 136,710,330	1.100000 2021/12/20	0.90
16	129 5年国債	日本	国債証券	135,000,000	100.98 136,324,800	101.01 136,372,950	0.100000 2021/09/20	0.89
17	368 2年国債	日本	国債証券	133,000,000	100.50 133,674,130	100.50 133,676,970	0.100000 2018/09/15	0.88
18	362 2年国債	日本	国債証券	124,000,000	100.40 124,502,200	100.42 124,531,960	0.100000 2018/03/15	0.82
19	332 10年国債	日本	国債証券	118,000,000	104.67 123,512,960	104.64 123,482,280	0.600000 2023/12/20	0.81
20	124 5年国債	日本	国債証券	110,000,000	100.80 110,881,100	100.81 110,896,500	0.100000 2020/06/20	0.73
21	309 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	104.36 107,495,950	104.28 107,414,580	1.100000 2020/06/20	0.70
22	308 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	105.07 105,078,000	104.98 104,980,000	1.300000 2020/06/20	0.69
23	33 中日本高速道	日本	社債券	100,000,000	104.94 104,942,400	104.89 104,893,500	1.084000 2021/09/17	0.69
24	21 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.76 104,769,800	104.63 104,638,400	1.570000 2019/11/25	0.69
25	36 地方公共団体	日本	特殊債券	100,000,000	104.47 104,477,000	104.62 104,621,400	0.892000 2022/05/27	0.69
26	116 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	104.58 104,582,400	104.55 104,552,200	0.800000 2022/11/25	0.69
27	21 - 35 兵庫県公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.64 104,644,900	104.48 104,485,100	1.460000 2020/01/22	0.68
28	24 - 16 愛知県公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.45 104,453,400	104.40 104,400,500	0.757000 2023/01/31	0.68
29	305 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	104.40 104,409,000	104.33 104,336,000	1.300000 2019/12/20	0.68
30	70 東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	104.02 104,025,400	104.26 104,261,800	1.193000 2020/09/29	0.68

(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	78.10%
地方債証券	8.11%
特殊債券	6.10%
社債券	6.01%
合計	98.32%

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

#### 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（平成28年12月30日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	157,495,174,038	98.61
内 ユーロ	63,233,295,546	39.59
内 シンガポール	596,576,938	0.37
内 マレーシア	683,739,709	0.43
内 ノルウェー	408,375,704	0.26
内 スウェーデン	706,356,892	0.44
内 デンマーク	1,011,250,258	0.63
内 イギリス	11,463,149,639	7.18
内 スイス	376,356,607	0.24
内 ポーランド	925,144,374	0.58
内 カナダ	3,255,206,951	2.04
内 アメリカ	69,663,880,491	43.62
内 メキシコ	1,197,742,759	0.75
内 南アフリカ	830,272,381	0.52

内 オーストラリア	3,143,825,789	1.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,219,137,149	1.39
純資産総額	159,714,311,187	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	177,546,400	0.11
内 日本	177,546,400	0.11
為替予約取引(売建)	172,568,280	0.11
内 日本	172,568,280	0.11

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

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

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

## (2) 投資資産（平成28年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,143,000	97.75 699,547,205	96.53 690,773,972	2.000000 2025/08/15	0.43
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,921,000	100.18 691,027,098	99.07 683,322,733	2.250000 2024/11/15	0.43
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,840,000	99.66 678,015,786	98.35 669,137,850	2.250000 2025/11/15	0.42
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,662,000	101.27 667,962,660	100.15 660,595,303	2.375000 2024/08/15	0.41
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,788,000	98.89 666,760,010	97.69 658,702,793	2.125000 2025/05/15	0.41

6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	98.12 656,458,281	97.02 649,085,878	2.000000 2025/02/15	0.41
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,412,000	102.30 644,969,306	101.21 638,072,250	2.500000 2024/05/15	0.40
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	104.10 634,155,205	103.02 627,540,095	2.750000 2024/02/15	0.39
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	104.13 609,064,204	103.04 602,712,230	2.750000 2023/11/15	0.38
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,529,000	94.17 606,581,708	92.87 598,182,993	1.625000 2026/05/15	0.37
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	92.91 606,118,904	91.59 597,501,439	1.500000 2026/08/15	0.37
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,697,000	128.60 583,375,908	128.68 583,752,414	4.250000 2023/10/25	0.37
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	94.33 589,674,255	93.07 581,816,932	1.625000 2026/02/15	0.36
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	103.77 545,071,221	103.24 542,282,125	2.625000 2020/11/15	0.34
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,280,000	106.86 532,814,496	106.37 530,361,496	3.625000 2020/02/15	0.33
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,709,000	158.93 528,287,556	159.51 530,222,091	4.750000 2035/04/25	0.33
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	98.00 534,840,537	97.14 530,190,698	1.750000 2023/05/15	0.33
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,507,000	168.62 518,711,659	169.13 520,262,008	5.750000 2032/10/25	0.33
19	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	2,849,000	144.88 506,463,843	147.30 514,933,980	6.000000 2031/05/01	0.32
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,550,000	117.13 510,200,710	117.15 510,300,895	3.250000 2021/10/25	0.32
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,076,000	107.89 512,276,004	107.22 509,123,244	3.625000 2021/02/15	0.32
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,325,000	100.39 505,804,297	100.12 504,428,871	1.500000 2019/11/30	0.32
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,480,000	117.16 500,289,863	117.08 499,926,916	3.000000 2022/04/25	0.31
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	155.02 498,945,370	155.22 499,572,962	5.500000 2029/04/25	0.31
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,484,000	164.09 500,152,090	163.83 499,356,597	4.500000 2041/04/25	0.31

26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,300,000	99.67 499,279,052	99.65 499,163,843	0.750000 2018/04/30	0.31
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,020,000	105.87 495,783,094	105.43 493,731,984	3.375000 2019/11/15	0.31
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,146,000	126.56 488,562,732	127.06 490,485,083	3.500000 2026/04/25	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,218,000	99.49 488,858,737	99.48 488,819,429	0.625000 2018/04/30	0.31
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,380,000	113.54 470,917,225	113.46 470,581,297	3.500000 2020/04/25	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.61%
合計	98.61%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2017年1月	買建	24,000	2,009,556	2,072,640	0.00%
		スイス・フラン買/円売 2017年1月	買建	15,000	1,669,693	1,712,850	0.00%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2017年1月	買建	447,000	3,578,950	3,821,850	0.00%
		米ドル買/円売 2017年1 月	買建	1,258,000	141,744,525	146,355,720	0.09%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2017年1月	買建	35,000	2,763,722	2,818,200	0.00%

スウェーデン・クローネ 買/円売 2017年1月	買建	263,000	3,224,261	3,369,030	0.00%
ポーランド・ズロチ買/ 円売 2017年1月	買建	148,000	3,985,788	4,120,320	0.00%
デンマーク・クローネ 買/円売 2017年1月	買建	309,000	4,979,808	5,098,500	0.00%
メキシコ・ペソ買/円売 2017年1月	買建	1,113,000	6,030,456	6,243,930	0.00%
ノルウェー・クローネ 買/円売 2017年1月	買建	143,000	1,884,240	1,933,360	0.00%
カナダ・ドル売/円買 2017年1月	売建	42,000	3,624,028	3,629,220	0.00%
豪ドル売/円買 2017年1 月	売建	41,000	3,450,547	3,456,300	0.00%
米ドル売/円買 2017年1 月	売建	653,000	75,903,414	76,022,260	0.05%
英ポンド売/円買 2017年 1月	売建	87,000	12,426,349	12,436,650	0.01%
ユーロ売/円買 2017年1 月	売建	565,000	69,291,035	69,319,850	0.04%
南アフリカ・ランド売/ 円買 2017年1月	売建	900,000	7,694,640	7,704,000	0.00%

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

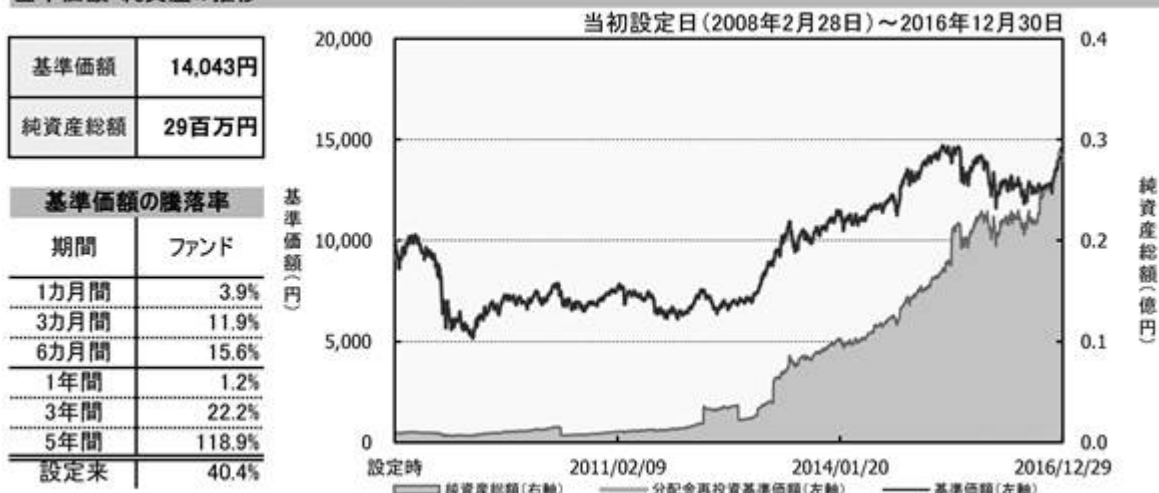
(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

### (参考情報) 運用実績

2016年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

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



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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



## 分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額： 0円 設定来分配金合計額： 0円

決算期	第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		
	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		
分配金	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
国内株式・先物	1,501	40.5%	日本円	58.8%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.5%
外国株式・先物	1,253	24.7%	米ドル	25.7%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.0%
国内債券	268	9.7%	ユーロ	7.1%	修正デュレーション	日本電信電話	日本	0.7%
外国債券	745	8.8%	英ポンド	2.8%	残存年数	三井住友フィナンシャルG	日本	0.6%
国内リート・先物	57	8.1%	豪ドル	1.5%	債券格付別構成	ソフトバンクグループ	日本	0.6%
外国リート	328	7.5%	カナダ・ドル	1.3%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.6%
			スイス・フラン	0.9%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.6%
			香港ドル	0.4%	A	野村不動産マスターF	日本	0.5%
			シンガポール・ドル	0.3%	BBB	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.4%
コール・ローン、その他	1.3%		その他	0.9%	BB以下・無格付	日本リテールファンド	日本	0.4%
合計	4,152	-	合計	100.0%	合計	合計		6.9%

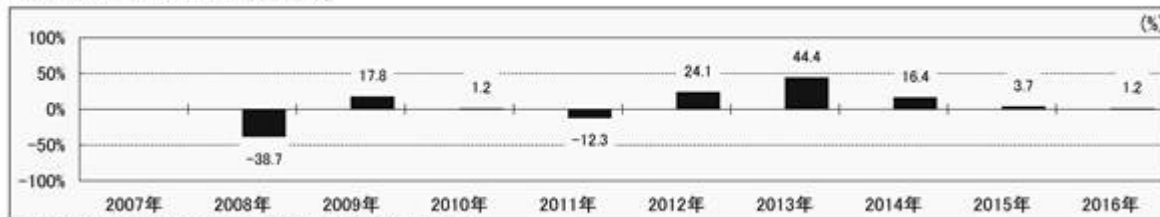
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.8%保有しております。

※格付別構成については、R&amp;I、JCR、Moody's、S&amp;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。

・2008年は設定日（2月28日）から年末、2016年は12月30日までの騰落率を表しています。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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できます。

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

委託会社は、金融商品取引所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け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け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、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。

委託会社は、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。委託会社は、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、平成20年2月28日から平成20年12月18日までとします。

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

#### (5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、あるいは、第34計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。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、これを行使することができます。なお、信託契約

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

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の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っ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、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の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）を毎計算期末に作成し、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。)を持分に依じて請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。)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9期計算期間（平成27年12月19日から平成28年12月19日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。



## 1【財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 平成27年12月18日現在	第9期 平成28年12月19日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	114,237	96,687
親投資信託受益証券	22,230,158	28,917,637
流動資産合計	22,344,395	29,014,324
資産合計	22,344,395	29,014,324
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	5,595	3,837
未払委託者報酬	67,538	42,671
その他未払費用	718	876
流動負債合計	73,851	47,384
負債合計	73,851	47,384
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 16,118,592	1 20,484,176
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,151,952	8,482,764
（分配準備積立金）	4,492,750	5,432,973
元本等合計	22,270,544	28,966,940
純資産合計	22,270,544	28,966,940
負債純資産合計	22,344,395	29,014,324

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自 平成26年12月19日 至 平成27年12月18日		自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19日	
営業収益				
有価証券売買等損益		958,087		1,222,479
営業収益合計		958,087		1,222,479
営業費用				
受託者報酬		9,768		8,403
委託者報酬		118,090		96,159
その他費用		1,264		1,627
営業費用合計		129,122		106,189
営業利益		828,965		1,116,290
経常利益		828,965		1,116,290
当期純利益		828,965		1,116,290
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（ ）		38,178		97,792
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,168,844		6,151,952
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,472,709		1,526,445
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,472,709		1,526,445
剰余金減少額又は欠損金増加額		280,388		409,715
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		280,388		409,715
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,151,952		8,482,764

## (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9期	
	自 平成27年12月19日	至 平成28年12月19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、当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367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第8期	第9期
	平成27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1. 1 期首元本額	10,662,947円	16,118,592円
期中追加設定元本額	6,366,392円	5,468,224円
期中一部解約元本額	910,747円	1,102,640円
2. 計算期間末日における受益権の総数	16,118,592口	20,484,176口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第8期	第9期
	自 平成26年12月19日 至 平成27年12月18日	自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19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(790,787円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,403,170円)及び分配準備積立金(3,701,963円)より分配可能額は7,895,920円(1万口当たり4,898.64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(1,214,082円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,815,582円)及び分配準備積立金(4,218,891円)より分配可能額は11,248,555円(1万口当たり5,491.34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9期 自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19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ます。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第9期
	平成28年12月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第8期	第9期
	平成27年12月18日現在	平成28年12月19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	872,349	1,463,924
合計	872,349	1,463,924

## (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8期	第9期
平成27年12月18日現在	平成28年12月19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9期
自 平成27年12月19日
至 平成28年12月19日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第8期 平成27年12月18日現在	第9期 平成28年12月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3817円 (13,817円)	1.4141円 (14,141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	12,636,946	11,906,530	
	外国株式インデックスマザーファンド	3,621,406	7,575,619	
	外国債券インデックスマザーファンド	932,613	2,523,091	
	ダイワJ-REITマザーファンド	900,684	2,199,560	
	ダイワ・グローバルREITインデッ クス・マザーファンド	946,555	2,044,748	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	2,109,162	2,668,089	
親投資信託受益証券 合計			28,917,637	
合計			28,917,637	

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」-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、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

#### 「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	平成27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,084,477,555	4,184,602,845
株式	3 4 127,617,012,620	129,800,710,660
派生商品評価勘定	190,217	741,360
未収入金	-	481,730,228
未収配当金	9,982,175	11,051,750
未収利息	-	185,379
その他未収収益	5 1,669,870	2,380,925
流動資産合計	131,713,332,437	134,481,403,147
資産合計	131,713,332,437	134,481,403,147
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,719,729	42,160
前受金	6,987,000	960,000
未払解約金	47,678,000	370,015,000
未払利息	40,250	-
受入担保金	2,848,614,825	3,898,160,805
流動負債合計	2,919,039,804	4,269,177,965
負債合計	2,919,039,804	4,269,177,965
純資産の部		
元本等		
元本	1 140,729,416,146	138,207,285,313
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 11,935,123,513	7,995,060,131

元本等合計	128,794,292,633	130,212,225,182
純資産合計	128,794,292,633	130,212,225,182
負債純資産合計	131,713,332,437	134,481,403,147

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められ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られた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金  原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1. 1 期首	平成26年12月19日	平成27年12月19日
期首元本額	154,467,311,877円	140,729,416,146円
期中追加設定元本額	12,290,042,957円	15,146,910,652円
期中一部解約元本額	26,027,938,688円	17,669,041,485円
期末元本額の内訳		
ファンド名		



適格機関投資家専用投信1号	1,616,982,752円	- 円
トピックス・インデックス ファンド	5,766,841,215円	5,497,265,486円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	16,565,398,041円	13,563,265,198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	135,236,221円	126,601,870円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	194,101,497円	141,686,038円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	2,983,968,923円	2,316,749,433円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	120,484,753円	96,793,829円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	4,114,870,417円	3,260,080,900円
D-I's TOPIXイン デックス	33,518,296円	22,437,751円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	- 円	27,594,657円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	- 円	593,766円
iFree TOPIXイン デックス	- 円	123,752,399円
iFree 8資産バランス	- 円	117,889,334円
DCダイワ日本株式インデッ クス	61,188,349,174円	62,984,417,547円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,968,640,569円	2,349,453,806円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,029,305,717円	2,364,986,060円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,919,810,266円	2,111,458,667円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,488,114,265円	3,809,681,060円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	23,279,953円	22,874,733円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	51,309,148円	58,804,320円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	10,070,697円	12,636,946円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	917,794円	448,097円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	2,605,355円	440,730円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	6,008,229円	839,912円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	60,710,979円	63,672,333円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	361,268,786円	330,217,542円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	181,226,317円	183,676,164円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,559,037,954円	1,412,992,315円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	233,075,123円	227,274,133円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	15,409,272,548円	14,178,232,373円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	406,342,605円	371,349,761円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	687,963,617円	639,321,646円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,232,853,418円	1,159,873,390円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	197,835,528円	162,562,702円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	308,115,317円	285,231,730円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	-円	64,166,119円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	-円	1,792,053,724円
ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	700,656,296円	1,031,097,025円
ダイワライフスタイル25	189,426,696円	202,055,361円

	ダイワライフスタイル5 0	597,732,716円	673,841,558円
	ダイワライフスタイル7 5	467,121,755円	509,571,158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）	15,916,963,209円	15,909,343,740円
	計	140,729,416,146円	138,207,285,313円
2.	期末日における受益権の総数	140,729,416,146口	138,207,285,313口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は11,935,123,513円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は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 2,711,570,200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 3,737,943,250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 765,800,000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 714,400,000円
6.	5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分1,258,350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1,709,350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27年12月19日 至 平成28年12月19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。</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28年12月19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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
--	---------------	---------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	8,992,469,109	19,265,132,041
合計	8,992,469,109	19,265,132,041

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成27年9月25日から平成27年12月18日まで、及び平成28年9月21日から平成28年12月19日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 株式関連

種 類	平成27年12月18日 現在				平成28年12月19日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株値指数								
先物取引								
買 建	1,241,953,000	-	1,226,800,000	15,153,000	308,890,000	-	309,600,000	710,000
合計	1,241,953,000	-	1,226,800,000	15,153,000	308,890,000	-	309,600,000	710,000

(注) 1. 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	平成27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1口当たり純資産額	0.9152円	0.9422円
(1万口当たり純資産額)	(9,152円)	(9,422円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,200	2,715.00	8,688,000	
日本水産	84,100	548.00	46,086,800	
マルハニチロ	12,200	3,055.00	37,271,000	
カネコ種苗	3,900	1,545.00	6,025,500	
サカタのタネ	9,600	3,255.00	31,248,000	貸付株式数 2,700株
ホクト	6,600	2,134.00	14,084,400	
ショーボンドHD	6,700	5,000.00	33,500,000	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
ミライト・ホールディングス	19,700	1,064.00	20,960,800	貸付株式数 5,600株
タマホーム	10,100	542.00	5,474,200	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
日鉄鉱業	2,000	5,680.00	11,360,000	
三井松島	6,000	1,356.00	8,136,000	
国際石油開発帝石	339,700	1,231.50	418,340,550	
日本海洋掘削	2,600	2,568.00	6,676,800	貸付株式数 700株 (700株)
石油資源開発	9,800	2,731.00	26,763,800	
K&Oエナジーグループ	4,600	1,894.00	8,712,400	
安藤・間	46,600	769.00	35,835,400	貸付株式数 13,000株
東急建設	23,100	928.00	21,436,800	
コムシスホールディングス	24,900	2,119.00	52,763,100	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
ミサワホーム	8,700	1,030.00	8,961,000	
高松コンストラクションGP	4,900	2,478.00	12,142,200	
東建コーポレーション	2,700	8,580.00	23,166,000	貸付株式数 700株
大成建設	328,000	840.00	275,520,000	
大林組	193,600	1,127.00	218,187,200	
清水建設	198,000	1,094.00	216,612,000	貸付株式数 56,000株 (56,000株)
飛島建設	68,500	194.00	13,289,000	貸付株式数 15,900株 (15,900株)
長谷工コーポレーション	74,900	1,193.00	89,355,700	
松井建設	8,200	1,071.00	8,782,200	
鹿島建設	284,000	822.00	233,448,000	
不動テトラ	57,600	210.00	12,096,000	

鉄建建設	42,000	349.00	14,658,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
西松建設	75,000	574.00	43,050,000	
三井住友建設	247,700	127.00	31,457,900	
大豊建設	24,000	576.00	13,824,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
前田建設	40,000	1,057.00	42,280,000	貸付株式数 11,000株
奥村組	51,000	665.00	33,915,000	
東鉄工業	7,800	2,933.00	22,877,400	
浅沼組	24,000	386.00	9,264,000	
戸田建設	76,000	636.00	48,336,000	
熊谷組	102,000	304.00	31,008,000	
北野建設	27,000	319.00	8,613,000	
三井ホーム	12,000	488.00	5,856,000	
矢作建設	9,700	1,054.00	10,223,800	
ピーエス三菱	16,100	372.00	5,989,200	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
日本ハウスHLDGS	18,200	498.00	9,063,600	貸付株式数 3,100株
大東建託	23,700	17,410.00	412,617,000	
新日本建設	8,100	943.00	7,638,300	
NIPPO	14,000	2,190.00	30,660,000	
東亜道路	23,000	342.00	7,866,000	
前田道路	19,000	1,932.00	36,708,000	
日本道路	20,000	473.00	9,460,000	
東亜建設	5,300	1,955.00	10,361,500	
若築建設	57,000	156.00	8,892,000	
東洋建設	20,800	413.00	8,590,400	
五洋建設	71,300	574.00	40,926,200	
大林道路	8,100	729.00	5,904,900	
世紀東急	14,300	504.00	7,207,200	
福田組	11,000	1,186.00	13,046,000	
住友林業	43,800	1,587.00	69,510,600	
日本基礎技術	13,700	363.00	4,973,100	
日成ビルド工業	21,000	519.00	10,899,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
パナホーム	24,000	855.00	20,520,000	
大和ハウス	190,100	3,292.00	625,809,200	
ライト工業	12,600	1,236.00	15,573,600	
積水ハウス	201,900	1,924.50	388,556,550	
ユアテック	11,000	818.00	8,998,000	

西部電気工業	3,200	2,186.00	6,995,200	
中電工	7,700	2,553.00	19,658,100	貸付株式数 2,100株
関電工	26,000	1,059.00	27,534,000	
きんでん	42,600	1,490.00	63,474,000	
東京エネシス	7,000	1,035.00	7,245,000	
トーエネック	10,000	580.00	5,800,000	
住友電設	4,800	1,281.00	6,148,800	
日本電設工業	10,400	1,922.00	19,988,800	
協和エクシオ	24,900	1,702.00	42,379,800	
日本工営	21,000	526.00	11,046,000	
九電工	12,700	3,030.00	38,481,000	
三機工業	14,400	965.00	13,896,000	
日揮	59,700	2,196.00	131,101,200	
中外炉工業	30,000	220.00	6,600,000	
太平電業	9,000	1,135.00	10,215,000	
高砂熱学	17,700	1,545.00	27,346,500	
NEC ネットエスアイ	6,000	2,136.00	12,816,000	
明星工業	13,500	570.00	7,695,000	
大気社	8,400	2,850.00	23,940,000	
ダイダン	10,000	971.00	9,710,000	
日比谷総合設備	7,500	1,651.00	12,382,500	
東芝プラントシステム	10,200	1,683.00	17,166,600	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
日本製粉	18,500	1,618.00	29,933,000	
日清製粉G本社	70,200	1,734.00	121,726,800	
昭和産業	26,000	604.00	15,704,000	
中部飼料	8,100	1,003.00	8,124,300	
フィード・ワン	48,200	150.00	7,230,000	
日本甜菜糖	4,100	2,389.00	9,794,900	
三井製糖	4,500	2,502.00	11,259,000	
塩水港精糖	22,700	247.00	5,606,900	
日新製糖	3,300	1,644.00	5,425,200	
ネクスト	15,700	780.00	12,246,000	貸付株式数 5,200株 (5,200株)
ジェイエイシーリクルートメント	4,300	1,301.00	5,594,300	
日本M&Aセンター	17,500	3,105.00	54,337,500	
アコーディア・ゴルフ	18,900	1,203.00	22,736,700	
タケエイ	6,800	910.00	6,188,000	貸付株式数 1,900株
トラスト・テック	3,300	1,586.00	5,233,800	



パソナグループ	6,100	806.00	4,916,600	貸付株式数 1,800株 (1,300株)
C D S	8,000	1,039.00	8,312,000	
リンクアンドモチベーション	16,400	408.00	6,691,200	
G C A	6,400	924.00	5,913,600	貸付株式数 1,800株
エス・エム・エス	8,500	2,542.00	21,607,000	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
テンプホールディングス	46,800	1,746.00	81,712,800	
リニカル	4,100	1,265.00	5,186,500	貸付株式数 1,100株
クックパッド	14,100	1,120.00	15,792,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
森永製菓	12,700	4,765.00	60,515,500	
中 村 屋	2,100	4,795.00	10,069,500	
江崎グリコ	16,200	5,300.00	85,860,000	
不 二 家	39,000	227.00	8,853,000	
山崎製パン	47,300	2,293.00	108,458,900	貸付株式数 13,500株 (8,200株)
モロゾフ	19,000	483.00	9,177,000	
亀田製菓	3,700	5,200.00	19,240,000	
寿スピリッツ	4,900	2,746.00	13,455,400	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
カルビー	26,300	3,710.00	97,573,000	貸付株式数 6,600株
森永乳業	58,000	792.00	45,936,000	
六甲バター	3,200	2,483.00	7,945,600	
ヤクルト	34,500	5,400.00	186,300,000	貸付株式数 9,600株
明治ホールディングス	38,200	9,040.00	345,328,000	
雪印メグミルク	14,000	3,130.00	43,820,000	
プリマハム	41,000	401.00	16,441,000	
日本ハム	44,000	3,120.00	137,280,000	貸付株式数 10,000株
丸大食品	31,000	481.00	14,911,000	
S F o o d s	3,700	2,889.00	10,689,300	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
伊藤ハム米久H L D G S	37,500	1,026.00	38,475,000	
スタジオアリス	2,900	2,285.00	6,626,500	
シミックホールディングス	4,000	1,486.00	5,944,000	貸付株式数 1,100株 (1,000株)
システナ	5,100	1,621.00	8,267,100	
デジタルアーツ	2,900	2,553.00	7,403,700	
新日鉄住金S O L	9,500	2,068.00	19,646,000	
総合警備保障	21,900	4,495.00	98,440,500	

いちご	54,100	444.00	24,020,400	貸付株式数 17,000株 (17,000株)
日本駐車場開発	74,100	168.00	12,448,800	貸付株式数 21,800株 (21,700株)
カカクコム	43,400	1,834.00	79,595,600	貸付株式数 12,300株 (12,300株)
ルネサンス	4,700	1,432.00	6,730,400	
ディップ	8,000	2,364.00	18,912,000	
SBSホールディングス	6,400	860.00	5,504,000	
オプトホールディング	7,700	734.00	5,651,800	
新日本科学	7,700	597.00	4,596,900	
ツクイ	15,700	724.00	11,366,800	
エムスリー	52,500	2,782.00	146,055,000	貸付株式数 14,700株
アウトソーシング	3,300	3,565.00	11,764,500	貸付株式数 900株 (100株)
ウェルネット	5,400	1,269.00	6,852,600	貸付株式数 1,600株
ディー・エヌ・エー	27,100	2,638.00	71,489,800	
博報堂DYHLDGS	83,300	1,400.00	116,620,000	
ぐるなび	8,900	2,284.00	20,327,600	
エスアールジータカミヤ	8,500	615.00	5,227,500	
ジャパンベストレスキューS	20,300	248.00	5,034,400	
ファンコミュニケーションズ	15,700	733.00	11,508,100	貸付株式数 4,400株 (300株)
ティア	9,900	643.00	6,365,700	
インフォマート	13,300	1,272.00	16,917,600	
サッポロホールディングス	20,700	3,010.00	62,307,000	
アサヒグループホールディング	120,600	3,515.00	423,909,000	
キリンHD	277,400	1,932.00	535,936,800	
宝ホールディングス	45,800	1,038.00	47,540,400	
オエノンホールディングス	29,000	272.00	7,888,000	
コカ・コーラウエスト	21,900	3,415.00	74,788,500	
コカ・コーライーストジャパ ン	25,100	2,540.00	63,754,000	
サントリー食品インター	44,300	4,900.00	217,070,000	
ダイドードリンコ	2,800	5,770.00	16,156,000	
伊藤園	19,000	3,710.00	70,490,000	貸付株式数 5,400株
キーコーヒー	6,300	2,159.00	13,601,700	
日清オイリオグループ	36,000	523.00	18,828,000	
不二製油グループ	17,100	2,250.00	38,475,000	貸付株式数 4,800株
J-オイルミルズ	3,000	3,760.00	11,280,000	

ローソン	19,600	8,160.00	159,936,000	貸付株式数 6,100株 (6,100株)
サンエー	4,300	5,690.00	24,467,000	
カワチ薬品	4,600	2,922.00	13,441,200	
エービーシー・マート	10,300	6,470.00	66,641,000	貸付株式数 2,100株
ハードオフコーポレーション	4,400	1,182.00	5,200,800	
アスクル	6,900	4,285.00	29,566,500	
ゲオホールディングス	9,400	1,382.00	12,990,800	貸付株式数 2,700株
アダストリア	8,800	3,260.00	28,688,000	
くらコーポレーション	3,800	4,765.00	18,107,000	
キャンドウ	4,300	1,785.00	7,675,500	貸付株式数 1,300株
エレマテック	2,600	1,880.00	4,888,000	
パルグループHLDGS	3,100	2,879.00	8,924,900	貸付株式数 800株
エディオン	21,300	1,136.00	24,196,800	貸付株式数 8,800株
あらた	2,900	2,525.00	7,322,500	
サーラコーポレーション	8,600	653.00	5,615,800	
ワッツ	6,900	1,088.00	7,507,200	
ハローズ	2,100	2,368.00	4,972,800	
J Pホールディングス	21,800	261.00	5,689,800	貸付株式数 6,100株 (2,000株)
あみやき亭	1,600	3,905.00	6,248,000	
ひらまつ	10,700	683.00	7,308,100	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
フィールズ	4,700	1,453.00	6,829,100	
双日	330,200	296.00	97,739,200	
ゲンキー	1,200	5,780.00	6,936,000	貸付株式数 300株 (100株)
アルフレッサホールディングス	66,900	1,976.00	132,194,400	
大黒天物産	1,500	5,070.00	7,605,000	
ハニーズ	6,000	1,225.00	7,350,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
キッコーマン	45,000	3,735.00	168,075,000	貸付株式数 12,000株
味の素	132,800	2,430.00	322,704,000	
キューピー	32,900	2,730.00	89,817,000	
ハウス食品G本社	23,400	2,384.00	55,785,600	
カゴメ	23,100	2,875.00	66,412,500	
アリアケジャパン	5,400	6,140.00	33,156,000	
ニチレイ	31,900	2,371.00	75,634,900	

横浜冷凍	14,700	1,028.00	15,111,600	貸付株式数 200株 (200株)
東洋水産	31,400	4,155.00	130,467,000	
日清食品HD	25,100	6,050.00	151,855,000	
永谷園ホールディングス	7,000	1,339.00	9,373,000	
フジッコ	6,500	2,346.00	15,249,000	
ロックフィールド	7,600	1,534.00	11,658,400	
日本たばこ産業	356,500	3,926.00	1,399,619,000	
ケンコーマヨネーズ	2,600	3,225.00	8,385,000	
わらべや日洋HD	4,100	2,461.00	10,090,100	
ユーグレナ	20,900	1,283.00	26,814,700	貸付株式数 5,900株 (5,800株)
片倉工業	8,100	1,417.00	11,477,700	
グンゼ	44,000	377.00	16,588,000	
ヒューリック	118,300	1,067.00	126,226,100	
山下医科器械	3,300	1,734.00	5,722,200	
アルペン	4,800	2,274.00	10,915,200	
クオール	6,900	1,467.00	10,122,300	
アルコニックス	5,200	1,747.00	9,084,400	
神戸物産	3,200	3,885.00	12,432,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
ジェイアイエヌ	3,900	5,120.00	19,968,000	貸付株式数 1,100株 (1,000株)
ビックカメラ	32,500	1,128.00	36,660,000	
DCMホールディングス	32,800	1,013.00	33,226,400	
MonotaRO	20,300	2,393.00	48,577,900	貸付株式数 5,700株
あいホールディングス	10,300	2,283.00	23,514,900	貸付株式数 2,900株
ディービーエックス	3,700	1,375.00	5,087,500	
アークランドサービスHD	2,100	2,884.00	6,056,400	貸付株式数 600株
J.フロントリテイリング	71,500	1,774.00	126,841,000	
ドトール・日レスHD	9,700	2,153.00	20,884,100	
マツモトキヨシHLDGS	10,700	5,940.00	63,558,000	
ブロンコビリー	3,300	2,959.00	9,764,700	貸付株式数 900株 (900株)
スタートトゥデイ	52,100	1,957.00	101,959,700	
物語コーポレーション	1,800	4,190.00	7,542,000	貸付株式数 500株
ココカラファイン	6,000	4,410.00	26,460,000	
三越伊勢丹HD	112,600	1,381.00	155,500,600	
東洋紡	235,000	176.00	41,360,000	

ユニチカ	171,000	84.00	14,364,000	
富士紡ホールディングス	3,100	3,240.00	10,044,000	
日清紡ホールディングス	30,700	1,163.00	35,704,100	
倉敷紡績	60,000	231.00	13,860,000	
ダイワボウHD	49,000	293.00	14,357,000	
シキボウ	64,000	138.00	8,832,000	
日東紡績	49,000	473.00	23,177,000	
トヨタ紡織	20,200	2,716.00	54,863,200	
マクニカ・富士エレHLDGS	10,500	1,483.00	15,571,500	
ウエルシアHD	5,700	6,970.00	39,729,000	
クリエイトSDH	8,500	2,530.00	21,505,000	
バイタルKSKHD	10,600	988.00	10,472,800	
UKCホールディングス	4,000	2,163.00	8,652,000	
丸善CHIHD	13,100	369.00	4,833,900	
TOKAIホールディングス	25,200	774.00	19,504,800	貸付株式数 7,400株
三洋貿易	5,000	1,539.00	7,695,000	
チムニー	2,000	2,891.00	5,782,000	貸付株式数 500株
ウイン・パートナーズ	3,000	1,945.00	5,835,000	
ジョイフル本田	9,200	3,120.00	28,704,000	貸付株式数 2,500株
鳥貴族	1,600	2,377.00	3,803,200	
すかいらーく	24,100	1,597.00	38,487,700	貸付株式数 6,800株 (1,000株)
綿半ホールディングス	3,300	1,625.00	5,362,500	
日本毛織	16,300	858.00	13,985,400	
ダイドーリミテッド	18,800	404.00	7,595,200	
ユナイテッド・スーパーマーケ	18,200	979.00	17,817,800	
野村不動産HLDGS	36,900	2,003.00	73,910,700	
三重交通グループHD	12,000	392.00	4,704,000	
サムティ	5,600	1,085.00	6,076,000	
日本商業開発	3,600	1,989.00	7,160,400	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
プレサンスコーポレーション	9,500	1,500.00	14,250,000	
ユニゾホールディングス	4,900	3,245.00	15,900,500	
日本管理センター	4,700	1,338.00	6,288,600	貸付株式数 1,300株 (1,200株)
フージャースHD	11,000	620.00	6,820,000	
オープンハウス	8,300	2,813.00	23,347,900	
東急不動産HD	134,400	707.00	95,020,800	

飯田GHD	47,000	2,264.00	106,408,000	
帝国繊維	6,600	1,664.00	10,982,400	
ブックオフコーポレーション	8,800	804.00	7,075,200	
日本コークス工業	65,900	110.00	7,249,000	
あさひ	4,900	1,337.00	6,551,300	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
日本調剤	2,100	4,775.00	10,027,500	貸付株式数 500株 (100株)
コスモス薬品	2,900	21,220.00	61,538,000	
シップヘルスケアHD	10,700	3,010.00	32,207,000	
一六堂	22,400	369.00	8,265,600	
ソフトクリエイイトHD	5,800	1,331.00	7,719,800	
セブン&アイ・HLDGS	237,200	4,595.00	1,089,934,000	
薬王堂	3,300	2,178.00	7,187,400	
クリエイイト・レストランツ・ホール	15,600	1,027.00	16,021,200	
ツルハホールディングス	13,100	11,380.00	149,078,000	
サンマルクホールディングス	3,700	3,520.00	13,024,000	
トリドールホールディングス	7,100	2,398.00	17,025,800	
帝人	48,600	2,369.00	115,133,400	
東レ	436,000	957.20	417,339,200	
クラレ	99,900	1,766.00	176,423,400	
旭化成	375,000	1,047.00	392,625,000	
サカイオーベックス	2,800	1,787.00	5,003,600	
稲葉製作所	4,800	1,325.00	6,360,000	
宮地エンジニアリングG	30,000	191.00	5,730,000	
トーカロ	4,400	2,630.00	11,572,000	
SUMCO	63,100	1,560.00	98,436,000	貸付株式数 17,700株 (13,600株)
川田テクノロジーズ	1,300	6,900.00	8,970,000	貸付株式数 300株 (300株)
住江織物	22,000	251.00	5,522,000	貸付株式数 4,000株
アツギ	74,000	126.00	9,324,000	
コメダホールディングス	7,700	1,796.00	13,829,200	貸付株式数 2,100株
ダイユー・リックHLDGS	9,500	695.00	6,602,500	
クスリのアオキHLDGS	5,200	5,190.00	26,988,000	
共和レザー	6,200	838.00	5,195,600	
セーレン	15,400	1,486.00	22,884,400	
ソトー	6,100	1,146.00	6,990,600	貸付株式数 400株
東海染工	53,000	139.00	7,367,000	

小松精練	11,900	740.00	8,806,000	
ワコールホールディングス	34,000	1,382.00	46,988,000	
ホギメディカル	3,800	7,000.00	26,600,000	
T S Iホールディングス	24,400	712.00	17,372,800	
T I S	18,900	2,478.00	46,834,200	
電算システム	3,100	1,896.00	5,877,600	貸付株式数 700株 (700株)
グリー	35,700	621.00	22,169,700	
コーエーテクモHD	13,600	1,958.00	26,628,800	
三菱総合研究所	2,500	3,210.00	8,025,000	
ファインデックス	4,800	908.00	4,358,400	
K L a b	12,200	650.00	7,930,000	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
ポールトゥウィン・ピットクル	5,600	999.00	5,594,400	貸付株式数 1,000株
ネクソン	62,500	1,643.00	102,687,500	
アイスタイル	9,400	784.00	7,369,600	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
エイチーム	3,700	2,170.00	8,029,000	貸付株式数 1,200株 (900株)
テクノスジャパン	4,800	1,122.00	5,385,600	貸付株式数 1,200株
コロプラ	16,100	1,004.00	16,164,400	貸付株式数 4,500株 (4,500株)
ブロードリーフ	15,200	663.00	10,077,600	
ハーツユナイテッドグループ	3,500	1,573.00	5,505,500	貸付株式数 900株
特種東海製紙	3,700	3,960.00	14,652,000	
ティーガイア	5,800	1,914.00	11,101,200	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
豆蔵ホールディングス	5,600	921.00	5,157,600	
テクマトリックス	2,500	1,951.00	4,877,500	
ガンホー・オンライン・エンター	119,600	248.00	29,660,800	貸付株式数 37,300株 (28,900株)
GMOペイメントゲートウェイ	4,800	4,395.00	21,096,000	貸付株式数 1,300株
インターネットイニシアティブ	8,700	1,731.00	15,059,700	
さくらインターネット	4,800	954.00	4,579,200	貸付株式数 1,300株
S R Aホールディングス	3,500	2,434.00	8,519,000	
朝日ネット	17,600	488.00	8,588,800	
コムチュア	1,500	3,260.00	4,890,000	貸付株式数 400株
王子ホールディングス	229,000	501.00	114,729,000	

日本製紙	26,000	2,071.00	53,846,000	
三菱製紙	11,600	773.00	8,966,800	
北越紀州製紙	32,700	682.00	22,301,400	
中越パルプ	28,000	243.00	6,804,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
巴川製紙	19,000	229.00	4,351,000	
大王製紙	23,700	1,288.00	30,525,600	貸付株式数 200株
g u m i	6,700	816.00	5,467,200	貸付株式数 1,900株 (200株)
L I N E	9,600	3,985.00	38,256,000	貸付株式数 2,700株 (2,600株)
レンゴー	56,500	659.00	37,233,500	
トーモク	24,000	330.00	7,920,000	
ザ・パック	4,500	2,695.00	12,127,500	
昭和電工	39,800	1,756.00	69,888,800	
住友化学	441,000	587.00	258,867,000	
日本化成	48,000	166.00	7,968,000	
住友精化	2,600	4,460.00	11,596,000	
日産化学	32,800	3,970.00	130,216,000	
ラサ工業	61,000	139.00	8,479,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
クレハ	4,400	4,590.00	20,196,000	
テイカ	11,000	667.00	7,337,000	
石原産業	11,500	983.00	11,304,500	
日東エフシー	5,900	905.00	5,339,500	
日本曹達	36,000	540.00	19,440,000	
東ソー	174,000	855.00	148,770,000	
トクヤマ	94,000	465.00	43,710,000	
セントラル硝子	61,000	537.00	32,757,000	
東亜合成	35,500	1,140.00	40,470,000	
大阪ソーダ	27,000	480.00	12,960,000	
関東電化	13,000	1,037.00	13,481,000	
デンカ	122,000	530.00	64,660,000	
イビデン	39,500	1,685.00	66,557,500	貸付株式数 9,700株 (9,700株)
信越化学	107,900	9,169.00	989,335,100	
日本カ-バイド	51,000	159.00	8,109,000	
堺 化 学	22,000	389.00	8,558,000	
エア・ウォーター	49,200	2,114.00	104,008,800	
大陽日酸	46,500	1,391.00	64,681,500	



日本化学工業	26,000	244.00	6,344,000	
日本パ - カライジング	30,200	1,420.00	42,884,000	
高压ガス	10,400	759.00	7,893,600	
四国化成	9,000	1,055.00	9,495,000	
戸田工業	16,000	289.00	4,624,000	
ステラ ケミファ	3,000	2,968.00	8,904,000	貸付株式数 300株
保土谷化学	2,400	2,710.00	6,504,000	
日本触媒	9,300	7,370.00	68,541,000	
大日精化	24,000	639.00	15,336,000	
カネカ	80,000	988.00	79,040,000	
協和発酵キリン	72,000	1,627.00	117,144,000	
三菱瓦斯化学	55,700	1,999.00	111,344,300	
三井化学	272,000	548.00	149,056,000	
J S R	59,800	1,816.00	108,596,800	
東京応化工業	11,300	3,790.00	42,827,000	
大阪有機化学	6,100	1,008.00	6,148,800	
三菱ケミカルH L D G S	401,000	791.10	317,231,100	
ダイセル	81,200	1,335.00	108,402,000	
住友ベ - クライト	52,000	664.00	34,528,000	
積水化学	136,000	1,815.00	246,840,000	
日本ゼオン	50,000	1,130.00	56,500,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
アイカ工業	19,000	3,085.00	58,615,000	
宇部興産	297,000	248.00	73,656,000	
積水樹脂	9,400	1,868.00	17,559,200	
タキロン	15,000	518.00	7,770,000	
旭有機材	33,000	222.00	7,326,000	
日立化成	33,200	2,906.00	96,479,200	
ニチバン	7,000	823.00	5,761,000	
リケンテクノス	13,900	546.00	7,589,400	
大倉工業	18,000	493.00	8,874,000	
積水化成品	9,000	826.00	7,434,000	
群栄化学	1,800	3,240.00	5,832,000	
タイガース ポリマー	6,100	819.00	4,995,900	
ダイキョーニシカワ	10,800	1,514.00	16,351,200	
日本化薬	39,000	1,433.00	55,887,000	貸付株式数 10,000株
カーリットホールディングス	13,300	560.00	7,448,000	
E P Sホールディングス	7,700	1,343.00	10,341,100	
プレステージ・インター	9,800	732.00	7,173,600	
アミューズ	3,800	1,727.00	6,562,600	

野村総合研究所	38,500	3,975.00	153,037,500	
ドリームインキュベータ	2,100	2,031.00	4,265,100	貸付株式数 600株 (400株)
クイック	4,400	1,011.00	4,448,400	
ケネディクス	80,500	428.00	34,454,000	
電通	66,900	5,710.00	381,999,000	
インテージホールディングス	3,700	1,979.00	7,322,300	
イオンファンタジー	1,900	3,020.00	5,738,000	貸付株式数 700株 (700株)
シーティーエス	4,900	1,167.00	5,718,300	
日本精化	8,400	897.00	7,534,800	
扶桑化学工業	4,400	2,419.00	10,643,600	
A D E K A	24,800	1,666.00	41,316,800	
日油	47,000	1,090.00	51,230,000	
ミヨシ油脂	56,000	149.00	8,344,000	
花 王	153,100	5,616.00	859,809,600	
第一工業製薬	19,000	370.00	7,030,000	
三洋化成	3,500	5,050.00	17,675,000	
武田薬品	225,300	4,820.00	1,085,946,000	
アステラス製薬	614,400	1,630.50	1,001,779,200	
大日本住友製薬	42,500	1,947.00	82,747,500	
塩野義製薬	81,500	5,243.00	427,304,500	
田辺三菱製薬	70,200	2,269.00	159,283,800	
あすか製薬	7,100	1,650.00	11,715,000	
日本新薬	13,900	5,660.00	78,674,000	
中外製薬	60,100	3,315.00	199,231,500	貸付株式数 16,900株
科研製薬	11,200	6,240.00	69,888,000	
エーザイ	74,100	6,764.00	501,212,400	
理研ビタミン	2,000	4,685.00	9,370,000	
ロート製薬	29,300	1,799.00	52,710,700	
小野薬品	137,000	2,496.50	342,020,500	
久光製薬	16,800	5,630.00	94,584,000	貸付株式数 4,800株
持田製薬	4,000	8,030.00	32,120,000	
参天製薬	110,100	1,400.00	154,140,000	
扶桑薬品	2,700	2,779.00	7,503,300	
日本ケミファ	1,200	5,440.00	6,528,000	
ツムラ	19,900	3,200.00	63,680,000	貸付株式数 5,700株
日医工	14,000	1,713.00	23,982,000	
テ ル モ	87,900	4,215.00	370,498,500	
みらかホールディングス	15,200	5,190.00	78,888,000	

キッセイ薬品工業	10,300	2,837.00	29,221,100	
生化学工業	11,100	1,685.00	18,703,500	
栄研化学	5,100	2,950.00	15,045,000	
日水製薬	4,500	1,279.00	5,755,500	
鳥居薬品	4,300	2,550.00	10,965,000	
J C R ファーマ	4,900	2,658.00	13,024,200	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
東和薬品	2,900	4,515.00	13,093,500	貸付株式数 700株
富士製薬工業	2,300	2,656.00	6,108,800	
沢井製薬	10,100	6,140.00	62,014,000	
ゼリア新薬工業	12,200	1,838.00	22,423,600	
第一三共	176,800	2,410.50	426,176,400	
キョーリン製薬HD	14,000	2,482.00	34,748,000	
大幸薬品	4,100	1,815.00	7,441,500	
ダイト	3,900	2,199.00	8,576,100	
大塚ホールディングス	129,400	5,008.00	648,035,200	
大正製薬HD	12,800	9,750.00	124,800,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
ペプチドリーム	10,300	5,660.00	58,298,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
大日本塗料	37,000	225.00	8,325,000	
日本ペイントHOLD	46,400	3,190.00	148,016,000	貸付株式数 13,200株
関西ペイント	62,900	2,135.00	134,291,500	貸付株式数 17,900株
中国塗料	17,600	871.00	15,329,600	
日本特殊塗料	5,000	1,689.00	8,445,000	
藤倉化成	11,100	660.00	7,326,000	
太陽ホールディングス	4,800	4,640.00	22,272,000	
D I C	23,600	3,685.00	86,966,000	
サカイクス	12,000	1,466.00	17,592,000	
東洋インキSCホールディン	54,000	540.00	29,160,000	
T & K TOKA	6,300	1,007.00	6,344,100	
アルプス技研	2,900	2,508.00	7,273,200	
オリエンタルランド	65,100	6,683.00	435,063,300	
ダスキン	14,800	2,324.00	34,395,200	
パーク24	28,700	3,045.00	87,391,500	
明光ネットワークジャパン	9,000	1,066.00	9,594,000	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
ファルコホールディングス	6,400	1,454.00	9,305,600	
フジ・メディア・HD	58,300	1,663.00	96,952,900	
ラウンドワン	19,400	790.00	15,326,000	

リゾートトラスト	23,300	2,199.00	51,236,700	
オービック	19,500	5,140.00	100,230,000	
ジャストシステム	9,900	1,045.00	10,345,500	
TDCソフトウェアエンジニア	4,700	1,160.00	5,452,000	
ヤフー	412,500	443.00	182,737,500	貸付株式数 105,500株 (102,900株)
ビー・エム・エル	7,900	2,809.00	22,191,100	
トレンドマイクロ	30,000	4,340.00	130,200,000	
りらいあコミュニケーション	10,300	1,096.00	11,288,800	
リソー教育	11,500	572.00	6,578,000	
日本オラクル	9,300	5,660.00	52,638,000	
フューチャー	10,200	731.00	7,456,200	
CAC HOLDINGS	6,700	934.00	6,257,800	
ソフトバンク・テクノ	1,600	3,165.00	5,064,000	貸付株式数 200株
ユー・エス・エス	72,500	1,856.00	134,560,000	
オービックビジネスC	3,000	5,130.00	15,390,000	貸付株式数 800株 (800株)
伊藤忠テクノソリューションズ	13,000	2,964.00	38,532,000	
アイティフォー	11,100	627.00	6,959,700	
サイバーエージェント	31,700	2,713.00	86,002,100	
楽天	307,700	1,147.50	353,085,750	貸付株式数 87,000株
テー・オー・ダブリュー	8,000	662.00	5,296,000	
大塚商会	15,300	5,550.00	84,915,000	
総合メディカル	3,000	4,390.00	13,170,000	
サイボウズ	12,600	458.00	5,770,800	
ソフトブレーン	10,100	384.00	3,878,400	
セントラルスポーツ	3,100	2,787.00	8,639,700	
パラカ	2,700	1,954.00	5,275,800	
電通国際情報S	3,900	1,850.00	7,215,000	
デジタルガレージ	9,100	1,976.00	17,981,600	
ウェザーニューズ	2,200	3,560.00	7,832,000	貸付株式数 700株 (700株)
C I J	16,400	532.00	8,724,800	
WOWOW	3,100	3,270.00	10,137,000	貸付株式数 800株
フルキャストホールディングス	7,100	919.00	6,524,900	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
富士フイルムHLDGS	119,000	4,477.00	532,763,000	
コニカミノルタ	133,300	1,161.00	154,761,300	
資生堂	114,300	2,991.00	341,871,300	

ライオン	75,000	1,869.00	140,175,000	
高砂香料	4,000	3,085.00	12,340,000	
マンダム	6,100	4,985.00	30,408,500	
ミルボン	3,400	4,425.00	15,045,000	
ファンケル	12,900	1,633.00	21,065,700	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
コーセー	9,800	9,920.00	97,216,000	
シーズ・ホールディングス	7,900	3,345.00	26,425,500	
ポーラ・オルビスHD	6,200	9,520.00	59,024,000	
ノエビアホールディングス	3,900	3,625.00	14,137,500	
コニシ	9,900	1,267.00	12,543,300	
長谷川香料	7,600	1,998.00	15,184,800	
星光PMC	4,200	1,198.00	5,031,600	貸付株式数 1,100株 (100株)
小林製薬	16,800	5,090.00	85,512,000	
荒川化学工業	5,500	1,786.00	9,823,000	
メック	5,600	923.00	5,168,800	
日本高純度化学	3,800	2,454.00	9,325,200	貸付株式数 800株 (800株)
タカラバイオ	12,900	1,460.00	18,834,000	貸付株式数 3,600株
JCU	2,100	5,330.00	11,193,000	
新田ゼラチン	8,500	720.00	6,120,000	
デクセリアルズ	15,800	1,046.00	16,526,800	
アース製薬	4,500	4,850.00	21,825,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
イハラケミカル	9,200	1,166.00	10,727,200	
北興化学	14,000	460.00	6,440,000	
大成ラミック	3,400	3,085.00	10,489,000	
クミアイ化学	13,400	730.00	9,782,000	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
日本農薬	14,100	661.00	9,320,100	貸付株式数 100株 (100株)
昭和シェル石油	53,400	1,147.00	61,249,800	
ニチレキ	9,300	914.00	8,500,200	
東燃ゼネラル石油	97,000	1,265.00	122,705,000	
ユシロ化学	4,800	1,450.00	6,960,000	
富士石油	16,600	421.00	6,988,600	
MORESCO	3,800	1,606.00	6,102,800	
出光興産	28,500	3,165.00	90,202,500	
JXホールディングス	661,200	503.40	332,848,080	

コスモエネルギーHLDGS	18,200	1,702.00	30,976,400	貸付株式数 5,100株 (5,100株)
横浜ゴム	36,100	2,190.00	79,059,000	
東洋ゴム	31,900	1,593.00	50,816,700	
ブリヂストン	202,900	4,415.00	895,803,500	
住友ゴム	55,700	1,943.00	108,225,100	
藤倉ゴム	10,400	692.00	7,196,800	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
オカモト	19,000	1,047.00	19,893,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
アキレス	5,700	1,640.00	9,348,000	
ニッタ	5,400	3,200.00	17,280,000	
住友理工	10,600	1,147.00	12,158,200	
三ツ星ベルト	15,000	1,002.00	15,030,000	
バンドー化学	10,900	1,050.00	11,445,000	
旭硝子	296,000	842.00	249,232,000	
日本板硝子	27,400	900.00	24,660,000	
有沢製作所	12,800	658.00	8,422,400	
日本山村硝子	34,000	206.00	7,004,000	
日本電気硝子	123,000	663.00	81,549,000	
住友大阪セメント	111,000	423.00	46,953,000	貸付株式数 31,000株
太平洋セメント	362,000	368.00	133,216,000	
日本ヒューム	8,700	720.00	6,264,000	
日本コンクリート	17,500	356.00	6,230,000	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
アジアパイルHD	10,800	544.00	5,875,200	
東海カーボン	56,000	391.00	21,896,000	
日本カーボン	36,000	246.00	8,856,000	貸付株式数 10,000株 (9,000株)
東洋炭素	3,800	1,914.00	7,273,200	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ノリタケ	3,600	2,742.00	9,871,200	
TOTO	44,100	4,640.00	204,624,000	
日本碍子	76,100	2,361.00	179,672,100	
日本特殊陶業	52,000	2,762.00	143,624,000	
MARUWA	2,400	3,975.00	9,540,000	
品川リフラクトリーズ	25,000	249.00	6,225,000	
黒崎播磨	18,000	317.00	5,706,000	
フジミインコーポレーテッド	5,400	2,189.00	11,820,600	貸付株式数 1,500株 (1,500株)

ニチアス	32,000	1,109.00	35,488,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
新日鐵住金	271,100	2,703.00	732,783,300	
神戸製鋼所	103,500	1,215.00	125,752,500	
中山製鋼所	7,800	761.00	5,935,800	
合同製鐵	3,700	2,182.00	8,073,400	
J F E ホールディングス	164,000	1,872.00	307,008,000	
日新製鋼	26,900	1,479.00	39,785,100	貸付株式数 7,600株 (7,600株)
東京製鐵	30,400	881.00	26,782,400	
共英製鋼	6,500	2,123.00	13,799,500	
大和工業	11,900	3,300.00	39,270,000	
東京鐵鋼	16,000	484.00	7,744,000	
大阪製鐵	4,100	2,066.00	8,470,600	
淀川製鋼所	8,100	3,145.00	25,474,500	
東洋鋼鈹	15,700	392.00	6,154,400	
丸一鋼管	19,900	3,715.00	73,928,500	
大同特殊鋼	99,000	502.00	49,698,000	
日本高周波	89,000	88.00	7,832,000	
日本冶金工	57,600	203.00	11,692,800	貸付株式数 17,300株 (17,300株)
山陽特殊製鋼	35,000	566.00	19,810,000	
愛知製鋼	3,400	5,200.00	17,680,000	
日立金属	61,000	1,599.00	97,539,000	
大平洋金属	39,000	396.00	15,444,000	貸付株式数 10,000株
新日本電工	40,600	254.00	10,312,400	
栗本鉄工所	3,300	2,407.00	7,943,100	
日本鑄鉄管	25,000	196.00	4,900,000	
日本製鋼所	19,900	2,092.00	41,630,800	
三菱製鋼	45,000	235.00	10,575,000	
大紀アルミニウム	14,000	528.00	7,392,000	
日本輕金属HD	130,200	252.00	32,810,400	貸付株式数 37,300株
三井金属	163,000	314.00	51,182,000	
東邦亜鉛	35,000	475.00	16,625,000	
三菱マテリアル	37,300	3,710.00	138,383,000	
住友鋁山	156,000	1,537.00	239,772,000	
D O W A ホールディングス	67,000	916.00	61,372,000	
古河機金	97,000	223.00	21,631,000	貸付株式数 27,000株 (27,000株)

大阪チタニウム	7,100	1,666.00	11,828,600	貸付株式数 1,900株 (1,800株)
東邦チタニウム	11,000	818.00	8,998,000	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
U A C J	76,000	312.00	23,712,000	
古河電工	20,000	3,345.00	66,900,000	
住友電工	226,200	1,689.00	382,051,800	
フジクラ	76,900	636.00	48,908,400	
昭和電線H L D G S	101,000	92.00	9,292,000	
タツタ電線	13,400	467.00	6,257,800	
リョービ	37,000	489.00	18,093,000	
アーレステイ	7,700	1,248.00	9,609,600	
アサヒHD	8,900	2,075.00	18,467,500	
東洋製罐グループHD	41,700	2,222.00	92,657,400	
ホッカンホールディングス	21,000	434.00	9,114,000	
横河ブリッジH L D G S	11,000	1,352.00	14,872,000	
O S J B H D	24,200	246.00	5,953,200	貸付株式数 6,700株 (6,500株)
駒井ハルテック	2,800	2,194.00	6,143,200	
三和ホールディングス	59,600	1,118.00	66,632,800	
文化シャツタ -	17,400	926.00	16,112,400	
三協立山	7,900	1,681.00	13,279,900	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
アルインコ	6,500	1,038.00	6,747,000	
L I X I Lグループ	83,800	2,686.00	225,086,800	貸付株式数 23,800株 (23,800株)
ノーリツ	11,500	2,060.00	23,690,000	
長府製作所	6,500	2,734.00	17,771,000	
リンナイ	10,200	9,400.00	95,880,000	
ユニプレス	11,100	2,338.00	25,951,800	
岡 部	13,300	1,004.00	13,353,200	
ジーテクト	6,300	2,361.00	14,874,300	
東 プ レ	11,600	2,962.00	34,359,200	
高周波熱錬	12,000	900.00	10,800,000	
東京製綱	4,600	2,043.00	9,397,800	貸付株式数 1,300株
パイオラックス	3,100	7,530.00	23,343,000	
日本発条	54,900	1,085.00	59,566,500	貸付株式数 14,900株
三浦工業	24,600	1,784.00	43,886,400	
タ ク マ	19,400	916.00	17,770,400	
テクノプロ・ホールディング	9,900	3,635.00	35,986,500	



ジャパンマテリアル	2,400	3,590.00	8,616,000	貸付株式数 700株 (300株)
ベクトル	5,600	1,079.00	6,042,400	
アサンテ	3,600	1,704.00	6,134,400	
N・フィールド	3,800	1,399.00	5,316,200	貸付株式数 1,000株
リクルートホールディングス	131,100	4,545.00	595,849,500	
ツガミ	17,000	702.00	11,934,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
オークマ	39,000	1,147.00	44,733,000	貸付株式数 11,000株 (11,000株)
東芝機械	36,000	475.00	17,100,000	
アマダホールディングス	79,700	1,318.00	105,044,600	
アイダエンジニア	17,300	1,090.00	18,857,000	
滝澤鉄工所	54,000	165.00	8,910,000	
富士機械製造	18,000	1,368.00	24,624,000	貸付株式数 5,600株
牧野フライス	30,000	962.00	28,860,000	
オーエスジー	26,800	2,357.00	63,167,600	貸付株式数 7,600株 (7,600株)
旭ダイヤモンド	17,800	878.00	15,628,400	
D M G 森精機	35,700	1,540.00	54,978,000	貸付株式数 9,400株 (9,400株)
ソディック	16,000	982.00	15,712,000	
ディスコ	7,000	13,420.00	93,940,000	
日東工器	3,900	2,493.00	9,722,700	
日本郵政	156,400	1,545.00	241,638,000	
ベルシステム24HLDGS	9,700	961.00	9,321,700	
豊田自動織機	52,300	5,750.00	300,725,000	
OKK	65,000	119.00	7,735,000	
島精機製作所	7,900	3,840.00	30,336,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
フリーー	1,400	3,310.00	4,634,000	
日阪製作所	10,000	894.00	8,940,000	
やまびこ	11,700	1,421.00	16,625,700	
ペガサスミシン製造	8,400	710.00	5,964,000	
ナブテスコ	30,900	2,788.00	86,149,200	
三井海洋開発	6,000	1,927.00	11,562,000	貸付株式数 1,600株
レオン自動機	6,600	888.00	5,860,800	
S M C	18,000	28,375.00	510,750,000	貸付株式数 5,000株
新川	7,100	769.00	5,459,900	
ホソカワミクロン	13,000	774.00	10,062,000	

ユニオンツール	2,700	2,982.00	8,051,400	貸付株式数 800株 (800株)
オイレス工業	7,700	2,097.00	16,146,900	
サト - ホールディングス	7,700	2,475.00	19,057,500	
日精樹脂工業	6,200	1,015.00	6,293,000	
小松製作所	277,400	2,649.50	734,971,300	貸付株式数 83,600株 (83,600株)
住友重機械	175,000	756.00	132,300,000	
日立建機	26,600	2,513.00	66,845,800	
巴工業	4,900	1,577.00	7,727,300	
井関農機	62,000	233.00	14,446,000	貸付株式数 18,000株 (18,000株)
TOWA	5,700	1,368.00	7,797,600	
丸山製作所	43,000	191.00	8,213,000	
北川鉄工所	3,600	2,348.00	8,452,800	
シンニッタン	10,300	671.00	6,911,300	
ローツェ	2,400	1,679.00	4,029,600	貸付株式数 600株
クボタ	288,600	1,725.50	497,979,300	貸付株式数 81,300株 (81,300株)
東洋エンジニア	37,000	307.00	11,359,000	
三菱化工機	34,000	223.00	7,582,000	
月島機械	11,900	1,258.00	14,970,200	
帝国電機製作所	6,800	972.00	6,609,600	
新東工業	14,400	1,049.00	15,105,600	
渋谷工業	5,200	2,412.00	12,542,400	貸付株式数 600株
アイチ コーポレーション	9,700	865.00	8,390,500	
小森コーポレーション	14,300	1,541.00	22,036,300	
鶴見製作所	5,200	1,745.00	9,074,000	
住友精密	18,000	366.00	6,588,000	
荏原製作所	24,600	3,205.00	78,843,000	
西島製作所	7,400	1,117.00	8,265,800	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
北越工業	10,000	798.00	7,980,000	
千代田化工建	45,000	857.00	38,565,000	
ダイキン工業	78,300	10,700.00	837,810,000	
オルガノ	16,000	466.00	7,456,000	
ト - ヨ - カネツ	32,000	315.00	10,080,000	
栗田工業	33,200	2,470.00	82,004,000	
椿本チエイン	33,000	980.00	32,340,000	
日 機 装	19,700	1,077.00	21,216,900	

新興プランテック	14,400	859.00	12,369,600	
アネスト岩田	11,400	1,142.00	13,018,800	
ダイフク	29,000	2,341.00	67,889,000	
加藤製作所	3,600	2,973.00	10,702,800	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
油研工業	38,000	216.00	8,208,000	
タダノ	30,200	1,573.00	47,504,600	
フジテック	17,000	1,336.00	22,712,000	貸付株式数 4,600株
C K D	17,100	1,444.00	24,692,400	
キトー	8,500	1,247.00	10,599,500	
平和	17,500	2,640.00	46,200,000	
理想科学工業	5,800	1,984.00	11,507,200	
S A N K Y O	15,500	3,800.00	58,900,000	
日本金銭機械	5,800	1,425.00	8,265,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	3,500	2,219.00	7,766,500	
福島工業	3,800	3,220.00	12,236,000	
ダイコク電機	3,300	1,789.00	5,903,700	貸付株式数 900株 (900株)
竹内製作所	10,700	2,670.00	28,569,000	
ア マ ノ	17,600	2,049.00	36,062,400	
J U K I	9,900	1,114.00	11,028,600	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
サンデンホールディングス	37,000	387.00	14,319,000	
蛇の目ミシン	7,300	849.00	6,197,700	
ブラザー工業	74,100	2,129.00	157,758,900	
マックス	9,000	1,450.00	13,050,000	
モリタホールディングス	10,900	1,621.00	17,668,900	
グローリー	18,200	3,725.00	67,795,000	
新晃工業	4,800	1,379.00	6,619,200	
大和冷機工業	9,700	912.00	8,846,400	
セガサミーホールディングス	56,700	1,785.00	101,209,500	
日本ピストンリング	4,300	2,092.00	8,995,600	
リ ケ ン	2,900	4,495.00	13,035,500	
T P R	6,500	3,450.00	22,425,000	
ツバキ・ナカシマ	6,600	1,743.00	11,503,800	
ホシザキ	12,600	8,850.00	111,510,000	
大豊工業	5,000	1,693.00	8,465,000	
日本精工	118,000	1,410.00	166,380,000	
N T N	132,000	511.00	67,452,000	

ジェイテクト	60,700	1,942.00	117,879,400	
不二越	56,000	519.00	29,064,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
ミネベア	92,600	1,198.00	110,934,800	
日本トムソン	20,200	513.00	10,362,600	
T H K	40,200	2,620.00	105,324,000	
ユーシン精機	2,900	2,705.00	7,844,500	貸付株式数 800株 (800株)
イーグル工業	6,400	1,601.00	10,246,400	
日本ピラ - 工業	7,200	1,225.00	8,820,000	
キッツ	27,400	674.00	18,467,600	
日立	1,376,000	651.20	896,051,200	
東芝	1,285,000	463.10	595,083,500	
三菱電機	612,000	1,656.00	1,013,472,000	
富士電機	172,000	606.00	104,232,000	
東洋電機製造	3,600	1,626.00	5,853,600	
安川電機	66,000	1,837.00	121,242,000	
シンフォニア テクノロジー	41,000	274.00	11,234,000	
明電舎	53,000	399.00	21,147,000	
山洋電気	16,000	841.00	13,456,000	
デンヨー	5,700	1,609.00	9,171,300	
日立工機	14,900	1,229.00	18,312,100	
三桜工業	10,200	791.00	8,068,200	
マキタ	37,400	7,740.00	289,476,000	
東芝テック	36,000	572.00	20,592,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
芝浦メカトロニクス	18,000	266.00	4,788,000	
マブチモーター	16,200	6,330.00	102,546,000	
日本電産	74,500	10,025.00	746,862,500	
東光高岳	3,300	2,054.00	6,778,200	
ダブル・スコープ	5,700	1,598.00	9,108,600	貸付株式数 1,500株
ダイヘン	31,000	736.00	22,816,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
田淵電機	12,200	416.00	5,075,200	貸付株式数 1,000株
J V C ケンウッド	43,800	321.00	14,059,800	
日新電機	11,700	1,229.00	14,379,300	
大崎電気	12,000	1,203.00	14,436,000	
オムロン	61,000	4,600.00	280,600,000	
日東工業	8,000	1,657.00	13,256,000	

I D E C	8,200	1,117.00	9,159,400	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
ジーエス・ユアサ コーポ	109,000	493.00	53,737,000	
サクサホールディングス	20,000	220.00	4,400,000	
メルコホールディングス	3,400	3,195.00	10,863,000	貸付株式数 1,000株
日本電気	787,000	321.00	252,627,000	
富 士 通	554,000	688.90	381,650,600	
沖 電 気	24,600	1,681.00	41,352,600	
電気興業	18,000	579.00	10,422,000	
サンケン電気	34,000	565.00	19,210,000	
アイホン	4,100	1,927.00	7,900,700	
ルネサスエレクトロニクス	31,800	1,005.00	31,959,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
セイコーエプソン	85,300	2,445.00	208,558,500	
ワコム	46,200	310.00	14,322,000	貸付株式数 15,100株 (15,100株)
アルバック	10,600	3,510.00	37,206,000	
アクセル	5,100	1,005.00	5,125,500	
E I Z O	5,700	3,525.00	20,092,500	
ジャパンディスプレイ	107,300	343.00	36,803,900	貸付株式数 30,400株 (30,400株)
日本信号	15,800	959.00	15,152,200	
京三製作所	19,000	390.00	7,410,000	
能美防災	6,700	1,733.00	11,611,100	
ホーチキ	5,100	1,360.00	6,936,000	
エレコム	5,400	1,949.00	10,524,600	
日本無線	4,000	1,354.00	5,416,000	
パナソニック	656,300	1,281.00	840,720,300	
アンリツ	40,700	637.00	25,925,900	
富士通ゼネラル	20,000	2,298.00	45,960,000	
日立国際電気	15,100	2,360.00	35,636,000	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
ソ ニ ー	405,200	3,381.00	1,369,981,200	
T D K	32,300	8,350.00	269,705,000	
帝国通信工業	32,000	178.00	5,696,000	
ミツミ電機	20,600	703.00	14,481,800	
タムラ製作所	24,000	451.00	10,824,000	
アルプス電気	53,100	2,918.00	154,945,800	
パイオニア	86,800	252.00	21,873,600	
日本電波工業	7,700	901.00	6,937,700	

日本トリム	1,500	4,380.00	6,570,000	貸付株式数 400株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,400	3,125.00	10,625,000	貸付株式数 900株 (900株)
フオスタ - 電機	6,900	2,245.00	15,490,500	
クラリオン	31,000	420.00	13,020,000	
S M K	17,000	444.00	7,548,000	
ヨコオ	6,900	928.00	6,403,200	
ホシデン	18,000	974.00	17,532,000	
ヒロセ電機	9,200	14,390.00	132,388,000	
日本航空電子	18,000	1,766.00	31,788,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
T O A	7,900	1,047.00	8,271,300	
日立マクセル	8,500	2,079.00	17,671,500	
古野電気	8,600	866.00	7,447,600	
ユニデンホールディングス	40,000	174.00	6,960,000	
アルパイン	13,700	1,558.00	21,344,600	
スミダコーポレーション	5,300	983.00	5,209,900	
アイコム	4,000	2,128.00	8,512,000	
リオン	3,400	1,626.00	5,528,400	
船井電機	7,000	988.00	6,916,000	貸付株式数 1,800株 (1,700株)
横河電機	61,300	1,690.00	103,597,000	
新電元工業	22,000	456.00	10,032,000	
アズビル	17,000	3,265.00	55,505,000	
日本光電工業	23,800	2,576.00	61,308,800	貸付株式数 6,800株
共和電業	15,500	405.00	6,277,500	
堀場製作所	11,200	5,430.00	60,816,000	
アドバンテスト	38,900	1,640.00	63,796,000	
エスベック	5,900	1,304.00	7,693,600	
キーエンス	13,000	79,330.00	1,031,290,000	
日置電機	3,500	2,158.00	7,553,000	貸付株式数 1,000株
シスメックス	44,700	6,500.00	290,550,000	
日本マイクロニクス	11,300	1,105.00	12,486,500	
メガチップス	5,700	2,499.00	14,244,300	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
O B A R A G R O U P	3,500	5,380.00	18,830,000	貸付株式数 900株 (900株)
デンソー	141,600	5,175.00	732,780,000	
コーセル	8,700	1,313.00	11,423,100	

イリソ電子工業	1,800	6,640.00	11,952,000	
オプテックス	4,500	2,559.00	11,515,500	
千代田インテグレ	3,400	2,481.00	8,435,400	
レーザーテック	7,000	2,048.00	14,336,000	
スタンレー電気	40,900	3,225.00	131,902,500	
岩崎電気	37,000	184.00	6,808,000	
ウシオ電機	34,800	1,486.00	51,712,800	
日本セラミック	5,100	2,096.00	10,689,600	貸付株式数 1,300株 (1,000株)
遠藤照明	6,400	866.00	5,542,400	
日本デジタル研究所	6,100	2,397.00	14,621,700	
古河電池	6,000	753.00	4,518,000	
山一電機	6,500	1,121.00	7,286,500	貸付株式数 1,600株
図 研	5,300	1,214.00	6,434,200	
日本電子	22,000	528.00	11,616,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
カ シ オ	48,200	1,706.00	82,229,200	貸付株式数 13,700株
ファナック	58,200	20,340.00	1,183,788,000	
日本シイエムケイ	13,600	713.00	9,696,800	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
エンプラス	2,700	3,620.00	9,774,000	
ロ - ム	27,700	6,760.00	187,252,000	
浜松ホトニクス	44,700	3,125.00	139,687,500	貸付株式数 12,500株
三井ハイテック	8,800	842.00	7,409,600	
新光電気工業	20,000	798.00	15,960,000	
京 セ ラ	94,100	5,860.00	551,426,000	
太陽誘電	27,200	1,410.00	38,352,000	貸付株式数 8,000株
村田製作所	60,300	15,985.00	963,895,500	
ユーシン	10,000	734.00	7,340,000	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
双葉電子工業	9,500	1,956.00	18,582,000	
日東電工	43,400	9,127.00	396,111,800	
北陸電気工業	45,000	135.00	6,075,000	
東海理化電機	15,000	2,422.00	36,330,000	
ニチコン	18,000	1,028.00	18,504,000	
日本ケミコン	52,000	266.00	13,832,000	
K O A	8,800	1,137.00	10,005,600	
三井造船	201,000	184.00	36,984,000	
日立造船	43,100	622.00	26,808,200	
三菱重工業	962,000	550.80	529,869,600	

川崎重工業	447,000	390.00	174,330,000	
I H I	441,000	324.00	142,884,000	貸付株式数 124,000株 (124,000株)
名村造船所	17,900	830.00	14,857,000	
日本車輛	26,000	277.00	7,202,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
F P G	21,000	934.00	19,614,000	貸付株式数 5,800株
じもとホールディングス	49,700	208.00	10,337,600	
全国保証	16,200	3,775.00	61,155,000	
めぶきフィナンシャルG	272,400	451.00	122,852,400	
東京T YフィナンシャルG	8,200	4,370.00	35,834,000	
九州フィナンシャルG	92,400	836.00	77,246,400	
かんぼ生命保険	21,600	2,583.00	55,792,800	貸付株式数 6,100株
ゆうちょ銀行	161,000	1,473.00	237,153,000	
富山第一銀行	15,900	567.00	9,015,300	
コンコルディア・フィナンシャル	370,000	585.00	216,450,000	
西日本フィナンシャルHD	37,600	1,186.00	44,593,600	
日産自動車	686,700	1,169.00	802,752,300	
いすゞ自動車	166,600	1,516.50	252,648,900	
トヨタ自動車	714,100	7,144.00	5,101,530,400	
日野自動車	81,400	1,200.00	97,680,000	
三菱自動車工業	211,700	659.00	139,510,300	
エフテック	4,400	1,363.00	5,997,200	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
武蔵精密工業	6,700	3,075.00	20,602,500	
日産車体	24,900	1,148.00	28,585,200	
新明和工業	23,000	1,054.00	24,242,000	
極東開発工業	11,700	1,540.00	18,018,000	
日信工業	12,300	1,848.00	22,730,400	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
トピー工業	4,800	3,025.00	14,520,000	
ティラド	27,000	315.00	8,505,000	
曙ブレーキ	29,200	313.00	9,139,600	貸付株式数 10,100株 (10,100株)
タチエス	10,000	1,947.00	19,470,000	
N O K	27,700	2,464.00	68,252,800	
フタバ産業	18,800	716.00	13,460,800	
K Y B	64,000	550.00	35,200,000	
市光工業	15,000	379.00	5,685,000	



大同メタル工業	7,800	1,234.00	9,625,200	
プレス工業	31,500	548.00	17,262,000	
カルソニックカンセイ	40,000	1,762.00	70,480,000	
太平洋工業	12,100	1,497.00	18,113,700	貸付株式数 3,800株
ケーヒン	12,800	2,035.00	26,048,000	
河西工業	8,200	1,417.00	11,619,400	
アイシン精機	52,500	5,210.00	273,525,000	
マ ッ ダ	181,700	2,041.50	370,940,550	
今仙電機製作所	7,300	1,055.00	7,701,500	貸付株式数 1,900株
本田技研	516,700	3,533.00	1,825,501,100	
スズキ	114,000	4,205.00	479,370,000	
富士重工業	178,400	4,871.00	868,986,400	
ヤマハ発動機	81,200	2,786.00	226,223,200	貸付株式数 22,700株
ショーワ	16,100	786.00	12,654,600	
小糸製作所	34,600	6,160.00	213,136,000	
T B K	17,100	491.00	8,396,100	
エクセディ	7,500	3,265.00	24,487,500	
ミツバ	10,800	1,802.00	19,461,600	
豊田合成	18,100	2,714.00	49,123,400	
愛三工業	9,900	1,011.00	10,008,900	
ヨ ロ ズ	5,700	1,733.00	9,878,100	
エフ・シー・シー	9,600	2,176.00	20,889,600	
シマノ	23,100	18,820.00	434,742,000	
テイ・エス テック	13,100	3,115.00	40,806,500	
ジャムコ	3,700	2,469.00	9,135,300	貸付株式数 1,100株 (900株)
小 野 建	5,800	1,365.00	7,917,000	
ノ ジ マ	6,800	1,286.00	8,744,800	貸付株式数 1,800株
佐鳥電機	8,900	741.00	6,594,900	
カッパ・クリエイト	8,800	1,291.00	11,360,800	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
伯東	5,500	1,031.00	5,670,500	
コンドーテック	8,300	846.00	7,021,800	
ライトオン	5,100	1,080.00	5,508,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,500	2,504.00	21,284,000	
三菱食品	6,100	3,430.00	20,923,000	
良品計画	7,500	22,520.00	168,900,000	
松田産業	4,800	1,520.00	7,296,000	
第一興商	9,100	4,540.00	41,314,000	

メディパルHD	56,500	1,816.00	102,604,000	
アドヴァン	6,700	1,202.00	8,053,400	
萩原電気	3,300	2,114.00	6,976,200	
アルビス	2,200	3,245.00	7,139,000	
アズワン	4,500	5,030.00	22,635,000	
シモジマ	6,200	1,131.00	7,012,200	
ドウシシャ	7,100	2,045.00	14,519,500	
小津産業	2,600	2,105.00	5,473,000	
コナカ	12,500	596.00	7,450,000	
コーナン商事	7,900	2,255.00	17,814,500	
黒田電気	7,700	2,371.00	18,256,700	
ネットワンシステムズ	24,500	753.00	18,448,500	
ワタミ	7,200	1,090.00	7,848,000	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	36,700	4,370.00	160,379,000	
丸文	8,200	700.00	5,740,000	
西松屋チェーン	10,200	1,466.00	14,953,200	
ゼンショーホールディングス	29,100	1,910.00	55,581,000	
ハピネット	5,800	1,294.00	7,505,200	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
幸楽苑ホールディングス	5,700	1,632.00	9,302,400	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
日本ライフライン	5,000	2,344.00	11,720,000	
サイゼリヤ	9,300	2,682.00	24,942,600	
エクセル	3,400	1,500.00	5,100,000	
V Tホールディングス	20,200	597.00	12,059,400	
マルカキカイ	3,500	1,548.00	5,418,000	
アルゴグラフィックス	3,700	2,236.00	8,273,200	
I D O M	16,500	685.00	11,302,500	貸付株式数 4,600株
ポプラ	11,400	502.00	5,722,800	
ユナイテッドアローズ	7,700	3,325.00	25,602,500	
進和	4,500	1,707.00	7,681,500	
ハイデイ日高	5,400	2,684.00	14,493,600	貸付株式数 1,500株
シークス	4,100	3,935.00	16,133,500	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
京都きもの友禅	10,700	931.00	9,961,700	
コロナイド	18,600	1,892.00	35,191,200	
壱番屋	5,100	3,780.00	19,278,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
スギホールディングス	12,400	5,560.00	68,944,000	

島津製作所	74,000	1,801.00	133,274,000	
J M S	24,000	303.00	7,272,000	
ブイ・テクノロジー	1,200	11,780.00	14,136,000	貸付株式数 400株 (400株)
スター精密	9,900	1,607.00	15,909,300	貸付株式数 2,700株
東京計器	32,000	228.00	7,296,000	
東京精密	10,900	3,295.00	35,915,500	
マニー	7,700	2,803.00	21,583,100	
ニコン	99,200	1,774.00	175,980,800	貸付株式数 30,000株
トプコン	29,000	1,792.00	51,968,000	
オリンパス	91,600	4,300.00	393,880,000	
理研計器	5,700	1,658.00	9,450,600	
S C R E E Nホールディングス	11,800	6,870.00	81,066,000	
キヤノン電子	5,000	1,810.00	9,050,000	
タムロン	5,200	2,028.00	10,545,600	
HOYA	118,100	4,844.00	572,076,400	
ノーリツ鋼機	6,900	816.00	5,630,400	
エー・アンド・デイ	12,700	476.00	6,045,200	
キヤノン	308,100	3,417.00	1,052,777,700	
リコー	171,600	1,014.00	174,002,400	
シチズン時計	63,300	743.00	47,031,900	貸付株式数 17,900株 (17,900株)
リズム時計	39,000	181.00	7,059,000	
大研医器	6,900	809.00	5,582,100	貸付株式数 1,900株 (500株)
メニコン	4,100	3,090.00	12,669,000	
パラマウントベッドHD	5,500	4,535.00	24,942,500	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ニホンフラッシュ	3,800	1,315.00	4,997,000	
前田工織	7,000	1,241.00	8,687,000	貸付株式数 1,600株
永大産業	13,000	504.00	6,552,000	
アートネイチャー	8,500	713.00	6,060,500	
ダンロップスポーツ	4,500	1,034.00	4,653,000	
バンダイナムコHLDGS	63,300	3,235.00	204,775,500	
共立印刷	27,200	315.00	8,568,000	
SHOEI	3,200	2,261.00	7,235,200	
フランスベッドHLDGS	7,800	916.00	7,144,800	
マーベラス	10,300	762.00	7,848,600	貸付株式数 3,000株 (2,800株)

パイロットコーポレーション	10,100	4,855.00	49,035,500	
萩原工業	2,500	2,392.00	5,980,000	
エイベックス・グループHD	10,500	1,700.00	17,850,000	
トッパン・フォームズ	9,100	1,164.00	10,592,400	
フジシールインターナショナル	6,500	4,755.00	30,907,500	
タカラトミー	22,700	1,210.00	27,467,000	
レック	2,500	3,560.00	8,900,000	
大建工業	4,500	2,080.00	9,360,000	
きもと	20,300	253.00	5,135,900	
凸版印刷	159,000	1,131.00	179,829,000	
大日本印刷	164,000	1,161.00	190,404,000	
共同印刷	21,000	400.00	8,400,000	
日本写真印刷	9,800	2,875.00	28,175,000	貸付株式数 2,800株 (2,700株)
光村印刷	25,000	213.00	5,325,000	
藤森工業	4,600	2,996.00	13,781,600	
宝印刷	4,800	1,497.00	7,185,600	
前澤化成工業	8,500	1,172.00	9,962,000	
アシックス	56,800	2,450.00	139,160,000	
ツツミ	2,700	1,974.00	5,329,800	
ジェイエスピー	2,800	2,787.00	7,803,600	
ニチハ	8,200	2,848.00	23,353,600	
エフピコ	5,400	5,350.00	28,890,000	
ヤマハ	38,600	3,615.00	139,539,000	
河合楽器	3,200	2,375.00	7,600,000	
クリナップ	8,100	959.00	7,767,900	
ビジョン	34,900	2,956.00	103,164,400	
天馬	4,100	2,019.00	8,277,900	
キングジム	7,800	850.00	6,630,000	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
リンテック	13,000	2,567.00	33,371,000	
信越ポリマー	13,100	867.00	11,357,700	
東リ	22,200	376.00	8,347,200	
イトーキ	12,800	842.00	10,777,600	
任天堂	35,400	24,540.00	868,716,000	
三菱鉛筆	4,800	6,440.00	30,912,000	
松風	4,100	1,346.00	5,518,600	
タカラスタンダ-ド	11,800	1,960.00	23,128,000	
コクヨ	29,800	1,354.00	40,349,200	

ナカバヤシ	21,000	265.00	5,565,000	
ニフコ	10,400	6,200.00	64,480,000	
グロープライド	3,500	2,030.00	7,105,000	
岡村製作所	19,300	1,035.00	19,975,500	
日本バルカー	5,800	1,536.00	8,908,800	
伊藤忠	415,500	1,594.00	662,307,000	
丸紅	556,100	674.50	375,089,450	
スクロール	12,100	359.00	4,343,900	
高島	37,000	193.00	7,141,000	
ヨンドシーホールディングス	4,500	2,479.00	11,155,500	
三陽商会	40,000	176.00	7,040,000	貸付株式数 1,000株
長瀬産業	31,600	1,529.00	48,316,400	
蝶理	4,300	1,760.00	7,568,000	
豊田通商	62,800	3,060.00	192,168,000	
オンワードホールディングス	38,000	824.00	31,312,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
兼松	119,000	200.00	23,800,000	
美津濃	30,000	584.00	17,520,000	
ユニー・ファミリーマートHD	24,900	7,620.00	189,738,000	貸付株式数 7,100株
三井物産	513,100	1,681.00	862,521,100	
日本紙パルプ	28,000	370.00	10,360,000	
東京エレクトロン	38,300	10,700.00	409,810,000	
日立ハイテクノロジーズ	19,600	4,485.00	87,906,000	
カメイ	7,500	1,205.00	9,037,500	
OUGホールディングス	28,000	259.00	7,252,000	
スターゼン	2,400	4,800.00	11,520,000	
セイコーHD	40,000	450.00	18,000,000	貸付株式数 11,000株
山善	21,800	986.00	21,494,800	
住友商事	356,100	1,397.00	497,471,700	
日本ユニシス	16,000	1,464.00	23,424,000	
内田洋行	18,000	484.00	8,712,000	
三菱商事	425,800	2,563.00	1,091,325,400	
第一実業	15,000	667.00	10,005,000	
キャノンマーケティングJP N	15,900	1,996.00	31,736,400	
西華産業	23,000	347.00	7,981,000	
菱洋エレクトロ	6,100	1,463.00	8,924,300	
ユアサ商事	5,400	2,998.00	16,189,200	
神鋼商事	3,100	2,503.00	7,759,300	

阪和興業	56,000	771.00	43,176,000	
カナデン	7,600	1,040.00	7,904,000	
菱電商事	11,000	737.00	8,107,000	
ニプロ	38,400	1,263.00	48,499,200	
岩谷産業	61,000	637.00	38,857,000	
すてきナイスグループ	45,000	154.00	6,930,000	
兼松エレクトロニクス	3,800	2,453.00	9,321,400	
三愛石油	16,000	880.00	14,080,000	
稲畑産業	13,400	1,273.00	17,058,200	
ゴ・ルドウイン	2,700	5,370.00	14,499,000	貸付株式数 700株 (700株)
ユニ・チャーム	122,200	2,559.00	312,709,800	貸付株式数 34,600株
デサント	14,100	1,367.00	19,274,700	
ワキタ	12,500	992.00	12,400,000	
東邦ホールディングス	18,000	2,392.00	43,056,000	
サンゲツ	19,200	2,055.00	39,456,000	
ミツウロコグループ	9,600	719.00	6,902,400	貸付株式数 700株
シナネンホールディングス	2,800	2,094.00	5,863,200	
伊藤忠エネクス	12,100	933.00	11,289,300	
サンリオ	17,100	2,267.00	38,765,700	
リョーサン	8,200	3,515.00	28,823,000	
新光商事	7,800	1,232.00	9,609,600	
トーヨー	3,500	2,548.00	8,918,000	
三信電気	7,500	1,144.00	8,580,000	
東陽テクニカ	8,300	1,039.00	8,623,700	
モスフード サービス	7,300	3,485.00	25,440,500	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
加賀電子	5,400	1,924.00	10,389,600	
三益半導体	5,100	1,620.00	8,262,000	
木曽路	7,100	2,348.00	16,670,800	貸付株式数 2,400株
サトレストランシステムズ	9,400	813.00	7,642,200	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
千趣会	11,400	746.00	8,504,400	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
ケーヨー	12,100	551.00	6,667,100	貸付株式数 3,600株 (2,100株)
上新電機	14,000	1,000.00	14,000,000	
日本瓦斯	10,500	3,465.00	36,382,500	
ロイヤルホールディングス	9,300	1,973.00	18,348,900	貸付株式数 2,800株 (2,800株)

いなげや	6,600	1,473.00	9,721,800	
島 忠	14,300	3,095.00	44,258,500	
チヨダ	6,800	2,777.00	18,883,600	
ライフコーポレーション	4,500	3,425.00	15,412,500	
リンガーハット	5,800	2,198.00	12,748,400	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
A O K Iホールディングス	10,900	1,474.00	16,066,600	
オークワ	8,000	1,172.00	9,376,000	
コメリ	8,600	2,746.00	23,615,600	
青山商事	11,700	4,075.00	47,677,500	
しまむら	6,600	14,070.00	92,862,000	
高 島 屋	94,000	1,060.00	99,640,000	貸付株式数 23,000株
松 屋	13,100	1,124.00	14,724,400	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
エイチ・ツー・オーリテイ リング	28,700	1,902.00	54,587,400	
近鉄百貨店	23,000	354.00	8,142,000	貸付株式数 7,000株
丸井グループ	59,900	1,831.00	109,676,900	
クレディセゾン	42,800	2,152.00	92,105,600	
アクシアル リテイリング	4,600	3,995.00	18,377,000	
イオン	232,900	1,716.50	399,772,850	貸付株式数 66,200株
イ ズ ミ	11,300	5,020.00	56,726,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
平 和 堂	11,400	2,555.00	29,127,000	
フ ジ	6,400	2,399.00	15,353,600	
ヤオコー	6,500	4,630.00	30,095,000	
ゼビオホールディングス	7,500	1,855.00	13,912,500	
ケースホールディングス	25,700	2,099.00	53,944,300	貸付株式数 7,300株 (7,300株)
P A L T A C	9,200	2,721.00	25,033,200	
新生銀行	536,000	205.00	109,880,000	
あおぞら銀行	356,000	427.00	152,012,000	
三菱UFJフィナンシャルG	4,294,800	759.60	3,262,330,080	
りそなホールディングス	663,000	634.00	420,342,000	
三井住友トラストHD	118,400	4,581.00	542,390,400	
三井住友フィナンシャルG	453,500	4,695.00	2,129,182,500	
第四銀行	68,000	543.00	36,924,000	
北越銀行	6,100	2,688.00	16,396,800	
千葉銀行	217,000	753.00	163,401,000	
群馬銀行	124,200	667.00	82,841,400	

武蔵野銀行	8,400	3,430.00	28,812,000	
千葉興業銀行	18,800	606.00	11,392,800	
筑波銀行	28,900	367.00	10,606,300	
七十七銀行	86,000	608.00	52,288,000	
青森銀行	45,000	397.00	17,865,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
秋田銀行	37,000	391.00	14,467,000	
山形銀行	32,000	501.00	16,032,000	
岩手銀行	3,500	4,875.00	17,062,500	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
東邦銀行	48,000	448.00	21,504,000	
東北銀行	64,000	155.00	9,920,000	
みちのく銀行	33,000	223.00	7,359,000	貸付株式数 9,000株
ふくおかフィナンシャルG	228,000	555.00	126,540,000	
静岡銀行	153,000	1,029.00	157,437,000	
十六銀行	74,000	433.00	32,042,000	
スルガ銀行	57,900	2,739.00	158,588,100	貸付株式数 15,100株 (15,100株)
八十二銀行	106,400	712.00	75,756,800	
山梨中央銀行	34,000	582.00	19,788,000	
大垣共立銀行	75,000	470.00	35,250,000	貸付株式数 21,000株 (21,000株)
福井銀行	50,000	305.00	15,250,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
北國銀行	57,000	416.00	23,712,000	
清水銀行	2,400	3,700.00	8,880,000	
滋賀銀行	49,000	663.00	32,487,000	貸付株式数 7,000株
南都銀行	5,400	4,540.00	24,516,000	
百五銀行	49,000	492.00	24,108,000	
京都銀行	100,000	927.00	92,700,000	
紀陽銀行	21,500	1,913.00	41,129,500	
三重銀行	3,800	2,453.00	9,321,400	
ほくほくフィナンシャルG	37,100	2,100.00	77,910,000	
広島銀行	166,000	581.00	96,446,000	
山陰合同銀行	33,700	995.00	33,531,500	
中国銀行	39,200	1,729.00	67,776,800	
鳥取銀行	4,200	1,903.00	7,992,600	
伊予銀行	59,200	859.00	50,852,800	
百十四銀行	60,000	408.00	24,480,000	
四国銀行	44,000	288.00	12,672,000	



阿波銀行	46,000	726.00	33,396,000	
大分銀行	33,000	444.00	14,652,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
宮崎銀行	39,000	368.00	14,352,000	
佐賀銀行	36,000	303.00	10,908,000	
十八銀行	36,000	357.00	12,852,000	
沖縄銀行	5,600	4,395.00	24,612,000	
琉球銀行	12,100	1,591.00	19,251,100	
セブン銀行	211,800	357.00	75,612,600	貸付株式数 60,300株
みずほフィナンシャルG	7,686,400	220.90	1,697,925,760	
高知銀行	68,000	137.00	9,316,000	
山口フィナンシャルG	51,000	1,310.00	66,810,000	貸付株式数 14,000株
芙蓉総合リース	6,400	5,690.00	36,416,000	
興銀リース	10,600	2,662.00	28,217,200	
東京センチュリー	11,200	4,000.00	44,800,000	
SBIホールディングス	64,000	1,532.00	98,048,000	
日本証券金融	25,200	655.00	16,506,000	
アイフル	96,300	358.00	34,475,400	貸付株式数 27,400株 (300株)
長野銀行	3,200	2,030.00	6,496,000	
名古屋銀行	4,500	4,320.00	19,440,000	貸付株式数 1,300株 (100株)
北洋銀行	88,900	505.00	44,894,500	
愛知銀行	2,000	7,030.00	14,060,000	
第三銀行	4,400	1,855.00	8,162,000	
中京銀行	2,700	2,374.00	6,409,800	
大光銀行	30,000	270.00	8,100,000	
愛媛銀行	5,200	1,400.00	7,280,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
トマト銀行	5,000	1,668.00	8,340,000	
みなと銀行	5,100	2,105.00	10,735,500	
京葉銀行	42,000	539.00	22,638,000	
関西アーバン銀行	7,500	1,519.00	11,392,500	
栃木銀行	31,800	596.00	18,952,800	
北日本銀行	2,500	3,145.00	7,862,500	
東和銀行	117,000	112.00	13,104,000	
福島銀行	91,000	98.00	8,918,000	貸付株式数 8,000株
大東銀行	43,000	170.00	7,310,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
リコーリース	4,500	3,695.00	16,627,500	貸付株式数 1,300株

イオンフィナンシャルサービス	36,300	2,109.00	76,556,700	
アコム	116,300	525.00	61,057,500	
ジャックス	33,000	545.00	17,985,000	
オリコ	125,500	218.00	27,359,000	
日立キャピタル	13,400	2,927.00	39,221,800	
オリックス	401,600	1,866.00	749,385,600	
三菱UFJリース	144,400	616.00	88,950,400	
ジャフコ	9,500	3,905.00	37,097,500	
トモニホールディングス	45,400	641.00	29,101,400	
大和証券G本社	527,000	759.10	400,045,700	
野村ホールディングス	1,159,800	735.80	853,380,840	
岡三証券グループ	45,000	748.00	33,660,000	
丸三証券	18,200	1,028.00	18,709,600	
東洋証券	30,000	283.00	8,490,000	
東海東京HD	62,000	653.00	40,486,000	
光世証券	29,000	199.00	5,771,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
水戸証券	26,800	353.00	9,460,400	
いちよし証券	13,400	946.00	12,676,400	
松井証券	29,600	1,015.00	30,044,000	
SOMPOホールディングス	118,200	4,017.00	474,809,400	
日本取引所グループ	176,700	1,755.00	310,108,500	
マネックスG	60,900	339.00	20,645,100	貸付株式数 19,000株 (19,000株)
カブドットコム証券	39,800	405.00	16,119,000	
極東証券	7,500	1,799.00	13,492,500	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
岩井コスモホールディング	7,500	1,147.00	8,602,500	
藍澤證券	12,700	682.00	8,661,400	
フィデアホール	58,800	220.00	12,936,000	
池田泉州HD	56,700	558.00	31,638,600	
アニコムホールディングス	4,100	2,313.00	9,483,300	貸付株式数 1,300株 (600株)
MS&AD	168,900	3,702.00	625,267,800	
SONY FH	54,100	1,880.00	101,708,000	
マネーパートナーズGP	8,600	577.00	4,962,200	
第一生命HLDGS	341,400	2,052.00	700,552,800	
東京海上HD	229,400	5,021.00	1,151,817,400	

イー・ギャランティ	2,400	2,399.00	5,757,600	貸付株式数 700株 (700株)
NECキャピタルソリューション	2,900	1,858.00	5,388,200	
T&Dホールディングス	205,800	1,590.00	327,222,000	
アドバンスクリエイト	3,000	1,800.00	5,400,000	
三井不動産	301,000	2,747.00	826,847,000	
三菱地所	422,000	2,336.00	985,792,000	貸付株式数 120,000株 (120,000株)
平和不動産	10,900	1,618.00	17,636,200	
東京建物	64,800	1,554.00	100,699,200	
ダイビル	14,700	1,035.00	15,214,500	
京阪神ビルディング	11,500	613.00	7,049,500	
住友不動産	136,000	3,150.00	428,400,000	
大京	104,000	245.00	25,480,000	
テーオーシー	22,100	920.00	20,332,000	
東京楽天地	13,000	514.00	6,682,000	
レオパレス21	70,100	616.00	43,181,600	
スターツコーポレーション	5,900	1,975.00	11,652,500	
フジ住宅	9,200	748.00	6,881,600	
空港施設	9,700	577.00	5,596,900	
住友不動産販売	4,900	2,881.00	14,116,900	
ゴールドクレスト	5,200	2,139.00	11,122,800	
リログループ	2,300	15,390.00	35,397,000	
日神不動産	11,900	551.00	6,556,900	
タカラレーベン	25,400	682.00	17,322,800	貸付株式数 7,100株
サンヨーハウジ 名古屋	6,600	1,065.00	7,029,000	
イオンモール	36,100	1,726.00	62,308,600	
ファースト住建	3,500	1,498.00	5,243,000	
東祥	1,500	4,965.00	7,447,500	貸付株式数 400株
トーセイ	9,300	847.00	7,877,100	
エヌ・ティ・ティ都市開発	34,500	1,093.00	37,708,500	
サンフロンティア不動産	6,500	1,011.00	6,571,500	
エフ・ジェー・ネクスト	8,100	735.00	5,953,500	
グランディハウス	13,200	399.00	5,266,800	
東武鉄道	304,000	576.00	175,104,000	
相鉄ホールディングス	92,000	579.00	53,268,000	
東京急行	312,000	882.00	275,184,000	
京浜急行	157,000	1,324.00	207,868,000	
小田急電鉄	92,100	2,328.00	214,408,800	

京王電鉄	160,000	961.00	153,760,000	
京成電鉄	43,000	2,852.00	122,636,000	
富士急行	17,000	1,072.00	18,224,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
新京成電鉄	13,000	412.00	5,356,000	
東日本旅客鉄道	111,100	10,235.00	1,137,108,500	
西日本旅客鉄道	55,200	7,194.00	397,108,800	
東海旅客鉄道	47,700	19,460.00	928,242,000	
西武ホールディングス	79,300	2,173.00	172,318,900	
鴻池運輸	8,300	1,583.00	13,138,900	
西日本鉄道	68,000	542.00	36,856,000	
ハマキョウレックス	4,300	2,096.00	9,012,800	
サカイ引越センター	2,400	2,598.00	6,235,200	貸付株式数 700株 (100株)
近鉄グループHLDGS	577,000	453.00	261,381,000	
阪急阪神HLDGS	72,400	3,770.00	272,948,000	
南海電鉄	122,000	599.00	73,078,000	
京阪ホールディングス	129,000	779.00	100,491,000	
神戸電鉄	18,000	371.00	6,678,000	
名古屋鉄道	209,000	572.00	119,548,000	貸付株式数 57,000株 (57,000株)
山陽電鉄	23,000	596.00	13,708,000	
トランコム	1,800	5,840.00	10,512,000	
日本通運	221,000	616.00	136,136,000	貸付株式数 61,000株 (61,000株)
ヤマトホールディングス	102,600	2,371.50	243,315,900	
山 九	75,000	718.00	53,850,000	
日 新	26,000	376.00	9,776,000	
丸全昭和運輸	22,000	470.00	10,340,000	
センコー	25,700	813.00	20,894,100	
トナミホールディングス	16,000	344.00	5,504,000	
ニッコンホールディングス	19,000	2,442.00	46,398,000	
福山通運	33,000	686.00	22,638,000	貸付株式数 9,000株 (5,000株)
セイノーホールディングス	39,800	1,328.00	52,854,400	貸付株式数 11,300株
神奈川中央交通	8,000	745.00	5,960,000	
日立物流	12,000	2,401.00	28,812,000	
丸和運輸機関	1,800	2,908.00	5,234,400	
日本郵船	483,000	229.00	110,607,000	

商船三井	298,000	335.00	99,830,000	貸付株式数 79,000株 (79,000株)
川崎汽船	216,000	276.00	59,616,000	貸付株式数 71,000株 (71,000株)
N S ユナイテッド海運	31,000	204.00	6,324,000	
飯野海運	30,700	473.00	14,521,100	
九州旅客鉄道	42,000	3,095.00	129,990,000	
日本航空	102,900	3,511.00	361,281,900	
A N A ホールディングス	1,060,000	322.80	342,168,000	
三菱倉庫	37,000	1,660.00	61,420,000	
三井倉庫H O L D	36,000	359.00	12,924,000	
住友倉庫	40,000	618.00	24,720,000	
渋沢倉庫	28,000	345.00	9,660,000	
ヤマタネ	6,100	1,637.00	9,985,700	
東陽倉庫	28,100	295.00	8,289,500	
日本トランスシティ	19,000	426.00	8,094,000	
東洋埠頭	43,000	187.00	8,041,000	
上 組	68,000	1,110.00	75,480,000	
キューソー流通システム	2,300	2,425.00	5,577,500	貸付株式数 500株 (500株)
郵船ロジスティクス	5,900	1,247.00	7,357,300	
近鉄エクスプレス	10,500	1,771.00	18,595,500	
東海運	8,700	431.00	3,749,700	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
内外トランスライン	4,900	1,179.00	5,777,100	
東京放送H D	37,500	1,870.00	70,125,000	
日本テレビH L D S	51,700	2,093.00	108,208,100	
テレビ朝日H D	15,500	2,238.00	34,689,000	
スカパーJ S A T H D	36,700	561.00	20,588,700	
テレビ東京H D	5,000	2,321.00	11,605,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ワイヤレスゲート	2,700	1,662.00	4,487,400	貸付株式数 700株
コネクシオ	5,200	1,480.00	7,696,000	
日本通信	52,400	171.00	8,960,400	貸付株式数 14,600株
日本電信電話	454,700	4,891.00	2,223,937,700	
K D D I	560,600	3,059.00	1,714,875,400	
光通信	6,900	10,900.00	75,210,000	
N T T ドコモ	423,400	2,711.50	1,148,049,100	
エムティーアイ	10,000	732.00	7,320,000	貸付株式数 2,600株
G M O インターネット	21,100	1,481.00	31,249,100	

カドカワ	16,700	1,649.00	27,538,300	
学研ホールディングス	24,000	316.00	7,584,000	
ゼンリン	7,900	1,924.00	15,199,600	
東京電力HD	487,900	536.00	261,514,400	
中部電力	188,700	1,750.00	330,225,000	
関西電力	235,000	1,349.50	317,132,500	
中国電力	78,600	1,470.00	115,542,000	
北陸電力	55,100	1,405.00	77,415,500	
東北電力	143,200	1,556.00	222,819,200	
四国電力	51,700	1,252.00	64,728,400	貸付株式数 14,700株 (14,700株)
九州電力	127,300	1,337.00	170,200,100	
北海道電力	53,900	988.00	53,253,200	
沖縄電力	8,500	2,679.00	22,771,500	
電源開発	45,500	2,886.00	131,313,000	
イーレックス	2,500	2,844.00	7,110,000	貸付株式数 700株
東京瓦斯	615,000	542.70	333,760,500	
大阪瓦斯	554,000	461.10	255,449,400	
東邦瓦斯	144,000	963.00	138,672,000	
北海道瓦斯	21,000	276.00	5,796,000	貸付株式数 5,000株
広島ガス	15,500	378.00	5,859,000	
西部瓦斯	65,000	255.00	16,575,000	
静岡ガス	17,400	851.00	14,807,400	
メタウォーター	3,400	2,873.00	9,768,200	貸付株式数 1,000株 (600株)
松竹	37,000	1,251.00	46,287,000	
東宝	37,000	3,245.00	120,065,000	
エイチ・アイ・エス	9,900	3,135.00	31,036,500	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
東映	21,000	991.00	20,811,000	
NTTデータ	35,100	5,830.00	204,633,000	
共立メンテナンス	4,900	6,930.00	33,957,000	貸付株式数 1,300株
イチネンホールディングス	8,700	1,156.00	10,057,200	
建設技術研究所	6,200	1,081.00	6,702,200	
アインホールディングス	6,900	7,940.00	54,786,000	
東京テアトル	60,000	159.00	9,540,000	貸付株式数 23,000株
タナベ経営	3,700	1,281.00	4,739,700	
ナガワ	1,200	4,235.00	5,082,000	
よみうりランド	15,000	495.00	7,425,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)

東京都競馬	43,000	286.00	12,298,000	
常磐興産	5,200	1,552.00	8,070,400	
カナモト	8,400	3,105.00	26,082,000	
東京ドーム	24,200	1,167.00	28,241,400	
D T S	6,100	2,545.00	15,524,500	貸付株式数 2,000株
スクウェア・エニックス・H D	21,900	2,980.00	65,262,000	貸付株式数 6,100株
シーイーシー	3,900	1,667.00	6,501,300	
カプコン	13,300	2,485.00	33,050,500	
西尾レントオール	4,900	3,420.00	16,758,000	
日本空港ビルデング	18,100	4,525.00	81,902,500	貸付株式数 5,100株 (5,100株)
トランス・コスモス	7,100	2,724.00	19,340,400	
乃村工藝社	13,000	1,668.00	21,684,000	
ジャステック	5,900	1,061.00	6,259,900	
S C S K	15,600	4,000.00	62,400,000	
藤田観光	22,000	359.00	7,898,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
K N T - C Tホールディング ス	42,000	143.00	6,006,000	
日本管財	5,500	1,790.00	9,845,000	
トーカイ	2,900	4,010.00	11,629,000	
セコム	62,200	8,503.00	528,886,600	
セントラル警備保障	3,300	1,978.00	6,527,400	貸付株式数 900株
アイネス	8,600	1,257.00	10,810,200	
丹青社	11,600	832.00	9,651,200	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
メイテック	7,100	4,285.00	30,423,500	
T K C	5,400	3,115.00	16,821,000	
アサツー ディ・ケイ	9,600	2,956.00	28,377,600	
富士ソフト	8,500	2,775.00	23,587,500	
応用地質	6,300	1,351.00	8,511,300	
船井総研ホールディン	8,300	1,789.00	14,848,700	貸付株式数 2,300株
N S D	12,500	1,815.00	22,687,500	
丸紅建材リース	28,000	224.00	6,272,000	
コナミホールディングス	25,600	4,130.00	105,728,000	
学 究 社	4,700	1,403.00	6,594,100	
ベネッセホールディングス	20,200	3,290.00	66,458,000	貸付株式数 5,600株
イオンディライト	6,600	3,235.00	21,351,000	

福井コンピュータH L D S	2,000	2,407.00	4,814,000	貸付株式数 500株 (500株)
ニチイ学館	11,200	886.00	9,923,200	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
ダイセキ	10,400	2,286.00	23,774,400	
日鉄住金物産	4,700	4,625.00	21,737,500	
元気寿司	2,600	2,107.00	5,478,200	
トラスコ中山	6,600	4,935.00	32,571,000	
ヤマダ電機	188,700	625.00	117,937,500	
オートバックスセブン	20,400	1,778.00	36,271,200	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	10,000	1,485.00	14,850,000	
ニトリホールディングス	24,600	12,930.00	318,078,000	
吉野家ホールディングス	19,100	1,575.00	30,082,500	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
加藤産業	8,700	2,679.00	23,307,300	
イノテック	10,700	583.00	6,238,100	
イエローハット	5,500	2,388.00	13,134,000	
松屋フーズ	2,800	3,875.00	10,850,000	
J B C Cホールディングス	15,000	755.00	11,325,000	
サガミチェーン	8,500	1,285.00	10,922,500	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
日 伝	2,500	3,195.00	7,987,500	貸付株式数 200株
関西スーパーマーケット	5,700	1,506.00	8,584,200	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ミロク情報サービス	4,700	1,737.00	8,163,900	
因幡電機産業	7,500	4,045.00	30,337,500	
王将フードサービス	4,100	4,235.00	17,363,500	
プレナス	6,100	2,276.00	13,883,600	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,100	2,040.00	8,364,000	貸付株式数 1,100株
アークス	10,400	2,679.00	27,861,600	
パローホールディングス	12,200	3,045.00	37,149,000	
ミスミグループ本社	63,600	1,941.00	123,447,600	貸付株式数 17,900株
ベ ル ク	2,700	4,595.00	12,406,500	
大 庄	4,400	1,581.00	6,956,400	
ファーストリテイリング	9,500	43,130.00	409,735,000	貸付株式数 2,600株
ソフトバンクグループ	255,100	7,822.00	1,995,392,200	
スズケン	25,600	3,775.00	96,640,000	
サンドラッグ	10,900	8,130.00	88,617,000	



サクスパーホールディング	6,300	1,200.00	7,560,000	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
ジェコス	5,000	1,038.00	5,190,000	
ペルーナ	15,000	683.00	10,245,000	
合計			129,800,710,660	

(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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	394,510,426	340,203,687
コール・ローン	116,360,930	153,142,293
株式	74,579,327,005	81,261,530,570
投資証券	1,920,827,331	2,095,626,412
派生商品評価勘定	11,514,060	822,838
未収入金	829,797	132,605,697
未収配当金	100,900,855	105,370,223
差入委託証拠金	446,723,235	582,058,178
流動資産合計	77,570,993,639	84,671,359,898

資産合計		77,570,993,639	84,671,359,898
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	78,064
未払解約金		42,366,000	227,130,000
流動負債合計		42,366,000	227,208,064
負債合計		42,366,000	227,208,064
純資産の部			
元本等			
元本	1	38,798,220,086	40,367,016,462
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		38,730,407,553	44,077,135,372
元本等合計		77,528,627,639	84,444,151,834
純資産合計		77,528,627,639	84,444,151,834
負債純資産合計		77,570,993,639	84,671,359,898

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19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>
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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1. 1 期首	平成26年12月19日	平成27年12月19日
期首元本額	40,934,323,072円	38,798,220,086円
期中追加設定元本額	3,988,667,428円	5,148,416,668円
期中一部解約元本額	6,124,770,414円	3,579,620,292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	854,988,201円	713,025,920円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	44,919,625円	32,240,774円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	586,365,436円	453,992,902円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	55,778,109円	43,993,709円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,901,956,624円	1,490,582,674円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジ ングプラス(為替ヘッジな し)	- 円	118,469,160円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘッ ジなし)	- 円	218,819,187円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,474,975円	1,689,699円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	- 円	182,021円
i F r e e 外国株式イン デックス	- 円	207,132,402円
i F r e e 8資産バランス	- 円	53,397,250円
DCダイワ外国株式インデッ クス	20,512,600,044円	22,403,108,724円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	452,732,808円	544,438,422円

ダイワ・ライフ・バランス50	623,597,529円	725,810,195円
ダイワ・ライフ・バランス70	491,420,954円	538,721,875円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,406,631,036円	1,464,751,026円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	7,648,234円	7,245,662円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	13,014,049円	14,997,798円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	2,985,761円	3,621,406円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	207,864円	100,000円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	1,203,627円	197,107円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	18,503,727円	19,292,523円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	163,351,857円	150,605,980円
ダイワ世界バランスファンド40VA	2,140,275,783円	1,943,779,185円
ダイワ世界バランスファンド60VA	533,285,293円	521,063,437円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,345,204,620円	4,894,517,852円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	244,716,827円	227,433,106円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	269,990,197円	391,241,366円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	- 円	23,106,461円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,980,922,871円	3,000,082,219円
ダイワライフスタイル25	21,630,820円	23,116,958円
ダイワライフスタイル50	68,685,540円	77,484,135円
ダイワライフスタイル75	54,127,675円	58,775,327円
計	38,798,220,086円	40,367,016,462円
2. 期末日における受益権の総数	38,798,220,086口	40,367,016,462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27年12月19日 至 平成28年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成28年12月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成27年12月18日現在	平成28年12月19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	2,283,954,721	2,314,032,757
投資証券	6,553,724	26,449,973
合計	2,290,508,445	2,340,482,730

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年12月1日から平成27年12月18日まで、及び平成28年12月1日から平成28年12月19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27年12月18日 現在				平成28年12月19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	980,507,952	-	992,022,012	11,514,060	1,060,857,918	-	1,061,163,756	305,838
合計	980,507,952	-	992,022,012	11,514,060	1,060,857,918	-	1,061,163,756	305,838

（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27年12月18日 現在				平成28年12月19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
合計	-	-	-	-	135,974,736	-	135,535,800	438,936

## (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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9983円 (19,983円)	2.0919円 (20,919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	65.480	176,796.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,100	129.320	271,572.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,450	105.390	152,815.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	19,600	36.630	717,948.000	
	ABBOTT LABORATORIES	34,100	38.100	1,299,210.000	
	ARCONIC INC	10,333	20.260	209,346.580	
	VERISK ANALYTICS INC	3,750	81.780	306,675.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	10,100	57.010	575,801.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	7,200	67.400	485,280.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,179	76.640	550,198.560	
	QORVO INC	3,200	54.690	175,008.000	
	AFLAC INC	9,300	69.410	645,513.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	2,750	75.530	207,707.500	
	ADOBE SYSTEMS INC	11,450	103.550	1,185,647.500	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,000	29.480	147,400.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,500	66.420	166,050.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,800	19.110	129,948.000	
	GARMIN LTD	2,600	48.990	127,374.000	
	AETNA INC	8,079	126.810	1,024,497.990	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,750	147.430	700,292.500	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16,600	116.380	1,931,908.000		
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,751	50.090	187,887.590		
WR BERKLEY CORP	2,100	65.710	137,991.000		
AUTOZONE INC	670	794.720	532,462.400		

DOLLAR TREE INC	5,571	84.200	469,078.200	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,900	36.510	763,059.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,650	76.670	203,175.500	
CELANESE CORP-SERIES A	3,300	81.650	269,445.000	
DR HORTON INC	7,966	28.040	223,366.640	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,100	52.280	109,788.000	
DENTSPLY SIRONA INC	5,500	60.080	330,440.000	
AUTODESK INC	4,550	76.480	347,984.000	
MOODY'S CORP	4,050	96.470	390,703.500	
DEVON ENERGY CORP	10,900	47.380	516,442.000	
ALBEMARLE CORP	2,600	89.230	231,998.000	
ATMOS ENERGY CORP	2,300	74.160	170,568.000	
ALLIANT ENERGY CORP	5,000	37.610	188,050.000	
CITIGROUP INC	66,123	59.750	3,950,849.250	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,600	100.850	1,069,010.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	11,500	62.810	722,315.000	
ALLEGHANY CORP	350	602.520	210,882.000	
DUN & BRADSTREET CORP	900	120.030	108,027.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	160.040	176,044.000	
HESS CORP	6,500	62.500	406,250.000	
DAVITA INC	3,800	64.940	246,772.000	
DANAHER CORP	14,250	79.220	1,128,885.000	
FORTIVE CORP	7,200	54.830	394,776.000	
AVNET INC	2,800	48.010	134,428.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	13,500	57.920	781,920.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,000	30.390	121,560.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,028	25.480	102,633.440	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13,400	46.510	623,234.000	
BUNGE LTD	3,100	72.830	225,773.000	
TE CONNECTIVITY LTD	8,225	69.740	573,611.500	
APPLE INC	123,200	115.970	14,287,504.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,400	71.690	673,886.000	
BOEING CO/THE	13,500	154.500	2,085,750.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,465	75.650	262,127.250	
SPECTRA ENERGY CORP	15,996	41.790	668,472.840	
BECTON DICKINSON AND CO	4,887	167.750	819,794.250	
CDK GLOBAL INC	2,900	59.580	172,782.000	

NISOURCE INC	7,300	22.030	160,819.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,350	73.110	244,918.500	
CR BARD INC	1,680	221.030	371,330.400	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	24,271	47.560	1,154,328.760	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	93,604	52.270	4,892,681.080	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	27,550	164.760	4,539,138.000	
ANSYS INC	2,100	95.110	199,731.000	
H&R BLOCK INC	5,100	23.450	119,595.000	
BB&T CORP	19,000	46.590	885,210.000	
BAKER HUGHES INC	9,573	66.390	635,551.470	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	38,050	58.620	2,230,491.000	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,300	74.990	97,487.000	
JPMORGAN CHASE & CO	82,670	84.940	7,021,989.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	5,600	76.760	429,856.000	
CIGNA CORP	5,900	136.760	806,884.000	
LKQ CORP	6,800	32.430	220,524.000	
COMPUTER SCIENCES CORP	3,300	60.230	198,759.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,000	129.480	129,480.000	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	25,842	3.560	91,997.520	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,000	45.360	226,800.000	
CADENCE DESIGN SYS INC	6,900	25.540	176,226.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,660	111.730	408,931.800	
DOLLAR GENERAL CORP	6,500	77.100	501,150.000	
SERVICENOW INC	3,800	77.860	295,868.000	
CATERPILLAR INC	13,400	92.580	1,240,572.000	
CMS ENERGY CORP	6,400	41.500	265,600.000	
MOSAIC CO/THE	7,550	29.560	223,178.000	
DELTA AIR LINES INC	4,400	50.160	220,704.000	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	4,350	71.860	312,591.000	
CORNING INC	23,500	24.300	571,050.000	
CISCO SYSTEMS INC	114,400	30.590	3,499,496.000	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	20,000	74.860	1,497,200.000	
MORGAN STANLEY	32,500	42.710	1,388,075.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,250	108.240	135,300.000	
DOW CHEMICAL CO/THE	25,800	58.410	1,506,978.000	
MSCI INC	2,200	79.900	175,780.000	
MIDDLEBY CORP	1,300	132.580	172,354.000	

COTY INC-CL A	11,139	18.690	208,187.910	
BROADCOM LTD	9,062	178.420	1,616,842.040	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,050	144.540	151,767.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,000	56.960	113,920.000	
ACUITY BRANDS INC	1,000	248.160	248,160.000	
ARAMARK	5,350	36.290	194,151.500	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,900	27.100	132,790.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,200	98.200	412,440.000	
CENTENE CORP	4,000	56.520	226,080.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,200	35.320	430,904.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,050	51.550	208,777.500	
GARTNER INC	1,900	103.500	196,650.000	
SPLUNK INC	2,900	55.410	160,689.000	
WHITEWAVE FOODS CO	4,100	55.370	227,017.000	
AGCO CORP	1,700	58.230	98,991.000	
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,300	75.870	1,084,941.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,300	44.500	413,850.000	
SMITH (A.O.) CORP	3,400	48.510	164,934.000	
DEERE & CO	6,200	101.760	630,912.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,600	70.290	253,044.000	
TIME WARNER INC	17,633	94.800	1,671,608.400	
VMWARE INC-CLASS A	1,900	80.790	153,501.000	
TEGNA INC	4,500	22.130	99,585.000	
NASDAQ INC	2,700	68.060	183,762.000	
TARGA RESOURCES CORP	4,000	54.920	219,680.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,500	125.920	188,880.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	7,000	72.680	508,760.000	
MEDNAX INC	2,000	65.250	130,500.000	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,600	77.550	201,630.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,100	97.000	203,700.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	19,450	66.230	1,288,173.500	
AMETEK INC	5,225	49.180	256,965.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,800	44.960	260,768.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,000	88.680	709,440.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	9,950	160.410	1,596,079.500	
SCANA CORP	3,100	74.030	229,493.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,200	148.490	178,188.000	
WR GRACE & CO	1,600	66.990	107,184.000	

VALSPAR CORP/THE	1,700	104.520	177,684.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	700	392.070	274,449.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,600	23.460	178,296.000	
UGI CORP	3,900	45.170	176,163.000	
CUMMINS INC	3,700	135.350	500,795.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,600	36.470	495,992.000	
SABRE CORP	4,600	25.420	116,932.000	
CDW CORP/DE	3,550	52.850	187,617.500	
SIGNATURE BANK	1,300	145.700	189,410.000	
AMERCO	170	369.990	62,898.300	
HANESBRANDS INC	8,500	21.550	183,175.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,200	27.530	335,866.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,800	101.950	183,510.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,700	101.140	171,938.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,200	251.480	301,776.000	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	2,950	101.780	300,251.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	8,500	43.140	366,690.000	
KINDER MORGAN INC	43,981	21.340	938,554.540	
HCA HOLDINGS INC	7,100	74.160	526,536.000	
CABOT OIL & GAS CORP	10,550	21.790	229,884.500	
T-MOBILE US INC	6,750	57.010	384,817.500	
ZILLOW GROUP INC - C	2,500	37.630	94,075.000	
COCA-COLA CO/THE	93,750	41.740	3,913,125.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,000	53.950	215,800.000	
EATON VANCE CORP	2,500	41.120	102,800.000	
FMC TECHNOLOGIES INC	4,900	34.900	171,010.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,700	39.280	341,736.000	
CSX CORP	21,400	36.040	771,256.000	
FLUOR CORP	3,300	54.970	181,401.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,350	127.760	300,236.000	
EXPEDIA INC	2,875	116.660	335,397.500	
AUTOLIV INC	2,000	108.750	217,500.000	
AMAZON.COM INC	9,210	757.770	6,979,061.700	
FLOWSERVE CORP	2,900	48.200	139,780.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,900	91.390	447,811.000	
EXXON MOBIL CORP	94,605	91.180	8,626,083.900	

FLIR SYSTEMS INC	3,100	36.220	112,282.000	
AES CORP	15,600	11.750	183,300.000	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,800	157.350	283,230.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,000	214.300	214,300.000	
EOG RESOURCES INC	12,650	104.000	1,315,600.000	
EQT CORP	4,050	65.070	263,533.500	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,200	67.190	282,198.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,400	77.380	340,472.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,790	45.910	357,638.900	
FORD MOTOR CO	85,123	12.630	1,075,103.490	
MACY'S INC	7,398	37.470	277,203.060	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,440	28.390	97,661.600	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6,287	30.480	191,627.760	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,820	27.520	160,166.400	
MOBILEYE NV	3,900	35.550	138,645.000	
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	300	105.490	31,647.000	
AERCAP HOLDINGS NV	3,800	42.440	161,272.000	
FORTINET INC	3,100	29.770	92,287.000	
MARKEL CORP	320	885.640	283,404.800	
NEXTERA ENERGY INC	10,550	118.900	1,254,395.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	27,108	13.830	374,903.640	
US BANCORP	39,500	51.740	2,043,730.000	
UNITED RENTALS INC	1,900	105.710	200,849.000	
F5 NETWORKS INC	1,600	144.640	231,424.000	
FASTENAL CO	6,500	48.050	312,325.000	
FISERV INC	5,200	107.030	556,556.000	
GENERAL ELECTRIC CO	205,600	31.750	6,527,800.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	3,650	44.130	161,074.500	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	6,150	32.340	198,891.000	
GENERAL MOTORS CO	31,900	36.370	1,160,203.000	
TRIPADVISOR INC	2,750	47.370	130,267.500	
GENERAL DYNAMICS CORP	5,900	174.410	1,029,019.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,300	238.900	1,982,870.000	
ALPHABET INC-CL A	6,760	809.840	5,474,518.400	
ALPHABET INC-CL C	7,097	790.800	5,612,307.600	
GENERAL MILLS INC	13,600	63.500	863,600.000	
FIRSTENERGY CORP	9,968	31.780	316,783.040	
GENUINE PARTS CO	3,500	97.980	342,930.000	

IHS MARKIT LTD	8,234	34.760	286,213.840	
FIFTH THIRD BANCORP	17,500	26.800	469,000.000	
HARRIS CORP	2,950	104.000	306,800.000	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	47.630	142,890.000	
HALLIBURTON CO	19,750	53.990	1,066,302.500	
HOME DEPOT INC	28,150	135.110	3,803,346.500	
ASSURANT INC	1,400	91.340	127,876.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,600	13.020	320,292.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,100	182.400	200,640.000	
HERSHEY CO/THE	3,300	101.160	333,828.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,000	59.170	236,680.000	
HUMANA INC	3,500	205.640	719,740.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	6,800	97.190	660,892.000	
HELMERICH & PAYNE	2,600	78.700	204,620.000	
HENRY SCHEIN INC	1,900	153.760	292,144.000	
HP INC	38,900	15.050	585,445.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	37,700	23.490	885,573.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,500	34.290	154,305.000	
HOLLYFRONTIER CORP	3,900	31.780	123,942.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,100	34.670	72,807.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,800	86.830	243,124.000	
HARMAN INTERNATIONAL	1,600	110.930	177,488.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	13,953	86.460	1,206,376.380	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,700	166.730	3,451,311.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	9,100	53.750	489,125.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,600	55.260	198,936.000	
ZOETIS INC	10,700	52.460	561,322.000	
INGERSOLL-RAND PLC	6,029	77.140	465,077.060	
CHENIERE ENERGY INC	4,700	42.800	201,160.000	
LEGGETT & PLATT INC	3,100	49.760	154,256.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	14,523	29.600	429,880.800	
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	2,437	21.240	51,761.880	
WASTE CONNECTIONS INC	4,105	77.520	318,219.600	
JUNIPER NETWORKS INC	8,200	28.330	232,306.000	

JM SMUCKER CO/THE	2,720	129.140	351,260.800	
JOHNSON & JOHNSON	62,400	115.880	7,230,912.000	
ABBVIE INC	37,379	62.220	2,325,721.380	
HOLOGIC INC	5,750	40.090	230,517.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	8,350	116.240	970,604.000	
KROGER CO	20,500	35.940	736,770.000	
KLA-TENCOR CORP	3,700	78.190	289,303.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	6,000	250.080	1,500,480.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,100	148.040	310,884.000	
L BRANDS INC	5,600	69.380	388,528.000	
LOWE'S COS INC	20,100	72.960	1,466,496.000	
ELI LILLY & CO	22,750	73.310	1,667,802.500	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	6,900	56.710	391,299.000	
LAM RESEARCH CORP	3,700	104.450	386,465.000	
RANGE RESOURCES CORP	4,300	34.290	147,447.000	
JONES LANG LASALLE INC	1,000	100.450	100,450.000	
LOEWS CORP	6,500	47.490	308,685.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,449	66.390	361,759.110	
MCDONALD'S CORP	19,400	123.240	2,390,856.000	
3M CO	13,900	177.450	2,466,555.000	
FACEBOOK INC-A	53,150	119.870	6,371,090.500	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	5,254	56.440	296,535.760	
MANPOWERGROUP INC	1,700	90.430	153,731.000	
S&P GLOBAL INC	6,150	113.100	695,565.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,400	220.390	308,546.000	
CONCHO RESOURCES INC	3,250	138.250	449,312.500	
ENVISION HEALTHCARE CORP	1,436	65.850	94,560.600	
FIRST DATA CORP- CLASS A	7,200	14.410	103,752.000	
PHILLIPS 66	10,650	87.460	931,449.000	
MURPHY OIL CORP	3,600	33.200	119,520.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	10,800	28.860	311,688.000	
MATTEL INC	7,800	28.810	224,718.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,650	92.440	244,966.000	
MYLAN NV	10,450	37.820	395,219.000	
METLIFE INC	21,350	54.370	1,160,799.500	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	10,500	14.320	150,360.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,378	83.400	281,725.200	
MONSANTO CO	10,056	105.500	1,060,908.000	



METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	421.960	253,176.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,950	134.910	397,984.500	
MERCK & CO. INC.	63,171	62.440	3,944,397.240	
MASCO CORP	7,400	31.930	236,282.000	
M & T BANK CORP	3,169	152.490	483,240.810	
MARSH & MCLENNAN COS	11,750	68.460	804,405.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,522	86.050	647,268.100	
WORKDAY INC-CLASS A	2,650	69.000	182,850.000	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,950	45.210	178,579.500	
VANTIV INC - CL A	3,550	58.790	208,704.500	
NETAPP INC	6,700	36.450	244,215.000	
NIKE INC -CL B	30,550	50.920	1,555,606.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,750	106.670	720,022.500	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,850	64.530	312,970.500	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,000	71.630	214,890.000	
ALLY FINANCIAL INC	10,200	19.910	203,082.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,950	231.700	915,215.000	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,200	68.100	422,220.000	
NEWMONT MINING CORP	12,000	31.660	379,920.000	
MCKESSON CORP	5,150	142.290	732,793.500	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,400	38.830	248,512.000	
XYLEM INC	4,200	50.100	210,420.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	35,350	91.310	3,227,808.500	
NUCOR CORP	7,150	60.650	433,647.500	
WESTERN UNION CO	11,346	21.250	241,102.500	
NEWELL BRANDS INC	10,142	46.180	468,357.560	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,550	73.440	1,288,872.000	
LIBERTY BROADBAND-C	2,600	74.220	192,972.000	
PAYCHEX INC	7,550	61.240	462,362.000	
PATTERSON COS INC	1,900	40.950	77,805.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,200	279.300	614,460.000	
ALTRIA GROUP INC	44,350	67.040	2,973,224.000	
P G & E CORP	11,500	61.040	701,960.000	
PFIZER INC	138,163	32.840	4,537,272.920	
ALKERMES PLC	3,600	56.510	203,436.000	
XCEL ENERGY INC	11,500	40.690	467,935.000	
STRYKER CORP	7,850	118.750	932,187.500	

PARKER HANNIFIN CORP	3,050	142.750	435,387.500	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,750	184.990	693,712.500	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,400	81.600	114,240.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	58,167	84.680	4,925,581.560	
EXELON CORP	21,322	35.720	761,621.840	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,100	120.040	612,204.000	
CONOCOPHILLIPS	28,650	51.940	1,488,081.000	
PEPSICO INC	32,700	105.870	3,461,949.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,900	105.770	1,047,123.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,050	72.880	295,164.000	
ACCENTURE PLC-CL A	14,200	123.000	1,746,600.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,200	63.900	140,580.000	
PENTAIR PLC	4,005	56.550	226,482.750	
QUALCOMM INC	33,650	66.460	2,236,379.000	
INVESCO LTD	9,850	31.400	309,290.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,700	171.910	292,247.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,600	57.800	381,480.000	
RAYTHEON COMPANY	6,700	141.820	950,194.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,800	70.300	126,540.000	
RED HAT INC	4,200	79.950	335,790.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,810	378.850	685,718.500	
REPUBLIC SERVICES INC	5,650	56.590	319,733.500	
PRICELINE GROUP INC/THE	1,140	1,484.280	1,692,079.200	
ROSS STORES INC	9,400	69.530	653,582.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,100	86.460	181,566.000	
RESMED INC	3,250	62.530	203,222.500	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,300	92.310	304,623.000	
ROBERT HALF INTL INC	2,800	48.510	135,828.000	
REYNOLDS AMERICAN INC	19,678	55.540	1,092,916.120	
RITE AID CORP	23,000	8.230	189,290.000	
RALPH LAUREN CORP	1,300	94.750	123,175.000	
AUTONATION INC	1,700	47.960	81,532.000	
ROCKWELL COLLINS INC	2,900	93.210	270,309.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	28,835	14.200	409,457.000	
CHEVRON CORP	43,318	118.080	5,114,989.440	
EDISON INTERNATIONAL	7,500	71.720	537,900.000	
TESLA MOTORS INC	2,670	202.490	540,648.300	
SYMANTEC CORP	14,700	24.080	353,976.000	

ENDO INTERNATIONAL PLC	4,600	16.030	73,738.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,472	116.770	405,425.440	
SYNOPSYS INC	3,400	60.110	204,374.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,885	288.440	1,409,029.400	
CBRE GROUP INC - A	7,100	31.760	225,496.000	
TWITTER INC	13,000	18.630	242,190.000	
NAVIENT CORP	7,100	16.370	116,227.000	
SOUTHERN CO/THE	21,750	48.920	1,064,010.000	
SYSCO CORP	12,400	56.360	698,864.000	
TRAVELERS COS INC/THE	6,723	121.600	817,516.800	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	11,000	10.490	115,390.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,200	48.520	155,264.000	
STERICYCLE INC	1,950	77.160	150,462.000	
SCHLUMBERGER LTD	31,702	85.500	2,710,521.000	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,900	40.040	156,156.000	
AT&T INC	140,091	41.670	5,837,591.970	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,800	49.930	189,734.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,830	271.760	497,320.800	
SEMPRA ENERGY	5,400	102.140	551,556.000	
TIFFANY & CO	2,800	79.800	223,440.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,000	39.100	273,700.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	23,000	72.890	1,676,470.000	
SALESFORCE.COM INC	14,700	69.860	1,026,942.000	
SIGNET JEWELERS LTD	1,700	94.070	159,919.000	
WESTROCK CO	5,930	52.720	312,629.600	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	21,784	42.080	916,670.720	
TESORO CORP	2,850	90.550	258,067.500	
UNION PACIFIC CORP	18,900	103.310	1,952,559.000	
MARATHON OIL CORP	19,000	18.590	353,210.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	12,300	50.110	616,353.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	18,250	108.520	1,980,490.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,950	115.810	1,847,169.500	
UNUM GROUP	5,400	43.550	235,170.000	
SPRINT CORP	17,765	8.240	146,383.600	
ANTERO RESOURCES CORP	3,400	24.430	83,062.000	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	3,494	77.880	272,112.720	

VOYA FINANCIAL INC	5,000	39.850	199,250.000	
AMEREN CORPORATION	5,500	51.600	283,800.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	21,726	163.940	3,561,760.440	
VERISIGN INC	2,200	77.900	171,380.000	
VALERO ENERGY CORP	10,792	68.000	733,856.000	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,390	262.130	364,360.700	
FNF GROUP	5,738	34.390	197,329.820	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,000	107.080	214,160.000	
ANTHEM INC	6,050	145.460	880,033.000	
WALT DISNEY CO/THE	34,700	103.910	3,605,677.000	
WELLS FARGO & CO	109,472	55.340	6,058,180.480	
FOOT LOCKER INC	3,200	75.440	241,408.000	
WASTE MANAGEMENT INC	10,300	70.080	721,824.000	
WILLIAMS COS INC	16,700	30.810	514,527.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,100	76.340	236,654.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	174.080	295,936.000	
WAL-MART STORES INC	35,150	70.980	2,494,947.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,600	103.500	476,100.000	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	19,500	5.480	106,860.000	
WYNN RESORTS LTD	1,800	91.900	165,420.000	
XEROX CORP	19,244	9.130	175,697.720	
WABTEC CORP	2,100	79.540	167,034.000	
TJX COMPANIES INC	14,900	76.770	1,143,873.000	
WATERS CORP	1,800	137.080	246,744.000	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	2,000	74.420	148,840.000	
ALLERGAN PLC	9,057	192.810	1,746,280.170	
WHOLE FOODS MARKET INC	7,800	32.290	251,862.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,250	86.080	1,829,200.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,083	122.330	377,143.390	
WESTERN DIGITAL CORP	6,450	67.180	433,311.000	
WEC ENERGY GROUP INC	7,380	58.010	428,113.800	
WESTAR ENERGY INC	3,200	57.380	183,616.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,750	43.990	516,882.500	
VISA INC-CLASS A SHARES	42,950	78.350	3,365,132.500	
PPL CORP	15,400	34.630	533,302.000	

PULTEGROUP INC	7,400	18.830	139,342.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,150	95.920	589,908.000	
NORTHERN TRUST CORP	4,900	88.460	433,454.000	
NVIDIA CORP	12,400	100.410	1,245,084.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,393	114.860	1,308,599.980	
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q- A	9,550	20.160	192,528.000	
TYSON FOODS INC-CL A	6,900	62.440	430,836.000	
NETFLIX INC	9,800	124.220	1,217,356.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,050	142.540	1,289,987.000	
TORCHMARK CORP	2,675	73.350	196,211.250	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,400	88.780	301,852.000	
TEXTRON INC	6,350	48.600	308,610.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	24,950	28.030	699,348.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,300	27.730	285,619.000	
NEWS CORP - CLASS A	8,337	11.610	96,792.570	
OGE ENERGY CORP	4,700	33.690	158,343.000	
OMNICOM GROUP	5,500	86.180	473,990.000	
ORACLE CORP	70,283	39.100	2,748,065.300	
MASTERCARD INC - A	22,050	103.430	2,280,631.500	
ONEOK INC	4,900	58.420	286,258.000	
CENTURYLINK INC	12,795	24.170	309,255.150	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,300	185.000	425,500.000	
YUM! BRANDS INC	8,300	64.250	533,275.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,400	228.830	320,362.000	
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,400	97.850	430,540.000	
NOBLE ENERGY INC	10,100	41.160	415,716.000	
BANK OF AMERICA CORP	232,501	22.660	5,268,472.660	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,800	85.360	324,368.000	
NORDSTROM INC	3,000	50.480	151,440.000	
AMERICAN EXPRESS CO	17,800	75.000	1,335,000.000	
ANALOG DEVICES INC	7,000	72.090	504,630.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	6,000	43.930	263,580.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	24,322	66.300	1,612,548.600	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	1,400	110.100	154,140.000	

ANADARKO PETROLEUM CORP	12,700	70.610	896,747.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,400	76.810	337,964.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,050	84.030	340,321.500	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,500	45.080	202,860.000	
MALLINCKRODT PLC	2,500	53.680	134,200.000	
AVERY DENNISON CORP	2,100	71.940	151,074.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	14,150	56.260	796,079.000	
EMERSON ELECTRIC CO	14,850	55.730	827,590.500	
AON PLC	6,200	112.090	694,958.000	
AMGEN INC	17,100	149.370	2,554,227.000	
CORE LABORATORIES N.V.	1,000	120.290	120,290.000	
COACH INC	6,400	35.320	226,048.000	
EATON CORP PLC	10,436	68.060	710,274.160	
CELGENE CORP	17,900	116.620	2,087,498.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,120	157.770	650,012.400	
APPLIED MATERIALS INC	24,500	32.510	796,495.000	
CIT GROUP INC	4,500	43.260	194,670.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,250	137.500	309,375.000	
CME GROUP INC	7,800	122.660	956,748.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,844	38.720	342,439.680	
ECOLAB INC	6,150	120.270	739,660.500	
EQUIFAX INC	2,750	116.970	321,667.500	
GAP INC/THE	5,800	23.910	138,678.000	
GILEAD SCIENCES INC	30,200	74.100	2,237,820.000	
ST JUDE MEDICAL INC	6,450	79.200	510,840.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,398	90.650	398,678.700	
HORMEL FOODS CORP	6,850	34.630	237,215.500	
STATE STREET CORP	8,793	78.620	691,305.660	
STAPLES INC	15,600	9.970	155,532.000	
SUNTRUST BANKS INC	11,598	55.270	641,021.460	
SCHWAB (CHARLES) CORP	27,400	38.840	1,064,216.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,400	44.720	509,808.000	
B/E AEROSPACE INC	2,300	59.670	137,241.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,600	59.530	273,838.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,100	52.780	163,618.000	
CARDINAL HEALTH INC	7,150	73.760	527,384.000	
FEDEX CORP	5,850	196.480	1,149,408.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,404	89.670	1,022,596.680	
FMC CORP	3,200	57.480	183,936.000	

FLEX LTD	12,200	14.530	177,266.000	
CERNER CORP	7,000	48.920	342,440.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,800	118.010	212,418.000	
CITRIX SYSTEMS INC	3,650	90.690	331,018.500	
INTEL CORP	108,400	36.310	3,936,004.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,800	23.880	210,144.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,100	47.650	433,615.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	7,400	124.920	924,408.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,500	4.520	174,020.000	
ILLUMINA INC	3,350	131.010	438,883.500	
SEALED AIR CORP	4,400	47.210	207,724.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	870	641.390	558,009.300	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,100	84.990	263,469.000	
SNAP-ON INC	1,300	171.980	223,574.000	
CALPINE CORP	7,200	11.560	83,232.000	
CARMAX INC	4,600	62.150	285,890.000	
COMERICA INC	4,000	67.670	270,680.000	
INGREDION INC	1,600	125.820	201,312.000	
DUKE ENERGY CORP	15,828	76.590	1,212,266.520	
TARGET CORP	12,400	76.750	951,700.000	
DOVER CORP	3,500	75.580	264,530.000	
VW GRAINGER INC	1,300	234.630	305,019.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,900	58.790	170,491.000	
CINTAS CORP	1,850	119.690	221,426.500	
CA INC	7,105	32.020	227,502.100	
CONAGRA BRANDS INC	9,500	38.410	364,895.000	
CLOROX COMPANY	2,950	119.040	351,168.000	
ENTERGY CORP	4,250	73.170	310,972.500	
MICROSOFT CORP	169,350	62.300	10,550,505.000	
INCYTE CORP	3,850	103.000	396,550.000	
CVS HEALTH CORP	24,274	79.560	1,931,239.440	
MEDTRONIC PLC	31,638	73.460	2,324,127.480	
MICRON TECHNOLOGY INC	24,100	20.270	488,507.000	
BLACKROCK INC	2,750	392.620	1,079,705.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	9,100	24.290	221,039.000	
HASBRO INC	2,600	80.870	210,262.000	
KELLOGG CO	6,100	73.290	447,069.000	

KEYCORP	24,500	18.160	444,920.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,400	86.610	207,864.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	35,611	44.370	1,580,060.070	
KOHL'S CORP	4,400	51.140	225,016.000	
COOPER COS INC/THE	1,100	175.210	192,731.000	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	11,100	17.180	190,698.000	
APACHE CORP	8,760	66.390	581,576.400	
CHUBB LTD	10,599	132.710	1,406,593.290	
ARROW ELECTRONICS INC	2,000	71.780	143,560.000	
ALLSTATE CORP	8,700	74.110	644,757.000	
EBAY INC	25,000	29.610	740,250.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	24,950	39.320	981,034.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	3,500	76.030	266,105.000	
XILINX INC	5,950	58.460	347,837.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	14,310	69.920	1,000,555.200	
DISH NETWORK CORP-A	5,300	58.400	309,520.000	
YAHOO! INC	21,000	38.610	810,810.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,150	76.130	392,069.500	
TOLL BROTHERS INC	3,800	31.590	120,042.000	
TRIMBLE INC	5,900	30.590	180,481.000	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,600	62.120	347,872.000	
LENNAR CORP-A	4,400	43.420	191,048.000	
LEAR CORP	1,700	134.750	229,075.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	6,500	34.560	224,640.000	
PROGRESSIVE CORP	13,400	35.720	478,648.000	
PRAXAIR INC	6,600	122.490	808,434.000	
PACCAR INC	7,987	65.100	519,953.700	
PVH CORP	1,900	91.980	174,762.000	
BIOGEN INC	4,980	286.400	1,426,272.000	
IDEXX LABORATORIES INC	2,000	119.430	238,860.000	
STARBUCKS CORP	33,600	57.660	1,937,376.000	
PERRIGO CO PLC	3,400	82.880	281,792.000	
EVERSOURCE ENERGY	7,480	54.570	408,183.600	
INTUIT INC	5,600	117.310	656,936.000	
BORGWARNER INC	4,800	39.740	190,752.000	
BEST BUY CO INC	6,500	47.000	305,500.000	
BALL CORP	3,792	76.660	290,694.720	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	31,047	21.400	664,405.800	



	BED BATH & BEYOND INC	3,600	47.270	170,172.000	
	XL GROUP LTD	6,800	36.410	247,588.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	7,050	79.510	560,545.500	
	VULCAN MATERIALS CO	3,050	123.450	376,522.500	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,650	76.800	433,920.000	
	VF CORP	7,750	53.780	416,795.000	
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,471	64.540	611,258.340	
	VIACOM INC-CLASS B	8,171	35.220	287,782.620	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,500	197.000	295,500.000	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,200	15.140	78,728.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,200	91.060	200,332.000	
	CARNIVAL CORP	8,050	51.500	414,575.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	54,570	69.860	3,812,260.200	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,800	55.050	319,290.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	26,500	6.160	163,240.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 454,941,850.150 (53,514,809,832)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	MERLIN ENTERTAINMENT	16,300	4.384	71,459.200	
	TUI AG-DI	11,747	11.090	130,274.230	
	BP PLC	436,300	4.897	2,136,561.100	
	UNILEVER PLC	30,110	31.520	949,067.200	
	BARCLAYS PLC	397,500	2.281	906,896.250	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	43,400	6.750	292,950.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	38,100	3.551	135,293.100	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,300	55.750	128,225.000	
	PRUDENTIAL PLC	60,200	15.830	952,966.000	
	INMARSAT PLC	10,300	7.385	76,065.500	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	79,291	2.276	180,466.310	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,564	30.710	140,160.440	
	BAE SYSTEMS PLC	73,100	5.925	433,117.500	
	AVIVA PLC	93,966	4.786	449,721.270	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	113,002	15.260	1,724,410.520	
	WORLDPAY GROUP PLC	42,700	2.682	114,521.400	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	8,000	7.250	58,000.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	25,200	3.888	97,977.600	

DCC PLC	2,000	58.600	117,200.000
ROYAL MAIL PLC	22,400	4.520	101,248.000
RELX PLC	25,646	13.910	356,735.860
DIAGEO PLC	58,500	20.550	1,202,175.000
RIO TINTO PLC	29,150	30.915	901,172.250
STANDARD CHARTERED PLC	75,800	6.850	519,230.000
TESCO PLC	191,100	2.004	382,964.400
FRESNILLO PLC	5,000	11.010	55,050.000
SMITH & NEPHEW PLC	21,500	11.830	254,345.000
GLENCORE PLC	283,925	2.684	762,054.700
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,700	12.360	70,452.000
SMITHS GROUP PLC	9,333	14.100	131,595.300
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	9.475	57,797.500
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	33,983	3.564	121,115.410
DIXONS CARPHONE PLC	24,800	3.441	85,336.800
PEARSON PLC	18,863	8.215	154,959.540
SAINSBURY (J) PLC	38,125	2.500	95,312.500
NEXT PLC	3,300	49.500	163,350.000
TAYLOR WIMPEY PLC	73,900	1.530	113,067.000
WHITBREAD PLC	4,311	36.230	156,187.530
IMI PLC	5,850	10.090	59,026.500
BUNZL PLC	7,755	20.710	160,606.050
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	20,600	2.543	52,385.800
GKN PLC	40,600	3.298	133,898.800
VODAFONE GROUP PLC	626,183	2.004	1,255,183.820
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,993	31.920	95,536.560
KINGFISHER PLC	51,911	3.429	178,002.810
WPP PLC	29,800	17.810	530,738.000
UNITED UTILITIES GROUP PLC	15,927	8.800	140,157.600
SEVERN TRENT PLC	5,733	21.830	125,151.390
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	14,900	66.140	985,486.000
ST JAMES'S PLACE PLC	11,900	9.990	118,881.000
SCHRODERS PLC	3,200	29.850	95,520.000
TATE & LYLE PLC	10,100	6.840	69,084.000
SSE PLC	23,800	15.170	361,046.000
WEIR GROUP PLC/THE	4,800	18.610	89,328.000
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,700	4.570	103,739.000
ASTRAZENECA PLC	29,300	44.010	1,289,493.000
WOLSELEY PLC	5,965	48.780	290,972.700

LEGAL & GENERAL GROUP PLC	138,100	2.427	335,168.700
3I GROUP PLC	22,991	6.800	156,338.800
SKY PLC	24,800	9.910	245,768.000
ASHTHEAD GROUP PLC	12,200	16.110	196,542.000
SAGE GROUP PLC/THE	26,114	6.490	169,479.860
NATIONAL GRID PLC	88,828	9.310	826,988.680
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,503,965	0.637	959,228.870
RSA INSURANCE GROUP PLC	24,260	5.695	138,160.700
IMPERIAL BRANDS PLC	22,650	34.900	790,485.000
CENTRICA PLC	128,360	2.301	295,356.360
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,000	27.960	83,880.000
PROVIDENT FINANCIAL PLC	3,650	27.500	100,375.000
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	43,560	45.065	1,963,031.400
NEX GROUP PLC	12,000	4.850	58,200.000
BHP BILLITON PLC	48,777	13.050	636,539.850
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,500	26.860	228,310.000
HSBC HOLDINGS PLC	463,300	6.669	3,089,747.700
SHIRE PLC	21,074	45.970	968,771.780
OLD MUTUAL PLC	117,025	1.992	233,113.800
ANGLO AMERICAN PLC	33,483	11.330	379,362.390
MONDI PLC	8,300	15.600	129,480.000
WM MORRISON SUPERMARKETS	50,900	2.268	115,441.200
CARNIVAL PLC	4,511	40.680	183,507.480
EASYJET PLC	3,500	10.430	36,505.000
COMPASS GROUP PLC	38,841	14.150	549,600.150
PERSIMMON PLC	7,550	17.060	128,803.000
BT GROUP PLC	195,600	3.670	717,852.000
COCA-COLA HBC AG-DI	4,400	16.590	72,996.000
WILLIAM HILL PLC	19,200	2.983	57,273.600
BURBERRY GROUP PLC	10,489	14.890	156,181.210
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,477	35.030	156,829.310
CAPITA PLC	15,090	4.901	73,956.090
TRAVIS PERKINS PLC	5,900	14.480	85,432.000
INTERTEK GROUP PLC	3,800	33.330	126,654.000
ITV PLC	86,800	1.959	170,041.200
PETROFAC LTD	5,600	8.725	48,860.000

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	7,549	28.020	211,522.980	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	100,000	21.750	2,175,000.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	86,818	22.890	1,987,264.020	
	MEGGITT PLC	17,700	4.773	84,482.100	
	G4S PLC	34,600	2.351	81,344.600	
	COBHAM PLC	38,600	1.746	67,395.600	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,300	17.920	59,136.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,200	17.820	92,664.000	
	INVESTEC PLC	14,500	5.340	77,430.000	
	ANTOFAGASTA PLC	8,600	6.700	57,620.000	
	STANDARD LIFE PLC	45,463	3.656	166,212.720	
	EXPERIAN PLC	23,054	15.120	348,576.480	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 40,986,628.070 (6,021,345,530)	
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	166.000	166,000.000	
	FRUTAROM	900	202.300	182,070.000	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	56,400	6.815	384,366.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	15.350	214,900.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	392.100	235,260.000	
	BANK HAPOALIM BM	26,500	22.390	593,335.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,600	15.750	592,200.000	
	NICE LTD	1,400	263.500	368,900.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 2,737,031.000 (83,096,261)	
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	2.290	85,875.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	61,700	2.760	170,292.000	
	BHP BILLITON LIMITED	75,200	25.000	1,880,000.000	
	SOUTH32 LTD	127,200	2.610	331,992.000	
	LENDLEASE GROUP	12,100	14.070	170,247.000	
	ALUMINA LTD	56,900	1.740	99,006.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,200	30.930	562,926.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	39,700	6.300	250,110.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	12.250	144,550.000	

NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	62,000	29.970	1,858,140.000	
WESTPAC BANKING CORP	78,098	32.190	2,513,974.620	
SANTOS LTD	34,000	3.960	134,640.000	
AUSNET SERVICES	41,000	1.505	61,705.000	
AUST AND NZ BANKING GROUP	68,900	29.810	2,053,909.000	
RIO TINTO LTD	9,700	59.290	575,113.000	
ORIGIN ENERGY LTD	41,400	6.470	267,858.000	
AMCOR LIMITED	26,700	14.650	391,155.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	46,800	4.900	229,320.000	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	10,000	3.790	37,900.000	
OIL SEARCH LTD	32,900	6.880	226,352.000	
SEEK LTD	7,500	14.830	111,225.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	17,100	10.390	177,669.000	
NEWCREST MINING LTD	17,600	16.750	294,800.000	
INCITEC PIVOT LTD	45,600	3.580	163,248.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	40,100	81.060	3,250,506.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,000	29.550	177,300.000	
ORICA LTD	8,300	16.870	140,021.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	32,800	12.420	407,376.000	
CIMIC GROUP LTD	2,900	33.670	97,643.000	
WOOLWORTHS LTD	30,000	22.950	688,500.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	9.790	134,123.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	20,500	4.700	96,350.000	
CROWN RESORTS LTD	10,600	11.490	121,794.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	14,554	3.320	48,319.280	
TELSTRA CORP LTD	98,600	4.910	484,126.000	
AMP LTD	66,500	4.950	329,175.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	10,300	21.170	218,051.000	
MACQUARIE GROUP LTD	7,284	87.540	637,641.360	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,600	15.080	190,008.000	
BANK OF QUEENSLAND LTD	9,100	11.500	104,650.000	
CSL LTD	10,600	96.930	1,027,458.000	
WESFARMERS LTD	26,745	41.450	1,108,580.250	
COCHLEAR LTD	1,400	116.030	162,442.000	
SUNCORP GROUP LTD	31,200	13.210	412,152.000	
BORAL LTD	22,700	5.270	119,629.000	
ASX LTD	4,200	48.460	203,532.000	
COMPUTERSHARE LTD	10,400	12.310	128,024.000	

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	4.970	69,580.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	54,900	5.830	320,067.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	9,500	21.590	205,105.000	
	TRANSURBAN GROUP	47,800	10.230	488,994.000	
	CHALLENGER LTD	12,200	11.130	135,786.000	
	SYDNEY AIRPORT	25,100	6.420	161,142.000	
	TATTS GROUP LTD	36,900	4.430	163,467.000	
	AGL ENERGY LTD	15,200	20.950	318,440.000	
	BRAMBLES LTD	37,300	12.020	448,346.000	
	APA GROUP	26,700	8.250	220,275.000	
	DUET GROUP	50,000	2.800	140,000.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,300	66.950	220,935.000	
	TPG TELECOM LTD	6,500	6.720	43,680.000	
	REA GROUP LTD	1,200	53.350	64,020.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,400	62.710	87,794.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 26,167,038.510 (2,246,440,256)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,200	48.210	347,112.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	440	604.140	265,821.600	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,696	31.570	148,252.720	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	5,387	64.760	348,862.120	
	SILVER WHEATON CORP	10,700	23.200	248,240.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,150	93.950	295,942.500	
	BCE INC	3,430	57.280	196,470.400	
	FRANCO-NEVADA CORP	4,300	75.210	323,403.000	
	SUNCOR ENERGY INC	38,630	43.790	1,691,607.700	
	METRO INC	5,500	40.300	221,650.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	7,700	55.550	427,735.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	28,200	76.040	2,144,328.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9,150	110.880	1,014,552.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	43,200	66.440	2,870,208.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	6,700	35.750	239,525.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	34,850	91.630	3,193,305.500	
	TOURMALINE OIL CORP	4,700	35.350	166,145.000	
	VERMILION ENERGY INC	2,500	57.630	144,075.000	
	TRANSCANADA CORP	18,950	61.600	1,167,320.000	

PEMBINA PIPELINE CORP	9,400	42.210	396,774.000	
BOMBARDIER INC-B	45,400	2.050	93,070.000	
BARRICK GOLD CORP	27,300	18.950	517,335.000	
CAE INC	5,800	18.820	109,156.000	
THOMSON REUTERS CORP	7,804	59.170	461,762.680	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	20,200	24.080	486,416.000	
EMPIRE CO LTD 'A'	3,900	15.000	58,500.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,400	48.450	67,830.000	
VERESEN INC	8,000	12.280	98,240.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	690	229.460	158,327.400	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	9,700	12.620	122,414.000	
LINAMAR CORP	1,100	59.470	65,417.000	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	5,400	30.360	163,944.000	
HYDRO ONE LTD	4,000	23.540	94,160.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,160	70.520	363,883.200	
EMERA INC	1,300	45.180	58,734.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,800	36.690	102,732.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,600	50.870	437,482.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,100	49.700	253,470.000	
KINROSS GOLD CORP	29,500	4.070	120,065.000	
BANK OF MONTREAL	15,200	96.900	1,472,880.000	
POWER CORP OF CANADA	8,700	30.330	263,871.000	
METHANEX CORP	2,200	61.270	134,794.000	
CAMECO CORP	9,200	14.490	133,308.000	
TELUS CORP	5,400	42.650	230,310.000	
POWER FINANCIAL CORP	5,600	34.150	191,240.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,400	27.260	365,284.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,700	141.260	240,142.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	20,800	4.430	92,144.000	
AGRIUM INC	3,100	133.280	413,168.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	25,500	44.700	1,139,850.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	540	614.450	331,803.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,300	59.770	555,861.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,100	113.270	124,597.000	
BLACKBERRY LTD	11,900	10.110	120,309.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	14,250	51.550	734,587.500	

ENBRIDGE INC	22,000	57.350	1,261,700.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	20,550	44.630	917,146.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	45,800	24.560	1,124,848.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	7,100	18.850	133,835.000	
GOLDCORP INC	19,959	16.640	332,117.760	
ENCANA CORP	23,200	16.320	378,624.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,300	193.730	639,309.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,200	54.320	119,504.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,200	37.130	193,076.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	18,050	89.510	1,615,655.500	
CGI GROUP INC - CLASS A	5,300	63.000	333,900.000	
HUSKY ENERGY INC	7,558	16.730	126,445.340	
ONEX CORPORATION	2,000	91.130	182,260.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	9,500	27.010	256,595.000	
FINNING INTERNATIONAL INC	3,900	26.470	103,233.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,400	56.530	192,202.000	
ELDORADO GOLD CORP	17,200	3.730	64,156.000	
IGM FINANCIAL INC	2,300	39.620	91,126.000	
OPEN TEXT CORP	2,800	80.700	225,960.000	
CI FINANCIAL CORP	5,400	28.910	156,114.000	
SAPUTO INC	5,800	46.490	269,642.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,100	14.280	244,188.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,800	62.770	615,146.000	
YAMANA GOLD INC	23,300	3.550	82,715.000	
FORTIS INC	9,600	40.540	389,184.000	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	13,300	18.390	244,587.000	
CENOVUS ENERGY INC	19,600	21.200	415,520.000	
DOLLARAMA INC	2,700	100.150	270,405.000	
ATCO LTD -CLASS I	1,700	44.830	76,211.000	
ALTAGAS LTD	3,900	34.190	133,341.000	
FIRST CAPITAL REALTY INC	2,600	20.470	53,222.000	
KEYERA CORP	4,000	40.260	161,040.000	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,900	33.880	132,132.000	
INTER PIPELINE LTD	8,100	29.790	241,299.000	



	ARC RESOURCES LTD	8,300	24.150	200,445.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 38,205,300.420 (3,369,325,444)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	30,000	20.930	627,900.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	41,500	18.030	748,245.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,470	9.790	122,081.300	
	KEPPEL CORP LTD	34,500	6.000	207,000.000	
	UOL GROUP LTD	13,200	6.270	82,764.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	11,200	8.180	91,616.000	
	CAPITALAND LTD	59,000	3.020	178,180.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	3.600	147,600.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,000	39.870	119,610.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	74,200	9.180	681,156.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	153,000	0.945	144,585.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	188,650	3.730	703,664.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	35,000	3.340	116,900.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	29,000	2.910	84,390.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	219,400	0.425	93,245.000	
	SATS LTD	16,000	4.970	79,520.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	19,000	7.320	139,080.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,800	2.600	121,680.000	
	STARHUB LTD	16,000	2.810	44,960.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	56,000	3.700	207,200.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	69,000	2.230	153,870.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 4,895,246.800 (398,815,757)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFY AG-REG	1,050	125.600	131,880.000	
	UBS GROUP AG-REG	86,000	16.580	1,425,880.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	200	509.500	101,900.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,000	66.700	266,800.000	

ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	16,350	233.500	3,817,725.000	
PARGESA HOLDING SA-BR	800	65.850	52,680.000	
SIKA AG-BR	50	4,798.000	239,900.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	60,190.000	120,380.000	
ABB LTD-REG	43,900	21.580	947,362.000	
ARYZTA AG	2,100	44.700	93,870.000	
SWISS RE AG	7,550	96.800	730,840.000	
NESTLE SA-REG	72,700	72.200	5,248,940.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	420	479.000	201,180.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,000	175.400	175,400.000	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	43,520	15.730	684,569.600	
JULIUS BAER GROUP LTD	5,200	46.250	240,500.000	
SGS SA-REG	130	2,055.000	267,150.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	500	174.500	87,250.000	
GALENICA AG-REG	90	1,132.000	101,880.000	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	750	308.400	231,300.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,512	280.100	983,711.200	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,200	129.600	155,520.000	
NOVARTIS AG-REG	52,200	73.700	3,847,140.000	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	50	1,211.000	60,550.000	
CIE FINANCIERE RICHEMONT- REG	12,000	66.850	802,200.000	
SWISSCOM AG-REG	590	447.300	263,907.000	
GEBERIT AG-REG	900	400.100	360,090.000	
GIVAUDAN-REG	220	1,832.000	403,040.000	
ACTELION LTD-REG	2,250	218.200	490,950.000	
SYNGENTA AG-REG	2,162	413.200	893,338.400	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,300	120.300	156,390.000	
LONZA GROUP AG-REG	1,300	169.500	220,350.000	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,100	60.650	66,715.000	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	10,440	53.100	554,364.000	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	800	289.300	231,440.000	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,250	135.100	168,875.000	
SWISS PRIME SITE-REG	1,600	80.950	129,520.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	5,150.000	118,450.000	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 25,073,937.200 (2,873,473,203)	

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	271.200	515,280.000	
	ERICSSON LM-B SHS	72,230	55.850	4,034,045.500	
	VOLVO AB-B SHS	34,500	108.500	3,743,250.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,500	390.000	585,000.000	
	SKF AB-B SHARES	8,650	170.000	1,470,500.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	5,450	226.900	1,236,605.000	
	NORDEA BANK AB	70,650	103.500	7,312,275.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,550	298.000	1,355,900.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	72.400	647,980.000	
	GETINGE AB-B SHS	4,700	147.800	694,660.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	34,150	98.900	3,377,435.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	35,200	131.200	4,618,240.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	21,300	227.000	4,835,100.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	21,700	258.300	5,605,110.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	14,100	254.500	3,588,450.000	
	SKANSKA AB-B SHS	8,250	217.700	1,796,025.000	
	SANDVIK AB	24,450	116.200	2,841,090.000	
	INVESTOR AB-B SHS	10,800	342.200	3,695,760.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,700	286.200	4,493,340.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,200	138.200	1,271,440.000	
	TELIA CO AB	60,000	36.750	2,205,000.000	
	ALFA LAVAL AB	7,000	149.100	1,043,700.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	256.300	2,332,330.000	
	ASSA ABLOY AB-B	23,300	171.700	4,000,610.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	900	548.500	493,650.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,000	194.000	970,000.000	
	BOLIDEN AB	6,000	251.600	1,509,600.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	9,750	69.350	676,162.500	
	KINNEVIK AB - B	5,300	227.500	1,205,750.000	
	HEXAGON AB-B SHS	6,200	329.100	2,040,420.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,500	169.500	593,250.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クロー ナ 74,787,958.000 (940,832,512)	
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	44,500	255.300	11,360,850.000	
	DANSKE BANK A/S	16,350	214.400	3,505,440.000	
	ISS A/S	3,900	241.500	941,850.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	10,940.000	1,039,300.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,200	432.500	2,249,000.000	
	TDC A/S	19,300	35.420	683,606.000	
	CARLSBERG AS-B	2,450	599.500	1,468,775.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,500	242.800	1,335,400.000	
	COLOPLAST-B	2,800	470.000	1,316,000.000	
	DSV A/S	4,600	311.000	1,430,600.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,375	124.500	420,187.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	150	11,520.000	1,728,000.000	
	PANDORA A/S	2,650	860.000	2,279,000.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,350	386.900	909,215.000	
	GENMAB A/S	1,300	1,139.000	1,480,700.000	
	DONG ENERGY A/S	2,000	246.000	492,000.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 32,639,923.500 (540,190,734)	
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	2.520	65,520.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.400	179,142.600	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	6.350	148,590.000	
	CONTACT ENERGY LTD	13,000	4.700	61,100.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	10.320	207,432.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,300	8.100	42,930.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 704,714.600 (57,835,927)	
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	41.530	1,270,818.000	
	DNB ASA	22,550	131.200	2,958,560.000	
	ORKLA ASA	19,050	76.500	1,457,325.000	
	TELENOR ASA	17,800	130.000	2,314,000.000	
	STATOIL ASA	26,173	158.000	4,135,334.000	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,500	187.500	281,250.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,160	327.000	1,360,320.000	

	MARINE HARVEST	8,700	153.000	1,331,100.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,850	133.200	646,020.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,800	175.500	315,900.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 16,070,627.000 (218,239,115)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	19,250	97.570	1,878,222.500	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,800	28.485	108,243.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	32,150	18.325	589,148.750	
	COMMERZBANK AG	24,685	7.728	190,765.680	
	VOLKSWAGEN AG	800	139.650	111,720.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	4,350	131.200	570,720.000	
	MAN SE	850	94.400	80,240.000	
	SIEMENS AG-REG	17,900	115.500	2,067,450.000	
	E.ON SE	46,500	6.520	303,180.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,750	90.000	697,500.000	
	GEA GROUP AG	4,200	37.520	157,584.000	
	OSRAM LICHT AG	2,160	47.795	103,237.200	
	CONTINENTAL AG	2,550	183.700	468,435.000	
	BASF SE	21,350	87.720	1,872,822.000	
	LINDE AG	4,400	162.750	716,100.000	
	K+S AG-REG	4,400	21.780	95,832.000	
	ALLIANZ SE-REG	10,680	156.650	1,673,022.000	
	THYSSENKRUPP AG	8,500	23.265	197,752.500	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,200	111.700	469,140.000	
	RWE AG	11,800	11.315	133,517.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	5,050	12.925	65,271.250	
	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	900	56.500	50,850.000	
	BRENTAG AG	3,650	52.490	191,588.500	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	9,700	72.070	699,079.000	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,700	36.340	98,118.000	
	HOCHTIEF AG	500	133.750	66,875.000	
	SAP SE	22,842	81.430	1,860,024.060	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,720	176.800	657,696.000	
	SCHAEFFLER AG	3,800	13.660	51,908.000	
	ZALANDO SE	1,900	35.710	67,849.000	

HEIDELBERGCEMENT AG	3,300	87.290	288,057.000	
COVESTRO AG	1,600	64.300	102,880.000	
INNOGY SE	3,400	31.060	105,604.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,700	51.510	190,587.000	
BEIERSDORF AG	2,300	79.270	182,321.000	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,500	39.505	59,257.500	
MERCK KGAA	3,100	97.820	303,242.000	
ADIDAS AG	4,420	144.750	639,795.000	
HENKEL AG & CO KGAA	2,400	98.300	235,920.000	
METRO AG	4,100	31.120	127,592.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	75,400	16.000	1,206,400.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,050	78.920	398,546.000	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	22,500	70.620	1,588,950.000	
QIAGEN N.V.	5,450	26.650	145,242.500	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	27,000	16.375	442,125.000	
HANNOVER RUECK SE	1,400	103.000	144,200.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	22,500	31.120	700,200.000	
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	4,600	79.630	366,298.000	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	5,050	36.330	183,466.500	
LANXESS AG	2,200	62.320	137,104.000	
AXEL SPRINGER SE	1,000	44.720	44,720.000	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	8,200	28.365	232,593.000	
SYMRISE AG	3,000	56.510	169,530.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,500	4.031	66,511.500	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,200	73.940	88,728.000	
HUGO BOSS AG -ORD	1,650	57.000	94,050.000	
RTL GROUP	1,000	67.100	67,100.000	
VONOVIA SE	10,900	29.715	323,893.500	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,876	27.990	612,309.240	
NN GROUP NV	7,600	31.710	240,996.000	
ARCELORMITTAL	42,300	7.457	315,431.100	
UNILEVER NV-CVA	37,850	38.265	1,448,330.250	
HEINEKEN NV	5,300	70.650	374,445.000	
RELX NV	23,419	15.740	368,615.060	
AEGON NV	40,744	5.274	214,883.850	

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZEN	29,883	19.560	584,511.480	
AKZO NOBEL	5,800	59.460	344,868.000	
KONINKLIJKE DSM NV	4,400	56.550	248,820.000	
WOLTERS KLUWER	6,900	33.735	232,771.500	
BOSKALIS WESTMINSTER	2,100	32.560	68,376.000	
ING GROEP NV	90,250	13.600	1,227,400.000	
KONINKLIJKE KPN NV	78,250	2.756	215,657.000	
ASML HOLDING NV	8,680	102.000	885,360.000	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	5,400	21.130	114,102.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,200	30.935	160,862.000	
VOPAK	1,600	43.700	69,920.000	
RANDSTAD HOLDING NV	3,000	52.080	156,240.000	
HEINEKEN HOLDING NV	2,300	66.120	152,076.000	
GEMALTO	2,000	54.900	109,800.000	
ALTICE NV - A	8,900	18.890	168,121.000	
ALTICE NV - B	2,900	18.870	54,723.000	
JCDECAUX SA	1,600	27.125	43,400.000	
SFR GROUP SA	2,300	26.100	60,030.000	
TOTAL SA	52,150	48.210	2,514,151.500	
MICHELIN (CGDE)	4,200	105.100	441,420.000	
AIR LIQUIDE SA	9,048	106.050	959,540.400	
KERING	1,800	211.900	381,420.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	13,200	65.720	867,504.000	
BOUYGUES SA	4,650	33.850	157,402.500	
BNP PARIBAS	24,500	60.960	1,493,520.000	
PEUGEOT SA	11,250	15.695	176,568.750	
NATIXIS	22,950	5.365	123,126.750	
THALES SA	2,550	91.880	234,294.000	
DANONE	13,800	61.240	845,112.000	
CARREFOUR SA	12,900	22.770	293,733.000	
SUEZ	7,475	13.235	98,931.620	
VIVENDI	23,741	18.180	431,611.380	
L'OREAL	5,850	169.100	989,235.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	11,500	43.425	499,387.500	
LEGRAND SA	6,367	53.200	338,724.400	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,300	45.080	58,604.000	
PERNOD RICARD SA	4,917	102.550	504,238.350	
SOCIETE BIC SA	700	125.800	88,060.000	

EURAZEO	1,075	54.350	58,426.250
REXEL SA	7,050	15.440	108,852.000
SOCIETE GENERALE SA	18,000	46.955	845,190.000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,550	179.200	1,173,760.000
ACCOR SA	4,000	36.970	147,880.000
CAPGEMINI	3,900	78.610	306,579.000
VALEO SA	5,650	55.520	313,688.000
PUBLICIS GROUPE	4,600	64.230	295,458.000
BUREAU VERITAS SA	6,050	18.200	110,110.000
EIFFAGE	1,300	65.460	85,098.000
SODEXO	2,150	106.050	228,007.500
INGENICO GROUP	1,200	73.670	88,404.000
ZODIAC AEROSPACE	4,800	22.580	108,384.000
EUROFINS SCIENTIFIC	270	408.200	110,214.000
SEB SA	600	126.650	75,990.000
ESSILOR INTERNATIONAL	4,900	105.250	515,725.000
DASSAULT AVIATION SA	60	1,081.600	64,896.000
AXA SA	45,500	23.990	1,091,545.000
CHRISTIAN DIOR SE	1,300	198.400	257,920.000
LAGARDERE SCA	2,650	25.710	68,131.500
TECHNIP SA	2,550	66.580	169,779.000
EDENRED	4,750	18.840	89,490.000
RENAULT SA	4,400	85.250	375,100.000
HERMES INTERNATIONAL	620	387.300	240,126.000
STMICROELECTRONICS NV	15,300	10.430	159,579.000
REMY COINTREAU	550	80.390	44,214.500
ATOS SE	2,150	97.900	210,485.000
DASSAULT SYSTEMES SA	3,050	70.450	214,872.500
WENDEL	600	113.600	68,160.000
ORANGE	46,900	14.000	656,600.000
ALSTOM	3,650	25.920	94,608.000
CNP ASSURANCES	3,750	17.615	66,056.250
SANOFI	27,075	74.390	2,014,109.250
VINCI SA	11,850	64.270	761,599.500
AIRBUS GROUP SE	13,600	64.180	872,848.000
VEOLIA ENVIRONNEMENT	10,550	15.605	164,632.750
CREDIT AGRICOLE SA	25,700	11.900	305,830.000
ENGIE	34,173	12.125	414,347.620



IMERYSA SA	900	71.450	64,305.000
EDF	5,550	9.710	53,890.500
SES	8,350	20.405	170,381.750
SAFRAN SA	7,400	68.610	507,714.000
ILIAD SA	600	177.450	106,470.000
ARKEMA	1,550	93.790	145,374.500
ADP	750	98.470	73,852.500
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	18.575	75,228.750
SCOR SE	4,100	32.075	131,507.500
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	10,450	8.944	93,464.800
BOLLORE	19,000	3.323	63,137.000
UCB SA	2,750	58.530	160,957.500
KBC GROEP NV	5,800	60.900	353,220.000
COLRUYT SA	1,600	46.070	73,712.000
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,700	79.420	135,014.000
SOLVAY SA	1,700	111.800	190,060.000
UMICORE	2,250	53.170	119,632.500
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	17,900	98.880	1,769,952.000
AGEAS	4,790	37.450	179,385.500
PROXIMUS	3,500	26.830	93,905.000
TELENET GROUP HOLDING NV	1,200	51.080	61,296.000
UNIPOLSAI SPA	21,750	2.046	44,500.500
PRYSMIAN SPA	4,800	24.190	116,112.000
ASSICURAZIONI GENERALI	27,843	14.400	400,939.200
SAIPEM SPA	134,300	0.489	65,672.700
MEDIOBANCA SPA	13,015	7.765	101,061.470
TENARIS SA	10,550	16.310	172,070.500
UNICREDIT SPA	123,569	2.872	354,890.160
TELECOM ITALIA SPA	236,282	0.807	190,679.570
TELECOM ITALIA-RSP	134,950	0.660	89,134.470
INTESA SANPAOLO-RSP	21,000	2.210	46,410.000
INTESA SANPAOLO	298,597	2.414	720,813.150
ATLANTIA SPA	9,907	22.110	219,043.770
POSTE ITALIANE SPA	11,800	6.355	74,989.000
ENI SPA	59,800	15.050	899,990.000
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	9,525	13.400	127,635.000
ENEL SPA	177,834	4.022	715,248.340
SNAM SPA	58,200	3.768	219,297.600
LUXOTTICA GROUP SPA	3,700	51.050	188,885.000

TERNA SPA	35,400	4.232	149,812.800
EXOR NV	2,500	41.320	103,300.000
CNH INDUSTRIAL NV	24,300	8.300	201,690.000
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,350	8.495	164,378.250
FERRARI NV	2,835	56.050	158,901.750
TELEFONICA SA	104,627	8.766	917,160.280
ENDESA SA	7,650	20.170	154,300.500
BANCO POPULAR ESPANOL	75,473	1.010	76,227.730
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	153,412	6.552	1,005,155.420
IBERDROLA SA	127,134	6.001	762,931.130
BANCO DE SABADELL SA	131,909	1.398	184,408.780
BANKINTER SA	15,100	7.612	114,941.200
REPSOL SA	25,700	13.825	355,302.500
GRIFOLS SA	6,700	18.175	121,772.500
BANCO SANTANDER SA	343,850	5.033	1,730,597.050
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	14,900	13.315	198,393.500
AMADEUS IT GROUP SA	10,000	42.865	428,650.000
GAS NATURAL SDG SA	8,450	17.480	147,706.000
MAPFRE SA	21,450	3.062	65,679.900
CAIXABANK S.A	74,800	3.233	241,828.400
ZARDOYA OTIS SA	4,550	8.060	36,673.000
INTL CONSOLIDATED AIRLINE- DI	18,000	5.489	98,802.000
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,476	30.260	135,443.760
AENA SA	1,600	132.600	212,160.000
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	25,300	32.450	820,985.000
ENAGAS SA	5,400	24.600	132,840.000
RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,000	17.425	174,250.000
FERROVIAL SA	11,700	17.175	200,947.500
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	15,700	4.573	71,796.100
BANKIA SA	108,422	1.005	108,964.110
UPM-KYMMENE OYJ	12,400	22.250	275,900.000
NOKIA OYJ	135,850	4.654	632,245.900
WARTSILA OYJ ABP	3,200	41.870	133,984.000
STORA ENSO OYJ-R SHS	13,100	9.815	128,576.500
METSO OYJ	3,000	27.470	82,410.000

	ELISA OYJ	3,550	30.180	107,139.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	10,300	43.080	443,724.000	
	FORTUM OYJ	10,450	14.410	150,584.500	
	KONE OYJ-B	7,850	41.950	329,307.500	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	2,650	35.120	93,068.000	
	NESTE OYJ	2,950	35.840	105,728.000	
	ORION OYJ-CLASS B	2,050	42.290	86,694.500	
	OMV AG	3,550	34.100	121,055.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	6,650	28.600	190,190.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	38.535	109,824.750	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	2,400	18.140	43,536.000	
	ANDRITZ AG	1,600	47.500	76,000.000	
	BANK OF IRELAND	661,800	0.244	161,479.200	
	JERONIMO MARTINS	6,000	14.760	88,560.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,500	2.854	141,273.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	10,350	14.120	146,142.000	
	KERRY GROUP PLC-A	3,850	65.610	252,598.500	
	CRH PLC	19,400	32.140	623,516.000	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	1,900	102.500	194,750.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 81,238,251.930 (9,993,117,370)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	33,000	69.000	2,277,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	55,000	33.900	1,864,500.000	
	MTR CORP	34,500	37.900	1,307,550.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	35,000	99.450	3,480,750.000	
	SINO LAND CO	88,000	11.460	1,008,480.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	63,169	90.000	5,685,210.000	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	52.250	1,672,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	12,500	73.700	921,250.000	
	CLP HOLDINGS LTD	42,500	72.650	3,087,625.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	33,000	10.180	335,940.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	28,386	41.150	1,168,083.900	
	HANG LUNG GROUP LTD	21,000	29.100	611,100.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	181,142	13.800	2,499,759.600	
	HANG SENG BANK LTD	17,900	147.000	2,631,300.000	

WHEELOCK & CO LTD	25,000	44.150	1,103,750.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	129,000	8.300	1,070,700.000	
WH GROUP LTD	135,000	6.490	876,150.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	27,300	185.100	5,053,230.000	
LI & FUNG LTD	132,000	3.560	469,920.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	52,000	16.860	876,720.000	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	76.850	499,525.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	29.000	609,000.000	
NWS HOLDINGS LTD	46,500	12.760	593,340.000	
KERRY PROPERTIES LTD	18,000	21.450	386,100.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	29,040	30.600	888,624.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	14,000	32.950	461,300.000	
SJM HOLDINGS LTD	47,000	6.020	282,940.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	30,000	21.750	652,500.000	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	64,169	50.350	3,230,909.150	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	62.300	934,500.000	
PCCW LTD	95,000	4.280	406,600.000	
AIA GROUP LTD	283,000	44.400	12,565,200.000	
SANDS CHINA LTD	57,200	33.000	1,887,600.000	
SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	8.260	247,800.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	31,500	28.400	894,600.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	20,000	14.840	296,800.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	87,500	27.700	2,423,750.000	
WYNN MACAU LTD	38,000	12.380	470,440.000	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	57,000	9.450	538,650.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 66,271,196.650 (1,004,008,629)	
合計			81,261,530,570 [81,261,530,570]	

## (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	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,197	552,857.210	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,187	1,302,931.230	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,600	447,624.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	13,600	354,824.000	

VORNADO REALTY TRUST	3,827	395,520.450	
EQUITY RESIDENTIAL	8,500	544,425.000	
EQUINIX INC	1,608	562,800.000	
AMERICAN TOWER CORP	9,750	1,031,550.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	17,293	328,739.930	
KIMCO REALTY CORP	10,000	255,100.000	
VENTAS INC	7,900	482,927.000	
WEYERHAEUSER CO	17,614	541,102.080	
AGNC INVESTMENT CORP	7,800	139,386.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,900	168,429.000	
CROWN CASTLE INTL CORP	7,750	664,175.000	
IRON MOUNTAIN INC	5,610	179,856.600	
VEREIT INC	22,300	185,536.000	
PROLOGIS INC	12,262	643,509.760	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,700	183,549.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2,000	163,660.000	
DUKE REALTY CORP	8,000	209,440.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,480	335,960.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,600	224,416.000	
WELLTOWER INC	8,300	540,994.000	
HCP INC	10,700	311,798.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	130,449.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,700	164,407.000	
MACERICH CO/THE	3,000	209,310.000	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23,200	236,640.000	
REALTY INCOME CORP	6,000	332,820.000	
PUBLIC STORAGE	3,400	743,682.000	
REGENCY CENTERS CORP	2,300	155,779.000	
SL GREEN REALTY CORP	2,250	246,577.500	
UDR INC	6,300	221,823.000	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,700	349,983.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,750	204,050.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 13,746,630.760 (1,617,016,177)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
LAND SECURITIES GROUP PLC	18,200	187,460.000	
SEGRO PLC	19,950	87,680.250	

	HAMMERSON PLC	17,400	96,309.000	
	BRITISH LAND CO PLC	22,100	139,009.000	
	INTU PROPERTIES PLC	21,100	57,603.000	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 568,061.250 (83,453,878)	
オーストラリア・ドル	SCENTRE GROUP	121,922	531,579.920	
	DEXUS PROPERTY GROUP	23,950	219,382.000	
	GPT GROUP	40,060	193,890.400	
	MIRVAC GROUP	93,400	195,206.000	
	STOCKLAND	57,000	249,090.000	
	WESTFIELD CORP	45,496	406,734.240	
	GOODMAN GROUP	41,700	289,815.000	
	VICINITY CENTRES	74,873	217,880.430	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 2,303,577.990 (197,762,170)	
カナダ・ドル	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1,500	47,580.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,000	65,700.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,300	85,173.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 198,453.000 (17,501,570)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	48,000	110,880.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	63,200	120,396.000	
	SUNTEC REIT	53,000	87,450.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 318,726.000 (25,966,607)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,360	511,648.000	
	ICADE	750	49,740.000	
	GECINA SA	950	121,125.000	
	KLEPIERRE	5,200	187,070.000	
	FONCIERE DES REGIONS	750	60,247.500	

ユーロ 小計			ユーロ	
			929,830.500	
			(114,378,450)	
香港・ドル	LINK REIT	52,000	香港・ドル	
			2,610,400.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル	
			2,610,400.000	
			(39,547,560)	
投資証券 合計			2,095,626,412	
			[2,095,626,412]	
合計			2,095,626,412	
			[2,095,626,412]	

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 591銘柄 投資証券 36銘柄	97.1%	2.9%	66.2%
イギリス・ポンド	株式 105銘柄 投資証券 5銘柄	98.6%	1.4%	7.3%
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 62銘柄 投資証券 8銘柄	91.9%	8.1%	2.9%
カナダ・ドル	株式 90銘柄 投資証券 3銘柄	99.5%	0.5%	4.1%
シンガポール・ドル	株式 21銘柄 投資証券 3銘柄	93.9%	6.1%	0.5%
スイス・フラン	株式 38銘柄	100%	-%	3.4%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	100%	-%	0.6%
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	0.3%
ユーロ	株式 234銘柄 投資証券 5銘柄	98.9%	1.1%	12.1%
香港・ドル	株式 39銘柄 投資証券 1銘柄	96.2%	3.8%	1.3%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 「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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,400,166,208	4,972,263,132
投資証券	203,884,987,250	255,690,211,900
派生商品評価勘定	10,569,554	20,425,856
未収入金	97,674,580	-
未収配当金	845,070,435	1,045,322,377
前払金	14,375,000	-
流動資産合計	206,252,843,027	261,728,223,265
資産合計	206,252,843,027	261,728,223,265
負債の部		
流動負債		
前受金	-	19,071,800
未払金	435,736,600	3,138,607,753
未払解約金	14,020,000	18,444,000
流動負債合計	449,756,600	3,176,123,553
負債合計	449,756,600	3,176,123,553
純資産の部		
元本等		
元本	89,610,737,405	105,872,694,601
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	116,192,349,022	152,679,405,111
元本等合計	205,803,086,427	258,552,099,712
純資産合計	205,803,086,427	258,552,099,712
負債純資産合計	206,252,843,027	261,728,223,265



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19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	<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、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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1. 1 期首	平成26年12月19日	平成27年12月19日
期首元本額	73,244,127,617円	89,610,737,405円
期中追加設定元本額	20,981,162,237円	24,593,354,604円
期中一部解約元本額	4,614,552,449円	8,331,397,408円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ - R E I Tオープン	9,609,730,223円	9,781,847,232円
ダイワJ - R E I Tオープン （毎月分配型）	76,133,510,230円	90,876,052,371円

	ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	548,507,585円	426,116,567円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	- 円	18,797円
	iFree J-REITイ ンデックス	- 円	33,242,209円
	iFree 8資産バランス	- 円	45,191,617円
	DC・ダイワJ-REIT オープン	2,463,050,337円	3,226,297,529円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,361,662円	3,357,905円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,320,123円	4,855,028円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	783,940円	900,684円
	ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	2,376,414円	51,513,007円
	ダイワファンドラップ J- REITインデックス	- 円	188,297,819円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	845,096,891円	1,235,003,836円
	計	89,610,737,405円	105,872,694,601円
2.	期末日における受益権の総数	89,610,737,405口	105,872,694,601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 175,500,000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 377,400,000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27年12月19日 至 平成28年12月19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）における不動産投信指数先物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28年12月19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

種 類	平成27年12月18日現在	平成28年12月19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	17,644,873,811	2,912,964,927
合計	17,644,873,811	2,912,964,927

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成27年9月16日から平成27年12月18日まで、及び平成28年9月16日から平成28年12月19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27年12月18日 現在				平成28年12月19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	1,645,575,000	-	1,656,480,000	10,905,000	2,667,788,200	-	2,688,378,000	20,589,800
合計	1,645,575,000	-	1,656,480,000	10,905,000	2,667,788,200	-	2,688,378,000	20,589,800

(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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1口当たり純資産額	2.2966円	2.4421円
(1万口当たり純資産額)	(22,966円)	(24,421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	10,621	5,018,422,500	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	5,832	2,003,292,000	
	森ヒルズリート	38,377	5,852,492,500	
	産業ファンド	7,729	4,088,641,000	
	アドバンス・レジデンス	29,594	8,499,396,800	
	ケネディクスレジデンシャル	7,653	2,223,961,800	
	A P I 投資法人	14,483	7,603,575,000	
	G L P 投資法人	62,544	7,974,360,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	11,257	2,723,068,300	
	日本プロロジスリート	41,723	9,471,121,000	
	星野リゾート・リート	3,584	2,096,640,000	
	S I A 不動産投資	2,075	793,687,500	
	イオンリート投資	28,706	3,588,250,000	
	ヒューリックリート投資法	22,908	4,194,454,800	
	日本リート投資法人	8,588	2,406,357,600	
	インベスコ・オフィス・Jリート	17,878	1,684,107,600	
	日本ヘルスケア投資法	1,636	292,026,000	
	積水ハウス・リート投資	19,598	2,794,674,800	
	トーセイ・リート投資法人	4,016	434,129,600	
	ケネディクス商業リート	9,261	2,324,511,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	2,642	274,503,800	
	サムティ・レジデンシャル	6,204	526,099,200	
	ジャパン・シニアリビング	1,858	263,092,800	
	野村不動産マスターF	91,701	15,910,123,500	
	いちごホテルリート投資	5,647	724,510,100	
	ラサールロジポート投資	24,114	2,544,027,000	
	スターアジア不動産投	7,556	712,530,800	
	マリモ地方創生リート	1,994	159,320,600	
	三井不ロジパーク	4,910	1,522,100,000	
	大江戸温泉リート	3,863	322,174,200	
	さくら総合リート	7,300	570,130,000	
	日本ビルファンド	30,953	19,469,437,000	
	ジャパンリアルエステイト	28,702	18,082,260,000	
日本リテールファンド	55,948	12,923,988,000		
オリックス不動産投資	55,344	9,884,438,400		
日本プライムリアルティ	19,138	8,937,446,000		

プレミア投資法人	28,871	3,828,294,600	
東急リアル・エステート	21,431	2,963,907,300	
グローバル・ワン不動産投資法人	4,248	1,777,788,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	66,708	11,513,800,800	
森トラスト総合リート	28,936	5,199,799,200	
インヴィンシブル投資法人	80,580	4,456,074,000	
フロンティア不動産投資	10,873	5,458,246,000	
平和不動産リート	22,247	1,757,513,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	19,291	4,382,915,200	
福岡リート投資法人	16,375	2,818,137,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	8,876	5,618,508,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	24,234	2,912,926,800	
いちごオフィスリート投資法人	33,590	2,472,224,000	
大和証券オフィス投資法人	10,914	6,166,410,000	
阪急リート投資法人	13,098	1,874,323,800	
スタートプロシード投資法人	5,629	848,853,200	
大和ハウスリート投資法人	33,305	9,338,722,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	82,467	6,622,100,100	
日本賃貸住宅投資法人	35,953	2,764,785,700	
ジャパンエクセレント投資法人	28,623	4,021,531,500	
投資証券 合計		255,690,211,900	
合計		255,690,211,900	

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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	33,797,966	302,428,959
コール・ローン	23,257,211	92,651,825
株式	275,926	-
投資証券	2,753,587,911	6,092,393,296
未収入金	14,859	1,401
未収配当金	5,618,500	11,121,665
流動資産合計	2,816,552,373	6,498,597,146
資産合計	2,816,552,373	6,498,597,146
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	134	6,100
未払金	26,075,255	307,456,138
未払解約金	40,000	10,011,000
流動負債合計	26,115,389	317,473,238
負債合計	26,115,389	317,473,238
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,288,622,228
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,501,814,756
元本等合計		2,790,436,984
純資産合計		2,790,436,984
負債純資産合計		2,816,552,373

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19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>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1. 1 期首	平成26年12月19日	平成27年12月19日
期首元本額	1,002,906,361円	1,288,622,228円
期中追加設定元本額	424,653,012円	1,695,507,019円
期中一部解約元本額	138,937,145円	122,769,305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)	- 円	1,071,680,040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)	- 円	109,360,983円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,578,317円	1,488,344円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	- 円	23,511円
iFree 外国REITイ ンデックス	- 円	45,690,995円
iFree 8資産バランス	- 円	51,307,248円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	1,046,671,568円	1,275,948,091円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,586,968円	3,847,988円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,599,958円	5,708,895円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	735,980円	946,555円

ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	231,449,437円	278,156,453円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	- 円	17,200,839円
計	1,288,622,228円	2,861,359,942円
2. 期末日における受益権の総数	1,288,622,228口	2,861,359,942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27年12月19日 至 平成28年12月19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。 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28年12月19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27年12月18日現在	平成28年12月19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	18,776	-
投資証券	11,134,703	78,564,867
合計	11,115,927	78,564,867

## （注）

「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年12月1日から平成27年12月18日まで、及び平成28年12月1日から平成28年12月19日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	平成27年12月18日 現在				平成28年12月19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	988,014	-	987,880	134	78,779,958	-	78,773,858	6,100
アメリカ・ドル	-	-	-	-	52,932,825	-	52,929,000	3,825

オーストラリア・ドル	610,533	-	610,470	63	-	-	-	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	1,675,511	-	1,675,420	91
シンガポール・ドル	172,590	-	172,560	30	4,399,180	-	4,398,840	340
ニュージーランド・ドル	204,891	-	204,850	41	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	17,196,993	-	17,196,798	195
香港・ドル	-	-	-	-	2,575,449	-	2,573,800	1,649
合計	988,014	-	987,880	134	78,779,958	-	78,773,858	6,100

## (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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1口当たり純資産額	2.1654円	2.1602円
(1万口当たり純資産額)	(21,654円)	(21,602円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,500	106,190.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	3,600	35,424.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	4,582	124,126.380	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,200	102,024.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,600	1,141,338.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,047	2,727,870.630	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,400	920,116.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	7,855	346,955.350	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	29,377	766,445.930	
		VORNADO REALTY TRUST	8,664	895,424.400	
		MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	7,500	80,175.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1,100	21,637.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,600	33,696.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	800	16,944.000	
		CARE CAPITAL PROPERTIES INC	4,069	98,917.390	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	2,200	103,422.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	17,500	1,120,875.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	7,500	146,625.000	
		EPR PROPERTIES	3,100	215,822.000	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	900	11,943.000	
		CITY OFFICE REIT INC	700	8,841.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	8,600	68,972.000	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2,629	51,160.340	
		CHATHAM LODGING TRUST	1,700	36,023.000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,700	72,009.000	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,100	49,170.000	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,400	150,096.000	
		FOREST CITY REALTY TRUST- A	11,000	226,380.000	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	5,500	113,355.000	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	500	11,195.000	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	1,113	15,559.740			
HOST HOTELS & RESORTS INC	37,300	709,073.000			
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	10,908	217,505.520			
GRAMERCY PROPERTY TRUST	19,487	168,172.810			
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3,800	161,120.000			
CORESITE REALTY CORP	1,700	131,665.000			
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	6,100	208,864.000			

RLJ LODGING TRUST	6,000	146,580.000	
FARMLAND PARTNERS INC	500	5,365.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	6,500	119,925.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1,500	21,390.000	
CYRUSONE INC	3,600	159,624.000	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	1,600	27,456.000	
KIMCO REALTY CORP	21,400	545,914.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	7,150	203,703.500	
WHITESTONE REIT	1,300	17,875.000	
TIER REIT INC	2,100	34,629.000	
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	1,900	2,983.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,100	11,671.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,800	294,000.000	
PARKWAY INC	2,188	43,803.760	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	7,000	141,820.000	
COLONY STARWOOD HOMES	2,200	63,866.000	
QUALITY CARE PROPERTIES	4,100	62,607.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	9,360	96,033.600	
CORECIVIC INC	5,424	130,176.000	
STORE CAPITAL CORP	7,900	190,548.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,400	68,068.000	
LIFE STORAGE INC	2,200	183,678.000	
SELECT INCOME REIT	3,200	78,144.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,000	85,180.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	2,782	24,175.580	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1,000	13,740.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6,200	123,566.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	3,000	69,480.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5,600	118,496.000	
STAG INDUSTRIAL INC	3,800	87,400.000	
VENTAS INC	17,879	1,092,943.270	
CARETRUST REIT INC	2,903	44,212.690	
NEW YORK REIT INC	7,700	73,997.000	
GEO GROUP INC/THE	3,600	124,560.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13,200	322,212.000	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	3,600	67,608.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	3,300	77,946.000	
UMH PROPERTIES INC	1,000	13,770.000	
IRON MOUNTAIN INC	12,300	394,338.000	

TERRENO REALTY CORP	2,300	65,596.000	
VEREIT INC	49,108	408,578.560	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	24,400	257,908.000	
SUN COMMUNITIES INC	3,300	246,015.000	
ACADIA REALTY TRUST	4,111	133,607.500	
ALEXANDER'S INC	200	86,496.000	
PROLOGIS INC	26,646	1,398,382.080	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,000	431,880.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	8,400	131,880.000	
SAUL CENTERS INC	600	39,858.000	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,645	88,987.800	
MACK-CALI REALTY CORP	4,300	120,056.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,400	360,052.000	
COUSINS PROPERTIES INC	17,207	140,925.330	
DDR CORP	15,456	232,458.240	
DUKE REALTY CORP	17,900	468,622.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,600	116,016.000	
EQUITY ONE INC	4,700	141,235.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,167	718,909.000	
FELCOR LODGING TRUST INC	6,500	52,715.000	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5,900	162,604.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,600	504,936.000	
GETTY REALTY CORP	1,103	27,387.490	
WELLTOWER INC	18,300	1,192,794.000	
HCP INC	23,600	687,704.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,000	249,250.000	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	8,300	253,648.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,600	165,816.000	
EQUITY COMMONWEALTH	6,275	187,371.500	
KILROY REALTY CORP	4,400	328,064.000	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,400	164,322.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	7,400	292,522.000	
LTC PROPERTIES INC	2,000	92,740.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	10,200	108,936.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,728	553,954.880	
MACERICH CO/THE	6,100	425,597.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,800	269,762.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	2,000	146,700.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,400	313,390.000	

REALTY INCOME CORP	13,017	722,052.990	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,300	129,903.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3,100	59,799.000	
PUBLIC STORAGE	7,100	1,552,983.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,000	114,120.000	
REGENCY CENTERS CORP	5,000	338,650.000	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	3,500	57,365.000	
ISTAR INC	3,200	39,648.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4,600	160,264.000	
SL GREEN REALTY CORP	5,100	558,909.000	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	11,400	201,210.000	
TAUBMAN CENTERS INC	3,000	222,150.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	1,500	36,240.000	
UDR INC	13,500	475,335.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	600	38,226.000	
WP CAREY INC	5,400	322,110.000	
WASHINGTON REIT	3,800	123,386.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5,900	207,090.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3,600	26,892.000	
AGREE REALTY CORP	1,200	53,544.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9,850	298,258.000	
CUBESMART	9,100	236,873.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	10,026	156,706.380	
DIGITAL REALTY TRUST INC	8,000	756,720.000	
CEDAR REALTY TRUST INC	3,400	21,624.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,000	445,200.000	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2,600	27,092.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,075	44,197.500	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	5,400	36,504.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	4,250	100,725.000	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	3,500	49,525.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	700	17,472.000	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	6,700	324,883.000	
EDUCATION REALTY TRUST INC	3,500	143,255.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,100	20,834.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	9,642	108,954.600	
NORTHSTAR REALTY FINANCE	8,650	130,874.500	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,649	33,483.360	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	14,800	180,264.000	



	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,400	69,498.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	7,300	266,596.000	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	4,600	215,924.000	
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	12,000	181,680.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	24,900	20,667.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 37,893,980.600 (4,457,468,938)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	82,250	46,018.870	
	MUCKLOW ( A & J ) GROUP PLC	2,550	11,857.500	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	20,650	10,996.120	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	22,850	24,335.250	
	REGIONAL REIT LTD	8,400	8,904.000	
	NEWRIVER REIT PLC	10,800	35,775.000	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	59,250	22,165.420	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	40,350	415,605.000	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	34,350	37,647.600	
	SEGRO PLC	41,750	183,491.250	
	HAMMERSON PLC	39,500	218,632.500	
	BRITISH LAND CO PLC	51,550	324,249.500	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	17,350	112,167.750	
	INTU PROPERTIES PLC	45,400	123,942.000	
	DERWENT LONDON PLC	5,600	152,040.000	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	27,550	30,305.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	5,450	40,684.250	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	9,900	32,373.000	
	SHAFTESBURY PLC	14,000	124,460.000	
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	4,400	7,832.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	7,100	46,292.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	31,650	47,158.500	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	22,450	12,684.250	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	53,000	71,391.000	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 2,141,007.760 (314,535,450)	
イスラエル・ シュケル			イスラエル・シュケル	
	REIT 1 LTD	5,790	62,184.600	

イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 62,184.600 (1,887,925)
オーストラリア・ドル	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	9,000	22,320.000
	CROMWELL PROPERTY GROUP	61,500	58,425.000
	GENERATION HEALTHCARE REIT	5,500	9,460.000
	VIVA ENERGY REIT	20,000	46,600.000
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	8,500	34,510.000
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	34,500	75,555.000
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	9,500	30,305.000
	NATIONAL STORAGE REIT	23,000	34,960.000
	INDUSTRIA REIT	6,500	13,650.000
	GDI PROPERTY GROUP	21,000	20,685.000
	360 CAPITAL OFFICE FUND	2,500	5,400.000
	SCENTRE GROUP	268,000	1,168,480.000
	ARENA REIT	10,000	18,350.000
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	6,500	17,680.000
	BWP TRUST	22,500	65,475.000
	DEXUS PROPERTY GROUP	48,500	444,260.000
	GPT GROUP	90,500	438,020.000
	INVESTA OFFICE FUND	31,000	141,360.000
	CHARTER HALL RETAIL REIT	16,000	66,720.000
	MIRVAC GROUP	186,500	389,785.000
	STOCKLAND	121,000	528,770.000
	WESTFIELD CORP	96,500	862,710.000
	ABACUS PROPERTY GROUP	12,000	35,040.000
	GOODMAN GROUP	80,000	556,000.000
	VICINITY CENTRES	164,500	478,695.000
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	2,500	16,400.000
CHARTER HALL GROUP	20,000	91,800.000	
ALE PROPERTY GROUP	8,500	36,295.000	
ASPEN GROUP	3,000	3,030.000	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	8,000	21,600.000	
360 CAPITAL GROUP LTD	9,000	7,740.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 5,740,080.000 (492,785,868)
カナダ・ドル			カナダ・ドル

	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3,500	42,840.000	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	2,600	23,972.000	
	SLATE RETAIL REIT - U	800	11,704.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,500	17,580.000	
	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	700	7,210.000	
	SLATE OFFICE REIT	1,000	7,720.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1,600	15,952.000	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	500	13,160.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,100	49,192.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1,100	8,976.000	
	ONEREIT	1,000	3,520.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,700	11,985.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	2,200	29,260.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	5,200	27,352.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	700	9,457.000	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ES	1,800	31,932.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1,400	20,930.000	
	PLAZA RETAIL REIT	2,300	11,040.000	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	3,000	95,160.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,200	96,096.000	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1,700	76,313.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	4,290	61,647.300	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7,066	154,745.400	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	1,300	18,486.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,000	206,480.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,500	47,775.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,100	52,030.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1,200	22,620.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1,900	25,707.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,000	70,200.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 1,271,041.700 (112,093,168)	
	シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	37,728	47,160.000	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	23,800	30,464.000	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	87,700	82,876.500	
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	25,200	32,004.000	

	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	52,500	48,562.500	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	107,500	160,712.500	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	118,800	274,428.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	135,700	258,508.500	
	SUNTEC REIT	127,800	210,870.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	70,200	70,200.000	
	KEPPEL REIT	84,700	87,241.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	25,960	32,579.800	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	44,300	51,388.000	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	47,479	25,163.870	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	32,300	42,151.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	27,300	52,006.500	
	STARHILL GLOBAL REIT	64,800	48,276.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	33,200	45,484.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	18,600	44,268.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	85,700	32,137.500	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	56,980	94,586.800	
	CACHE LOGISTICS TRUST	39,300	32,029.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	85,300	119,846.500	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	35,800	21,480.000	
	SPH REIT	34,400	32,508.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	30,600	19,584.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	29,600	15,244.000	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	35,500	24,850.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	52,173	33,912.450	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	22,150	15,172.750	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 2,085,696.170 (169,921,667)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	17,000	29,750.000	
	INVESTORE PROPERTY LTD	10,250	13,837.500	
	ARGOSY PROPERTY LTD	36,500	36,135.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	61,500	82,410.000	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	21,000	31,710.000	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	15,500	30,690.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	46,500	54,637.500	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	48,000	56,400.000	

ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 335,570.000 (27,540,230)
ユーロ			ユーロ
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,950	55,588.500
	HAMBORNER REIT AG	3,700	31,757.100
	WERELDHAVE NV	1,950	79,589.250
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,000	1,084,000.000
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	2,450	86,399.250
	NSI NV	6,450	23,007.150
	VASTNED RETAIL NV	900	31,275.000
	ICADE	2,250	149,220.000
	ALTAREA	150	27,060.000
	GECINA SA	2,050	261,375.000
	KLEPIERRE	10,450	375,938.750
	FONCIERE DES REGIONS	2,500	200,825.000
	MERCIALYS	2,800	51,086.000
	AEDIFICA	650	45,292.000
	COFINIMMO	1,000	104,500.000
	BEFIMMO	1,100	56,815.000
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	550	12,732.500
	RETAIL ESTATES	300	21,600.000
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	750	61,230.000
	WERELDHAVE BELGIUM NV	100	9,980.000
	XIOR STUDENT HOUSING NV	150	5,087.250
	MONTEA	300	12,754.500
	BENI STABILI SPA	45,350	24,715.750
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	15,400	10,626.000	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4,350	29,841.000	
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	5,200	59,072.000	
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	2,800	37,240.000	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	23,650	239,338.000	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	15,150	17,574.000	
GREEN REIT PLC	31,400	41,134.000	
HIBERNIA REIT PLC	32,850	39,091.500	
ユーロ 小計			ユーロ 3,285,744.500 (404,179,431)
香港・ドル			香港・ドル
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	47,000	196,930.000

	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	49,000	223,930.000	
	FORTUNE REIT	65,000	560,950.000	
	PROSPERITY REIT	54,000	164,160.000	
	LINK REIT	112,000	5,622,400.000	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	34,000	107,440.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	38,000	77,900.000	
	CHAMPION REIT	103,000	437,750.000	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 7,391,460.000 (111,980,619)	
投資証券 合計			6,092,393,296 [6,092,393,296]	
合計			6,092,393,296 [6,092,393,296]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 159銘柄	100%	73.2%
イギリス・ポンド	投資証券 24銘柄	100%	5.2%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	100%	0.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	100%	8.1%
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	100%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券 30銘柄	100%	2.8%
ニュージーランド・ドル	投資証券 8銘柄	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 31銘柄	100%	6.6%
香港・ドル	投資証券 8銘柄	100%	1.8%

## 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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	250,562,351	84,027,735
国債証券	10,296,201,200	11,610,339,360
地方債証券	1,769,070,102	1,235,850,800
特殊債券	1,390,446,950	1,029,950,700
社債券	1,125,479,038	916,698,400
未収入金	-	105,201,200
未収利息	53,872,764	52,041,502
前払費用	2,074,447	1,193,873
流動資産合計	14,887,706,852	15,035,303,570
資産合計	14,887,706,852	15,035,303,570
負債の部		
流動負債		
未払金	-	104,477,000
未払解約金	39,655,000	33,763,707
流動負債合計	39,655,000	138,240,707
負債合計	39,655,000	138,240,707
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,066,650,337	11,776,318,682
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,781,401,515	3,120,744,181
元本等合計	14,848,051,852	14,897,062,863
純資産合計	14,848,051,852	14,897,062,863
負債純資産合計	14,887,706,852	15,035,303,570

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1. 1 期首	平成26年12月19日	平成27年12月19日
期首元本額	12,150,667,512円	12,066,650,337円
期中追加設定元本額	2,076,977,956円	1,822,199,066円
期中一部解約元本額	2,160,995,131円	2,112,530,721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	- 円	34,845円
iFree 日本債券インデックス	- 円	43,708,353円
iFree 8資産バランス	- 円	87,248,594円
ダイワ・ライフ・バランス30	4,100,520,552円	4,310,465,771円
ダイワ・ライフ・バランス50	2,089,147,275円	2,079,954,504円
ダイワ・ライフ・バランス70	653,033,981円	662,333,867円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	503,171,259円	508,103,224円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	401,470,589円	413,870,204円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	120,496,806円	120,775,083円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	56,509,188円	62,143,213円



DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	32,382,573円	38,460,348円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,488,031円	2,109,162円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	2,996,546,406円	2,476,281,789円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	268,839,442円	238,982,327円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	309,835,817円	271,158,712円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	533,208,418円	460,688,686円
計	12,066,650,337円	11,776,318,682円
2. 期末日における受益権の総数	12,066,650,337口	11,776,318,682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27年12月19日 至 平成28年12月19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28年12月19日現在
-----	---------------

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年12月18日現在	平成28年12月19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	75,549,370	120,367,060
地方債証券	275,274	2,089,500
特殊債券	510,500	1,477,700
社債券	50,946	482,300
合計	74,712,650	124,416,560

## (注)

「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成27年12月1日から平成27年12月18日まで、及び平成28年12月1日から平成28年12月19日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	平成27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1口当たり純資産額	1.2305円	1.2650円
(1万口当たり純資産額)	(12,305円)	(12,650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 6 2 2年国債	124,000,000	124,534,440	
	3 6 4 2年国債	20,000,000	20,093,800	
	3 6 5 2年国債	53,000,000	53,248,040	
	3 6 6 2年国債	80,000,000	80,388,800	
	3 6 8 2年国債	133,000,000	133,694,260	
	3 7 0 2年国債	10,000,000	10,056,200	
	1 1 4 5年国債	62,000,000	62,548,700	
	1 1 6 5年国債	163,000,000	164,240,430	
	1 1 9 5年国債	21,000,000	21,139,440	
	1 2 0 5年国債	10,000,000	10,096,500	
	1 2 1 5年国債	35,000,000	35,241,150	
	1 2 2 5年国債	15,000,000	15,106,050	
	1 2 3 5年国債	80,000,000	80,572,800	
	1 2 4 5年国債	110,000,000	110,790,900	
	1 2 5 5年国債	180,000,000	181,353,600	
	1 2 6 5年国債	124,000,000	124,969,680	
	1 2 7 5年国債	159,000,000	160,286,310	
	1 2 8 5年国債	147,000,000	148,193,640	
	1 2 9 5年国債	135,000,000	136,124,550	
	1 4 0年国債	24,000,000	35,459,760	
	2 4 0年国債	23,000,000	32,897,820	
	3 4 0年国債	19,000,000	27,311,930	
	4 4 0年国債	30,000,000	43,450,200	
	5 4 0年国債	35,000,000	48,758,500	
	6 4 0年国債	28,000,000	38,322,760	
	7 4 0年国債	31,000,000	40,577,450	
	8 4 0年国債	23,000,000	27,899,000	
	9 4 0年国債	35,000,000	30,726,500	
	2 9 6 10年国債	35,000,000	36,040,200	
	2 9 7 10年国債	20,000,000	20,633,400	
	2 9 8 10年国債	61,000,000	62,809,260	
	3 0 0 10年国債	8,000,000	8,299,920	
	3 0 1 10年国債	35,000,000	36,446,550	
3 0 2 10年国債	54,000,000	56,096,820		
3 0 5 10年国債	100,000,000	104,318,000		

306	10年国債	10,000,000	10,493,200	
308	10年国債	100,000,000	104,929,000	
309	10年国債	103,000,000	107,354,840	
310	10年国債	30,000,000	31,241,400	
311	10年国債	42,000,000	43,421,700	
312	10年国債	94,000,000	98,864,500	
313	10年国債	75,000,000	79,423,500	
314	10年国債	77,000,000	80,886,190	
315	10年国債	90,000,000	95,175,900	
316	10年国債	56,000,000	58,968,000	
317	10年国債	40,000,000	42,239,200	
318	10年国債	33,000,000	34,690,260	
319	10年国債	129,000,000	136,533,600	
320	10年国債	35,000,000	36,868,650	
321	10年国債	65,000,000	68,606,200	
322	10年国債	33,000,000	34,657,260	
324	10年国債	88,000,000	92,121,920	
325	10年国債	137,000,000	143,670,530	
328	10年国債	60,000,000	62,364,000	
329	10年国債	45,000,000	47,415,150	
330	10年国債	81,000,000	85,459,050	
331	10年国債	63,000,000	65,617,020	
332	10年国債	118,000,000	122,996,120	
333	10年国債	153,000,000	159,476,490	
334	10年国債	156,000,000	162,711,120	
335	10年国債	55,000,000	56,976,150	
336	10年国債	48,000,000	49,779,840	
337	10年国債	65,000,000	66,373,450	
338	10年国債	145,000,000	149,289,100	
339	10年国債	137,000,000	141,115,480	
340	10年国債	135,000,000	139,114,800	
341	10年国債	136,000,000	138,982,480	
342	10年国債	40,000,000	40,146,800	
343	10年国債	152,000,000	152,573,040	
344	10年国債	180,000,000	180,522,000	
2	30年国債	9,000,000	11,555,010	
3	30年国債	4,000,000	5,097,080	
4	30年国債	8,000,000	10,887,360	
5	30年国債	8,000,000	10,155,760	

6	30年国債	9,000,000	11,723,310	
7	30年国債	12,000,000	15,523,680	
8	30年国債	5,000,000	6,107,100	
9	30年国債	11,000,000	12,759,340	
10	30年国債	15,000,000	16,677,750	
11	30年国債	9,000,000	10,877,850	
12	30年国債	11,000,000	14,001,130	
13	30年国債	11,000,000	13,845,040	
14	30年国債	22,000,000	29,144,720	
15	30年国債	21,000,000	28,210,980	
16	30年国債	26,000,000	34,990,020	
17	30年国債	17,000,000	22,613,230	
18	30年国債	20,000,000	26,282,400	
19	30年国債	15,000,000	19,721,400	
20	30年国債	16,000,000	21,633,440	
21	30年国債	16,000,000	21,069,600	
22	30年国債	17,000,000	23,029,220	
23	30年国債	16,000,000	21,703,680	
24	30年国債	15,000,000	20,373,600	
25	30年国債	17,000,000	22,481,140	
26	30年国債	32,000,000	42,979,200	
27	30年国債	26,000,000	35,574,240	
28	30年国債	34,000,000	46,744,220	
29	30年国債	38,000,000	51,705,460	
30	30年国債	40,000,000	53,820,000	
31	30年国債	38,000,000	50,574,580	
32	30年国債	42,000,000	57,030,120	
33	30年国債	55,000,000	71,450,500	
34	30年国債	45,000,000	60,753,150	
35	30年国債	53,000,000	69,362,160	
36	30年国債	59,000,000	77,448,120	
37	30年国債	57,000,000	73,772,820	
38	30年国債	35,000,000	44,573,200	
39	30年国債	37,000,000	48,106,290	
40	30年国債	29,000,000	37,020,820	
41	30年国債	29,000,000	36,327,140	
42	30年国債	33,000,000	41,402,790	
43	30年国債	37,000,000	46,496,050	
44	30年国債	32,000,000	40,277,120	

4 5	3 0 年国債	40,000,000	48,339,600	
4 6	3 0 年国債	43,000,000	52,032,150	
4 7	3 0 年国債	44,000,000	54,442,080	
4 8	3 0 年国債	45,000,000	53,433,450	
4 9	3 0 年国債	39,000,000	46,362,810	
5 0	3 0 年国債	44,000,000	45,342,880	
5 1	3 0 年国債	40,000,000	35,912,400	
5 2	3 0 年国債	47,000,000	44,685,250	
4 0	2 0 年国債	51,000,000	53,231,760	
4 1	2 0 年国債	40,000,000	41,495,200	
4 2	2 0 年国債	22,000,000	23,367,300	
4 3	2 0 年国債	14,000,000	15,176,000	
4 4	2 0 年国債	32,000,000	34,718,720	
4 5	2 0 年国債	20,000,000	21,634,200	
4 6	2 0 年国債	19,000,000	20,542,610	
4 7	2 0 年国債	23,000,000	24,991,570	
4 8	2 0 年国債	9,000,000	9,933,750	
4 9	2 0 年国債	4,000,000	4,372,720	
5 0	2 0 年国債	30,000,000	32,539,500	
5 1	2 0 年国債	25,000,000	27,341,500	
5 2	2 0 年国債	19,000,000	20,965,170	
5 3	2 0 年国債	13,000,000	14,414,660	
5 4	2 0 年国債	14,000,000	15,593,620	
5 5	2 0 年国債	41,000,000	45,421,030	
5 6	2 0 年国債	12,000,000	13,359,360	
5 7	2 0 年国債	24,000,000	26,586,480	
5 8	2 0 年国債	35,000,000	38,956,400	
5 9	2 0 年国債	3,000,000	3,314,790	
6 1	2 0 年国債	40,000,000	42,630,400	
6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,864,320	
6 3	2 0 年国債	30,000,000	33,573,000	
6 4	2 0 年国債	35,000,000	39,553,850	
6 5	2 0 年国債	42,000,000	47,600,280	
6 6	2 0 年国債	30,000,000	33,790,200	
6 7	2 0 年国債	19,000,000	21,583,620	
6 8	2 0 年国債	25,000,000	28,942,000	
6 9	2 0 年国債	12,000,000	13,805,400	
7 0	2 0 年国債	18,000,000	21,190,500	
7 1	2 0 年国債	17,000,000	19,758,930	

7 2	2 0 年国債	53,000,000	61,456,680	
7 3	2 0 年国債	30,000,000	34,701,000	
7 4	2 0 年国債	22,000,000	25,622,960	
7 5	2 0 年国債	14,000,000	16,369,640	
7 6	2 0 年国債	25,000,000	28,820,750	
7 8	2 0 年国債	17,000,000	19,668,830	
7 9	2 0 年国債	14,000,000	16,316,440	
8 0	2 0 年国債	20,000,000	23,478,400	
8 1	2 0 年国債	39,000,000	45,643,650	
8 2	2 0 年国債	28,000,000	33,013,680	
8 3	2 0 年国債	25,000,000	29,590,250	
8 4	2 0 年国債	27,000,000	31,715,820	
8 5	2 0 年国債	31,000,000	36,847,220	
8 6	2 0 年国債	6,000,000	7,242,120	
8 7	2 0 年国債	20,000,000	23,956,400	
8 8	2 0 年国債	33,000,000	39,998,310	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	18,039,300	
9 0	2 0 年国債	37,000,000	44,651,600	
9 1	2 0 年国債	12,000,000	14,597,880	
9 2	2 0 年国債	45,000,000	54,041,850	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	21,511,440	
9 4	2 0 年国債	29,000,000	34,951,960	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	36,893,400	
9 6	2 0 年国債	23,000,000	27,806,770	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	30,598,750	
9 8	2 0 年国債	34,000,000	41,252,540	
9 9	2 0 年国債	43,000,000	52,326,270	
1 0 0	2 0 年国債	35,000,000	43,124,200	
1 0 1	2 0 年国債	18,000,000	22,577,940	
1 0 2	2 0 年国債	10,000,000	12,585,300	
1 0 3	2 0 年国債	21,000,000	26,191,200	
1 0 4	2 0 年国債	24,000,000	29,388,480	
1 0 5	2 0 年国債	38,000,000	46,662,100	
1 0 6	2 0 年国債	16,000,000	19,832,320	
1 0 7	2 0 年国債	43,000,000	52,944,180	
1 0 8	2 0 年国債	43,000,000	51,929,380	
1 0 9	2 0 年国債	35,000,000	42,364,000	
1 1 0	2 0 年国債	22,000,000	27,157,680	
1 1 1	2 0 年国債	35,000,000	43,720,250	

1 1 2	20年国債	29,000,000	35,870,390	
1 1 3	20年国債	66,000,000	81,842,640	
1 1 4	20年国債	45,000,000	55,937,250	
1 1 5	20年国債	22,000,000	27,626,280	
1 1 6	20年国債	27,000,000	33,967,080	
1 1 7	20年国債	37,000,000	46,069,810	
1 1 8	20年国債	13,000,000	16,043,300	
1 1 9	20年国債	13,000,000	15,702,310	
1 2 0	20年国債	70,000,000	82,714,800	
1 2 1	20年国債	56,000,000	68,508,160	
1 2 2	20年国債	10,000,000	12,100,300	
1 2 3	20年国債	42,000,000	52,614,660	
1 2 4	20年国債	25,000,000	30,979,500	
1 2 5	20年国債	25,000,000	31,726,750	
1 2 6	20年国債	21,000,000	26,072,340	
1 2 7	20年国債	23,000,000	28,219,620	
1 2 8	20年国債	32,000,000	39,303,680	
1 2 9	20年国債	28,000,000	33,999,840	
1 3 0	20年国債	28,000,000	34,027,560	
1 3 1	20年国債	33,000,000	39,636,630	
1 3 2	20年国債	25,000,000	30,066,000	
1 3 3	20年国債	40,000,000	48,680,400	
1 3 4	20年国債	25,000,000	30,466,250	
1 3 5	20年国債	20,000,000	24,081,600	
1 3 6	20年国債	20,000,000	23,772,600	
1 3 7	20年国債	18,000,000	21,683,160	
1 3 8	20年国債	24,000,000	28,201,920	
1 3 9	20年国債	32,000,000	38,075,200	
1 4 0	20年国債	65,000,000	78,330,200	
1 4 1	20年国債	48,000,000	57,903,840	
1 4 2	20年国債	20,000,000	24,430,200	
1 4 3	20年国債	48,000,000	57,177,600	
1 4 4	20年国債	24,000,000	28,220,400	
1 4 5	20年国債	65,000,000	78,501,150	
1 4 6	20年国債	62,000,000	74,886,080	
1 4 7	20年国債	74,000,000	88,202,820	
1 4 8	20年国債	59,000,000	69,356,860	
1 4 9	20年国債	63,000,000	74,028,780	
1 5 0	20年国債	61,000,000	70,639,830	



	1 5 1	2 0 年国債	65,000,000	72,994,350	
	1 5 2	2 0 年国債	61,000,000	68,424,310	
	1 5 3	2 0 年国債	65,000,000	73,991,450	
	1 5 4	2 0 年国債	67,000,000	75,038,660	
	1 5 5	2 0 年国債	63,000,000	68,169,150	
	1 5 6	2 0 年国債	63,000,000	61,195,680	
	1 5 7	2 0 年国債	77,000,000	71,748,600	
	1 5 8	2 0 年国債	63,000,000	62,051,850	
国債証券 合計				11,610,339,360	
地方債証券	6 6 0	東京都公債	100,000,000	102,460,100	
	2 0 - 6	北海道公債	100,000,000	102,993,300	
	2 1 - 3 5	兵庫県公債	100,000,000	104,558,000	
	2 8 - 1	静岡県公債	100,000,000	99,009,400	
	2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	104,062,000	
	2 1 - 2	埼玉県公債	100,000,000	103,903,800	
	7 6	共同発行地方	100,000,000	103,716,700	
	1 1 6	共同発行地方	100,000,000	104,237,600	
	1 1 7	共同発行地方	100,000,000	103,807,000	
	2 1 - 6	大阪市公債	100,000,000	104,686,600	
	2 4 - 6	京都市 5 年	100,000,000	100,248,300	
	2 0 - 1	千葉市公債	100,000,000	102,168,000	
地方債証券 合計				1,235,850,800	
特殊債券	5	日本政策投資 C O	100,000,000	103,847,200	
	5 6	政保道路機構	100,000,000	101,929,100	
	9 8	政保道路機構	100,000,000	104,121,300	
	1 2 2	政保道路機構	100,000,000	103,520,400	
	1 9 0	政保道路機構	100,000,000	103,490,500	
	2	政保地方公営機	100,000,000	103,136,000	
	3	政保地方公共 6 年	100,000,000	100,515,500	
	3 6	地方公共団体	100,000,000	104,414,900	
	6 5	地方公共団体	100,000,000	102,632,000	
	3 0	国際協力銀行	100,000,000	102,343,800	
特殊債券 合計				1,029,950,700	
社債券	2 5	東日本高速道	100,000,000	100,547,400	
	2 7	東日本高速道	100,000,000	100,492,100	
	3 3	中日本高速道	100,000,000	104,741,200	
	1	明治安田 2 0 1 4 基	100,000,000	100,568,500	
	3 5	みずほ B K	100,000,000	100,535,000	
	6 2	トヨタファイナンス	100,000,000	100,311,300	

	164 オリックス	100,000,000	102,613,600	
	70 東日本旅客鉄道	100,000,000	104,029,700	
	15 NTTドコモ	100,000,000	102,859,600	
社債券	合計		916,698,400	
合計			14,792,839,260	

## 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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	67,296,408	305,109,849
コール・ローン	908,819,874	406,948,440
国債証券	161,356,997,118	157,499,588,611
派生商品評価勘定	6,356,867	12,516,966
未収利息	1,339,970,331	1,215,567,069
前払費用	32,904,500	30,994,874
流動資産合計	163,712,345,098	159,470,725,809
資産合計	163,712,345,098	159,470,725,809
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,352,798	-
未払解約金	157,445,000	169,556,883
流動負債合計	163,797,798	169,556,883
負債合計	163,797,798	169,556,883
純資産の部		
元本等		
元本	1 57,214,334,756	58,881,648,354
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金（ ）	106,334,212,544	100,419,520,572
元本等合計	163,548,547,300	159,301,168,926
純資産合計	163,548,547,300	159,301,168,926
負債純資産合計	163,712,345,098	159,470,725,809

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19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	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</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. 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>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1. 1 期首	平成26年12月19日	平成27年12月19日
期首元本額	58,254,679,882円	57,214,334,756円
期中追加設定元本額	4,817,133,621円	5,154,067,833円
期中一部解約元本額	5,857,478,747円	3,486,754,235円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス V A	1,684,686,820円	1,415,320,560円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	64,449,788円	47,463,120円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	411,121,336円	337,557,046円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	93,436,539円	78,887,258円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,331,954,560円	1,120,399,794円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマー ジ ングプラス(為替ヘッジな し)	- 円	61,945,238円

ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	- 円	128,166,415円
D - I ' s 外国債券インデッ クス	468,424円	850,783円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	- 円	17,978円
i F r e e 外国債券イン デックス	- 円	78,031,637円
i F r e e 8資産バランス	- 円	41,183,907円
DCダイワ外国債券インデッ クス	35,840,656,309円	37,918,206,213円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	476,769,144円	586,993,041円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	223,596,823円	260,230,135円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	139,390,945円	160,681,582円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	214,016,661円	251,367,408円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	171,481,074円	201,924,480円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	51,558,075円	60,112,470円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	11,210,231円	12,290,657円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	10,883,303円	15,684,745円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	637,363円	932,613円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,797,466,923円	1,682,564,879円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	191,978,114円	193,317,673円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	7,618,903,923円	7,166,577,248円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	530,924,035円	519,632,367円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	340,825,040円	334,968,931円

ダイワ・バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家専 用）	407,666,172円	393,370,357円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	72,906,868円	103,674,791円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	- 円	8,299,785円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,435,216,798円	5,596,721,299円
ダイワライフスタイル 2 5	30,315,983円	34,708,067円
ダイワライフスタイル 5 0	48,927,240円	55,186,341円
ダイワライフスタイル 7 5	12,886,265円	14,379,536円
計	57,214,334,756円	58,881,648,354円
2. 期末日における受益権の総数	57,214,334,756口	58,881,648,354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27年12月19日 至 平成28年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成28年12月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年12月18日現在	平成28年12月19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	972,980,918	1,427,392,937
合計	972,980,918	1,427,392,937

## (注)

「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年12月1日から平成27年12月18日まで、及び平成28年12月1日から平成28年12月19日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	平成27年12月18日 現在			平成28年12月19日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	827,870,541	-	827,874,610	4,069	325,129,314	-	337,646,280	12,516,966
アメリカ・ドル	279,397,830	-	278,337,600	1,060,230	210,905,918	-	220,040,040	9,134,122
イギリス・ポンド	129,731,121	-	128,122,020	1,609,101	8,712,427	-	9,103,460	391,033
オーストラリア・ドル	24,936,156	-	24,385,200	550,956	-	-	-	-
カナダ・ドル	47,120,801	-	45,000,360	2,120,441	10,550,171	-	11,101,860	551,689
シンガポール・ドル	5,128,268	-	5,084,620	43,648	2,763,722	-	2,847,250	83,528
スイス・フラン	4,060,768	-	4,187,100	126,332	1,669,693	-	1,719,900	50,207
スウェーデン・クローナ	10,658,979	-	10,682,720	23,741	3,224,261	-	3,308,540	84,279
デンマーク・クローネ	8,549,961	-	8,722,000	172,039	4,979,808	-	5,113,950	134,142
ノルウェー・クローネ	3,997,406	-	3,936,720	60,686	1,884,240	-	1,939,080	54,840
ポーランド・ズロチ	7,668,259	-	7,771,680	103,421	3,985,788	-	4,104,040	118,252
メキシコ・ペソ	15,288,813	-	14,813,220	475,593	6,030,456	-	6,377,490	347,034
ユーロ	284,583,615	-	290,455,470	5,871,855	66,843,880	-	68,276,100	1,432,220
南アフリカ・ランド	6,748,564	-	6,375,900	372,664	3,578,950	-	3,714,570	135,620
合計	827,870,541	-	827,874,610	4,069	325,129,314	-	337,646,280	12,516,966

## (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27年12月18日現在	平成28年12月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8585円 (28,585円)	2.7054円 (27,054円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20180215	3,839,000.000	3,946,184.880	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,960,000.000	3,074,907.200	
		4% United States Treasury Note/Bond 20180815	3,173,000.000	3,321,591.590	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,488,000.000	2,604,314.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	3,161,000.000	3,255,071.360	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,096,000.000	3,220,180.560	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,621,000.000	2,766,675.180	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,226,788.800	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	4,280,000.000	4,541,465.200	

3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,251,971.520	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,934,910.900	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,637,190.870	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20171130	883,000.000	894,169.950	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	924,000.000	940,742.880	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20180131	255,000.000	259,531.350	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,351,741.400	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	1,234,000.000	1,258,717.020	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20180331	1,300,000.000	1,328,834.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	260,000.000	265,270.200	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,671,866.380	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20180531	1,322,000.000	1,344,711.960	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,065,000.000	1,084,084.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,341,000.000	1,363,890.870	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,540,917.820	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20180831	3,444,000.000	3,460,393.440	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180930	2,835,000.000	2,841,860.700	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	1,320,000.000	1,332,368.400	
2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,143,225.380	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,165,000.000	2,169,481.550	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,861,000.000	1,864,256.750	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,426,000.000	1,423,547.280	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,201,947.840	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190228	1,843,000.000	1,843,423.890	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190331	300,000.000	300,924.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190430	559,000.000	557,099.400	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,401,926.610	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,368,400.400	
1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,353,034.080	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,784,000.000	1,756,883.200	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,458,953.850	
1% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,872,000.000	1,847,926.080	
1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,184,277.950	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	877,263.920	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,053,160.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20171130	2,336,000.000	2,329,879.680	
1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,331,582.010	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	1,913,000.000	1,908,810.530	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,868,241.600	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180131	2,153,000.000	2,149,964.270	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,355,536.440	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	3,850,000.000	3,779,314.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	3,447,000.000	3,434,866.560	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,943,242.560	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180331	2,315,000.000	2,305,138.100	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,139,781.200	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,511,842.400	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	4,218,000.000	4,189,317.600	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,423,561.590	
1% United States Treasury Note/Bond 20180531	3,407,000.000	3,400,049.720	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,432,329.350	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,693,000.000	1,698,485.320	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,141,143.560	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,848,626.550	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,697,000.000	1,702,023.120	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	3,768,000.000	3,792,115.200	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	2,014,942.930	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,896,630.450	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181031	3,611,000.000	3,610,422.240	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,337,120.800	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,130,005.910	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,638,000.000	2,637,261.360	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,511,929.370	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20181231	2,026,000.000	2,034,225.560	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,043,612.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,340,691.440	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190131	2,185,000.000	2,192,319.750	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,659,220.740	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,373,000.000	2,380,403.760	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,737,780.120	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190331	2,383,000.000	2,396,773.740	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,854,936.630	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,412,000.000	5,431,429.080	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190430	2,975,000.000	2,989,875.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,433,501.070	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,241,000.000	2,245,280.310	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,730,497.400	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2,885,000.000	2,897,838.250	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,497,232.350	
8.875% United States Treasury Note/Bond 20190215	904,000.000	1,051,144.080	

8.125% United States Treasury Note/Bond 20190815	724,000.000	849,309.920	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	800,188.800	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,685,065.760	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	811,875.600	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,093,792.950	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	844,200.000	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	940,141.090	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	894,166.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	926,846.820	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	595,942.160	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,343,575.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,241,000.000	1,626,963.410	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,926,000.000	2,394,846.180	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	721,011.640	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	668,472.320	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	1,019,000.000	1,263,794.370	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	849,000.000	910,348.740	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,335,301.570	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	760,000.000	936,456.800	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,465,225.300	

4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,144,305.800	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,790,449.200	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,791,736.470	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,749,358.650	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,242,927.500	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,656,659.550	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,509,988.200	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,442,170.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,614,625.320	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,853,000.000	1,800,875.110	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,602,386.700	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	3,030,000.000	2,798,477.700	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,026,000.000	2,008,738.480	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,998,000.000	3,774,951.580	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,314,000.000	3,597,214.440	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	3,974,050.560	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	3,924,445.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,357,000.000	3,482,618.940	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,339,237.480	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,857,890.620	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,662,000.000	5,621,913.040	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	3,689,360.730	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190831	2,989,000.000	2,998,923.480	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,296,472.520	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,424,730.360	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,631,198.750	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,185,502.100	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,152,855.530	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,813,178.590	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,566,898.720	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,856,216.480	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,316,350.000	
1% United States Treasury Note/Bond 20171215	1,517,000.000	1,517,819.180	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,171,693.650	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,206,226.040	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180115	1,547,000.000	1,545,112.660	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,917,148.090	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,352,660.990	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,518,161.550	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,269,106.250	



1% United States Treasury Note/Bond 20180215	1,961,000.000	1,960,078.330	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,762,294.640	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,772,820.000	
1% United States Treasury Note/Bond 20180315	2,081,000.000	2,079,439.250	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,763,633.280	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180415	2,083,000.000	2,072,980.770	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,830,462.460	
1% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,180,000.000	2,175,988.800	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,601,684.280	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	4,035,000.000	3,886,512.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,577,671.250	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,554,039.720	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,778,749.280	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,987,811.320	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20180615	2,196,000.000	2,194,528.680	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,986,685.230	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,806,669.320	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180715	2,189,000.000	2,177,967.440	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,115,876.500	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,151,065.220	

2% United States Treasury Note/Bond 20250815	6,143,000.000	5,871,786.550	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,354,153.750	
1% United States Treasury Note/Bond 20180815	14,000.000	13,955.620	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,395,122.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,822,284.080	
1% United States Treasury Note/Bond 20180915	2,179,000.000	2,170,567.270	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,402,660.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,827,683.200	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20181015	2,057,000.000	2,043,403.230	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,685,765.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,059,506.920	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,571,359.010	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,502,030.960	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,138,000.000	2,137,743.440	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20171130	2,277,000.000	2,276,544.600	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,064,049.280	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	2,687,000.000	2,644,169.220	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181215	2,151,000.000	2,149,558.830	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,023,494.370	
1% United States Treasury Note/Bond 20171231	2,276,000.000	2,276,796.600	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	2,492,000.000	2,467,453.800	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190115	2,146,000.000	2,137,351.620	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,055,883.820	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	4,943,803.120	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180131	2,329,000.000	2,322,525.380	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	2,065,000.000	2,039,745.050	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,478,561.410	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	2,970,293.440	
1% United States Treasury Note/Bond 20190315	2,100,000.000	2,083,830.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,197,817.600	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,262,000.000	2,153,491.860	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,912,150.140	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180331	700,000.000	698,222.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,017,996.420	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190415	1,125,000.000	1,111,860.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	5,529,000.000	5,077,557.150	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,386,447.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180430	4,300,000.000	4,278,328.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	1,980,244.800	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	2,964,352.230	

0.875% United States Treasury Note/Bond 20190515	2,507,000.000	2,475,161.100	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180531	4,000,000.000	3,985,440.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,627,208.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,388,275.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190615	2,100,000.000	2,070,873.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,000,000.000	992,140.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,402,325.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,818,110.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190715	2,500,000.000	2,455,175.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,071,920.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	2,848,136.400	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,500,000.000	2,452,625.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180831	2,200,000.000	2,182,554.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,546,783.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,770,000.000	1,757,344.500	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,549,669.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,587,763.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,248,104.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190915	2,600,000.000	2,555,800.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180930	3,000,000.000	2,973,840.000	

	1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,344,304.250	
	1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,911,741.560	
	1% United States Treasury Note/Bond 20191015	2,147,000.000	2,116,040.260	
	0.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	2,326,000.000	2,304,275.160	
	2% United States Treasury Note/Bond 20261115	2,200,000.000	2,086,546.000	
	1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,886,540.000	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,377,725.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,600,000.000	1,506,240.000	
	1% United States Treasury Note/Bond 20191115	1,400,000.000	1,377,740.000	
	1% United States Treasury Note/Bond 20181130	1,000,000.000	995,110.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 594,232,187.820 (69,899,532,253)	
イギリス・ボ ンド		イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	
	2% United Kingdom Gilt 20200722	2,380,000.000	2,509,472.000	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	2,121,000.000	2,241,048.600	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,568,896.700	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,182,000.000	1,407,762.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	945,000.000	948,969.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	60,000.000	58,752.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	400,000.000	351,320.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	200,000.000	189,300.000	

8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,464,117.200	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,403,381.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,431,008.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,906,240.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,762,504.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,155,631.500	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,967,773.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,798,558.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,666,000.000	2,471,177.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,565,009.600	
5% United Kingdom Gilt 20180307	1,604,000.000	1,699,117.200	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,666,000.000	2,478,341.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,500,000.000	2,055,300.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,373,000.000	2,111,811.300	
4.5% United Kingdom Gilt 20190307	1,573,000.000	1,724,637.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,737,796.200	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,232,000.000	1,439,345.600	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,870,000.000	2,585,462.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,428,000.000	1,565,088.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,244,000.000	2,016,275.200	

	3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	2,014,528.500	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,223,412.300	
	3.75% United Kingdom Gilt 20210907	1,633,000.000	1,869,785.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,182,000.000	1,716,973.200	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,354,772.600	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,156,000.000	2,665,894.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20180722	2,854,000.000	2,905,086.600	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,098,913.600	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,473,808.100	
	1.75% United Kingdom Gilt 20190722	2,161,000.000	2,245,927.300	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,842,000.000	2,057,329.800	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	2,750,367.600	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 77,990,894.100 (11,457,642,252)	
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	2,635,344.300	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,420,000.000	2,785,057.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,209,000.000	2,386,007.170	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,032,000.000	2,394,366.560	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	2,063,000.000	2,147,211.660	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,434,966.600	

	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,031,641.330	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,173,000.000	2,192,187.590	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,314,000.000	1,341,055.260	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,490,562.800	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	958,000.000	1,102,083.200	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20181021	1,197,000.000	1,228,133.970	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,191,896.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	1,511,000.000	1,545,284.590	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	863,000.000	885,317.180	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	500,809.840	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	1,495,000.000	1,475,669.650	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	412,000.000	385,347.720	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,592,000.000	1,569,409.520	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	978,000.000	911,906.760	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	682,000.000	578,022.280	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 37,212,280.980 (3,194,674,322)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 325,000.000	カナダ・ドル 357,041.750	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	606,919.380	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,373,948.930	



5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,657,783.190	
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,192,000.000	1,689,016.320	
4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	969,000.000	1,017,459.690	
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1,524,000.000	1,630,207.560	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,413,000.000	1,813,726.800	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,476,000.000	1,598,360.400	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	1,041,217.840	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,351,000.000	1,449,731.080	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,491,000.000	1,816,917.690	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,253,400.960	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180301	1,265,000.000	1,273,349.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180901	1,021,000.000	1,028,596.240	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,491,028.150	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190301	853,000.000	869,693.210	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,627,000.000	1,663,135.670	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	847,000.000	908,915.700	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,202,413.400	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	829,000.000	841,700.280	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,772,000.000	1,783,500.280	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	931,000.000	919,390.430	

	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,029,000.000	999,930.750	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,237,000.000	1,216,107.070	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180501	1,284,000.000	1,275,371.520	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,449,068.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180801	1,344,000.000	1,337,374.080	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	390,000.000	355,356.300	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20181101	800,000.000	795,320.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	340,000.000	326,386.400	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190201	400,000.000	397,156.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 37,439,524.070 (3,301,791,628)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	491,000.000	512,515.620	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	732,052.800	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	442,000.000	478,465.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	459,505.800	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	599,000.000	612,237.900	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	503,000.000	521,963.100	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	361,426.840	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	501,286.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	394,200.000	

	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20180401	504,000.000	498,657.600	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	503,029.500	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	238,000.000	254,612.400	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	126,812.500	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	270,000.000	270,027.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	224,000.000	222,028.800	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	225,859.200	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	228,000.000	224,388.480	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	241,842.500	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	190,000.000	183,741.400	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 7,324,652.940 (596,739,475)	
スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	404,000.000	514,489.960	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	497,000.000	720,406.470	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	605,000.000	630,652.000	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	517,000.000	565,975.410	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	407,000.000	451,261.250	
	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	362,000.000	404,868.040	
	スイス・フラン 小計		スイス・フラン 3,287,653.130 (376,765,049)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	

	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	8,095,000.000	9,834,615.500	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	8,385,000.000	9,321,017.550	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,602,560.450	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,165,000.000	9,768,116.100	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,663,361.750	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,495,000.000	6,452,998.300	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	6,080,000.000	6,293,833.600	
	スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 54,936,503.250 (691,101,211)	
デンマーク・ク ローネ	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	1,864,000.000	2,872,703.600	デンマーク・クローネ
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	19,548,872.560	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	9,738,396.240	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	8,650,000.000	10,035,384.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	5,846,000.000	6,415,283.480	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	7,863,000.000	8,775,501.150	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20181115	3,164,000.000	3,215,383.360	
	デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 60,601,524.390 (1,002,955,229)	
ノルウェー・ク ローネ	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	6,075,000.000	6,621,689.250	ノルウェー・クローネ

	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,698,000.000	7,464,452.140	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,824,000.000	5,005,141.200	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,513,181.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,436,079.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,140,000.000	3,095,569.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 30,136,112.490 (409,248,407)	
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	2,646,114.000	
	5.5% Poland Government Bond 20191025	1,912,000.000	2,079,300.000	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,078,000.000	2,019,192.600	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,115,789.050	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,071,272.600	
	Poland Government Bond 20181025	1,668,000.000	1,609,536.600	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	2,926,824.300	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	900,000.000	822,690.000	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	700,000.000	676,900.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	627,000.000	758,168.400	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,478,892.800	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	884,000.000	1,002,102.400	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,575,000.000	2,713,148.750	

	3.75% Poland Government Bond 20180425	1,720,000.000	1,766,096.000	
	2.5% Poland Government Bond 20180725	2,099,000.000	2,121,669.200	
	3.25% Poland Government Bond 20190725	1,840,000.000	1,888,944.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,570,297.910	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 33,266,938.610 (924,155,555)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	1,210,000.000	1,217,139.000	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	647,000.000	678,858.280	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	525,085.740	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	779,187.780	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,630,475.420	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,155,665.120	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,943,149.720	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,503,190.040	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	420,000.000	397,723.200	
	3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	1,595,000.000	1,596,116.500	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	842,625.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	694,800.880	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	577,045.140	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,044,000.000	1,034,363.880	

3.26% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180301	533,000.000	531,006.580	
3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	959,498.540	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	477,000.000	428,794.380	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	540,860.420	
3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	655,731.040	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	602,700.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,049,601.000	
4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	863,813.150	
3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	648,000.000	645,693.120	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	711,205.000	
3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	692,300.000	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,137,780.000	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	620,000.000	583,203.000	
3.759% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190315	768,000.000	770,734.080	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	686,591.100	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	450,000.000	441,994.500	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	50,000.000	48,315.000	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	349,785.920	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 26,275,032.530 (690,245,104)	
メキシコ・ペソ 5% Mexican Bonos 20191211	メキシコ・ペソ 15,647,000.000	メキシコ・ペソ 14,949,300.270	

	5.75% Mexican Bonos 20260305	7,590,000.000	6,790,393.500	
	8% Mexican Bonos 20231207	8,233,000.000	8,601,509.080	
	10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	25,779,252.120	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	8,568,000.000	8,617,266.000	
	7.75% Mexican Bonos 20171214	13,756,000.000	13,962,064.880	
	10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	8,505,406.420	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	9,534,627.960	
	8.5% Mexican Bonos 20181213	22,092,000.000	22,900,125.360	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	10,551,046.540	
	8% Mexican Bonos 20200611	12,728,000.000	13,229,355.920	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	23,826,000.000	23,481,952.560	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,150,616.300	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	11,399,000.000	11,158,025.140	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	14,654,000.000	14,851,535.920	
	4.75% Mexican Bonos 20180614	16,633,000.000	16,237,300.930	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	7,007,815.360	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 229,307,594.260 (1,320,811,743)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	445,824.000	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	407,376.000	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	291,245.310	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	412,196.010	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	199,186.000	
	0.25% Austria Government Bond 20191018	527,000.000	539,273.830	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	935,367.120	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	576,000.000	586,114.560	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	234,000.000	238,448.340	
	Austria Government Bond 20230715	300,000.000	299,541.000	



0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,440,396.410	
1% Belgium Government Bond 20310622	924,000.000	911,147.160	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	613,995.300	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,326,698.980	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	544,000.000	534,588.800	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	290,000.000	306,999.800	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	150,000.000	151,081.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,174,000.000	1,703,098.320	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,744,619.690	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,130,590.220	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,408,755.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,638,316.230	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,406,373.280	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,945,310.750	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,275,162.240	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,057,681.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	1,889,536.180	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	2,211,000.000	2,384,563.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,526,006.420	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	2,934,751.680	

3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,754,306.960	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,330,245.750	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,182,303.200	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	2,068,598.220	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,602,868.880	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,631,227.390	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,967,653.080	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,601,893.200	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,707,000.000	1,919,026.470	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,483,507.180	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,728,000.000	2,333,871.360	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,816,833.720	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,563,746.400	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	2,019,740.860	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,833,685.230	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,768,597.390	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,709,000.000	2,330,512.030	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,778,505.500	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,662,646.080	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,394,000.000	2,479,681.260	

1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,034,000.000	2,186,590.680	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,222,200.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	1,700,000.000	1,647,742.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20171215	733,000.000	739,003.270	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20180316	747,000.000	754,455.060	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20180615	1,500,000.000	1,518,000.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20180914	700,000.000	709,744.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20181214	500,000.000	508,000.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180223	1,190,000.000	1,208,445.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180413	1,392,000.000	1,411,474.080	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20181012	1,209,000.000	1,248,473.850	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190222	1,438,000.000	1,494,614.060	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190412	1,113,000.000	1,146,467.910	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,184,298.430	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,771,661.190	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,497,333.360	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,616,092.920	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,700,000.000	1,739,151.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	823,439.530	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	685,000.000	1,052,940.900	

6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,225,000.000	3,287,793.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	4,014,737.570	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,507,000.000	4,164,578.260	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,709,000.000	4,231,837.260	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,075,000.000	3,430,070.250	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,564,000.000	2,535,165.800	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,804,617.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,424,000.000	3,579,642.000	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,697,000.000	4,738,518.840	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,931,000.000	3,116,971.950	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	2,567,000.000	2,802,907.300	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,484,000.000	3,960,936.720	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	3,263,000.000	3,668,166.710	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,380,000.000	3,833,325.600	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,017,000.000	1,689,948.900	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,957,793.840	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,461,967.300	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,550,000.000	4,150,695.500	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,480,000.000	4,066,240.800	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,099,000.000	3,706,589.940	

2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	3,053,945.340	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180525	2,114,000.000	2,165,074.240	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,088,000.000	2,827,402.560	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,706,467.800	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181125	1,920,000.000	1,982,016.000	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,539,611.140	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190525	1,764,000.000	1,834,842.240	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,284,479.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,799,000.000	3,104,650.800	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2,322,000.000	2,394,028.440	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2,792,000.000	2,794,484.880	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3,070,000.000	3,116,295.600	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20180225	1,335,000.000	1,345,666.650	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,101,000.000	2,172,013.800	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,246,202.180	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	2,020,000.000	2,111,667.600	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20190225	1,592,000.000	1,614,272.080	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,737,000.000	2,685,681.250	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	879,000.000	853,482.630	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	257,000.000	244,568.910	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,170,000.000	2,195,041.800	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	1,600,000.000	1,519,520.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	1,100,000.000	1,104,488.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	805,686.040	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,899,163.980	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,121,740.300	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	982,762.130	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	1,544,000.000	1,659,552.960	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,347,000.000	1,511,791.980	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,316,467.500	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,349,000.000	2,154,447.430	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,714,211.730	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,641,361.960	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,464,964.000	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180115	1,477,000.000	1,508,622.570	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,551,338.500	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115	924,000.000	961,893.240	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,004,000.000	1,412,366.960	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,727,307.460	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,412,774.280	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180415	1,323,000.000	1,335,475.890	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,284,131.880	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	948,000.000	951,204.240	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	400,000.000	406,308.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,671,243.420	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,656,275.400	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,445,101.920	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,945,877.800	
0.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180115	1,376,000.000	1,389,677.440	
1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,484,621.900	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,512,696.530	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,229,000.000	1,260,056.830	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,668,999.710	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,465,000.000	1,359,417.450	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180515	1,258,000.000	1,264,843.520	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,535,055.120	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,591,000.000	1,624,029.160	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,546,518.080	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20181015	371,000.000	373,697.170	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	783,806.580	

2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,140,000.000	1,081,609.200	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,259,000.000	1,248,814.690	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,263,019.180	
0.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190415	812,000.000	813,965.040	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,667,655.540	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	890,662.080	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,218,000.000	1,148,245.140	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	673,568.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	358,000.000	352,690.860	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	448,000.000	393,514.240	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191015	358,000.000	357,684.960	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,654,000.000	3,563,260.400	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,144,668.220	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,455,000.000	2,097,731.700	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190201	2,074,000.000	2,263,273.240	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,178,241.110	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,098,000.000	2,840,796.900	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,390,000.000	2,905,953.200	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	3,127,531.960	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180201	2,480,000.000	2,609,158.400	



5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,734,000.000	2,380,487.220	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,101,000.000	2,585,238.480	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180801	2,187,000.000	2,351,396.790	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190301	2,708,000.000	2,977,473.080	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	2,531,000.000	2,815,383.160	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,675,055.180	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	1,893,000.000	2,588,014.950	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,888,217.600	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,514,417.660	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,538,027.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,437,363.520	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,716,465.710	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,440,716.960	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	2,078,275.680	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,395,713.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,810,000.000	2,307,170.800	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,594,000.000	1,921,567.000	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180601	1,770,000.000	1,863,845.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,363,000.000	1,826,842.530	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,665,402.840	

3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20181201	2,111,000.000	2,259,508.850	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,966,080.480	
2.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190501	1,100,000.000	1,164,372.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	1,901,000.000	2,212,326.770	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,223,816.240	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,706,246.370	
1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	1,246,000.000	1,292,438.420	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,588,547.920	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,777,468.880	
4% Belgium Government Bond 20220328	1,377,000.000	1,690,666.830	
4% Belgium Government Bond 20180328	966,000.000	1,024,104.900	
4% Belgium Government Bond 20190328	1,121,000.000	1,240,016.570	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	2,017,127.840	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,474,000.000	2,328,978.960	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,765,190.040	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	801,000.000	1,092,684.150	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,654,751.560	
4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	959,486.800	
3% Belgium Government Bond 20190928	1,123,000.000	1,235,232.620	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,538,017.620	

1.25% Belgium Government Bond 20180622	1,052,000.000	1,082,634.240	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	753,000.000	1,130,117.460	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,770,737.850	
3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	767,198.730	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	759,000.000	829,541.460	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	684,000.000	768,822.840	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	570,000.000	673,728.600	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,557,737.610	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	922,505.850	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	620,464.320	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	733,401.680	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	867,981.380	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	537,899.040	
2% IRISH TREASURY 20450218	531,000.000	552,829.410	
1% IRISH TREASURY 20260515	473,000.000	478,543.560	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,035,000.000	1,204,232.850	
6.25% Austria Government Bond 20270715	985,000.000	1,567,154.700	
4.65% Austria Government Bond 20180115	1,066,000.000	1,127,124.440	
3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,444,248.000	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,581,363.490	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,073,000.000	1,660,317.280	
4.35% Austria Government Bond 20190315	989,000.000	1,099,441.630	
4.85% Austria Government Bond 20260315	675,000.000	948,415.500	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	962,273.890	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	1,054,753.760	
3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	554,124.540	

1.95% Austria Government Bond 20190618	738,000.000	785,704.320	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	883,258.250	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,074,991.050	
2.4% Austria Government Bond 20340523	501,000.000	610,167.900	
1.15% Austria Government Bond 20181019	426,000.000	440,305.080	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,036,924.560	
4.375% Finland Government Bond 20190704	416,000.000	469,913.600	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	877,031.630	
3.375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	715,171.200	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	537,057.540	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	481,142.430	
1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	676,113.120	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	489,476.080	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	539,738.980	
1.125% Finland Government Bond 20180915	425,000.000	438,527.750	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	601,287.850	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,832,000.000	2,686,811.200	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,797,175.500	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,552,000.000	1,561,622.400	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180430	660,000.000	664,593.600	

2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,914,232.320	
1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,250,000.000	1,298,200.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,816,218.660	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190131	1,172,000.000	1,182,149.520	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,067,000.000	1,089,652.410	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	852,000.000	884,571.960	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	400,000.000	429,860.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,230,000.000	1,213,997.700	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	2,966,877.220	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,148,794.100	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,428,000.000	2,034,914.280	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	2,206,000.000	2,360,199.400	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,132,473.240	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,671,698.840	
4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,993,342.750	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,173,000.000	1,631,279.370	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,377,806.750	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,789,000.000	2,279,794.260	
4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,984,823.940	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	3,088,042.750	

	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,665,000.000	2,333,247.750	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,520,426.940	
	4.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180131	2,000,000.000	2,106,060.000	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,158,000.000	2,769,771.420	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,601,000.000	1,979,444.380	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,270,000.000	1,739,138.000	
	3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20181031	1,564,000.000	1,681,268.720	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,049,000.000	1,559,254.580	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190430	1,836,000.000	1,961,160.120	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,357,203.500	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,351,387.070	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,980,807.000	
	ユーロ 小計		ユーロ 510,766,611.610 (62,829,400,895)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20181221	4,178,000.000	4,179,086.280	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,618,032.000	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	15,434,000.000	16,946,532.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	5,406,423.000	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	6,122,000.000	5,770,168.660	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,270,196.800	

	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,320,326.540	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	4,639,000.000	4,426,116.290	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	10,852,000.000	9,846,236.640	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	8,621,000.000	7,713,898.380	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	7,862,000.000	7,035,782.420	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	6,544,000.000	5,935,277.120	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	5,943,000.000	5,316,964.380	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	3,166,000.000	2,975,090.200	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	1,579,000.000	1,474,975.480	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 96,235,106.190 (804,525,488)	
国債証券 合計			157,499,588,611 [157,499,588,611]	
合計			157,499,588,611 [157,499,588,611]	

- (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 239銘柄	100%	44.5%
イギリス・ポンド	国債証券 40銘柄	100%	7.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	100%	2.0%
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券 6銘柄	100%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.6%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100%	0.3%

ポーランド・ズロチ	国債証券	17銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券	32銘柄	100%	0.4%
メキシコ・ペソ	国債証券	17銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	288銘柄	100%	39.9%
南アフリカ・ランド	国債証券	15銘柄	100%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成28年12月30日

資産総額	29,316,545円
負債総額	3,468円
純資産総額（ - ）	29,313,077円
発行済数量	20,873,518口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.4043円

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

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

## (参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

資産総額	83,008,698,047円
負債総額	262,325,233円
純資産総額（ - ）	82,746,372,814円
発行済数量	39,937,993,438口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.0719円

## (参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

資産総額	283,851,487,716円
負債総額	4,724,939,792円
純資産総額（ - ）	279,126,547,924円
発行済数量	109,981,080,552口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.5380円

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

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

資産総額	6,377,585,114円
負債総額	47,961,689円
純資産総額（ - ）	6,329,623,425円
発行済数量	2,934,625,146口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.1569円

## (参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ B P I ）

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

資産総額	15,392,468,958円
負債総額	137,728,250円
純資産総額（ - ）	15,254,740,708円
発行済数量	12,033,258,837口

1 単位当たり純資産額 ( / )

1.2677円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

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

## 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成28年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に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。

平成28年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	68	219,503
追加型株式投資信託	664	12,714,360
株式投資信託 合計	732	12,933,863
単位型公社債投資信託	14	97,869
追加型公社債投資信託	14	2,167,293
公社債投資信託 合計	28	2,265,162
総合計	760	15,199,024

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第57期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第58期事業年度に係る中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

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



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

(単位:百万円)

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

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

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

	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	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

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

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

### (損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「投資有価証券売却益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

## (貸借対照表関係)

### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社項目

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

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

## 3 保証債務

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

## (損益計算書関係)

## 1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日

平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日
----------------------	------	--------	-------	----------------	----------------

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

平成27年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27年 3月31日	平成27年 6月24日

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

平成28年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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



## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に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27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,438	-	-	-
未収委託者報酬	10,295	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	6	1,591	3,790	84
合計	41,740	1,591	3,790	84

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,715	-	-	-
未収委託者報酬	9,896	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	1,115	4,570	1,712	141
合計	42,727	4,570	1,712	141

（有価証券関係）

## 1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成27年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成28年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	164	55	109
（2）その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他 証券投資信託	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,025百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（平成28年3月31日）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,021百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

### 4．減損処理を行った有価証券

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

## (退職給付関係)

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

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

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

#### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

### 3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

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

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（セグメント情報等）

#### [セグメント情報]

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

#### [関連情報]

##### 1. サービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

###### （1）営業収益

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

###### （2）有形固定資産

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

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）  
該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）  
該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

## （ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,834	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,749	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## （イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	978	長期差入保証金	971

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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



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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

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

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

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

当中間会計期間  
（平成28年9月30日）

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

## (2) 中間損益計算書

（単位：百万円）

当中間会計期間  
（自 平成28年4月1日  
至 平成28年9月30日）

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

### (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

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

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

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## （２）無形固定資産

定額法によっております。

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

## ３．引当金の計上基準

### （１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

### （２）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

### （３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

## ４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### （１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

### （２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## （中間貸借対照表関係）

### １ 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日現在)
有形固定資産	273百万円

### ２ 保証債務

当中間会計期間（平成28年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,554百万円に対して保証を行っております。

## 3 消費税等の取扱い

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

（中間損益計算書関係）

## 1 減価償却実施額

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

## 2 営業外収益の主要項目

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

## 3 営業外費用の主要項目

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

## 4 特別損失の主要項目

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

合計	2,608	-	-	2,608
----	-------	---	---	-------

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28年 6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払金及び(2) 未払費用



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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

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

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

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額 5,129百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額 1,021百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(セグメント情報等)

[ セグメント情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

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

[ 関連情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

該当事項はありません。

（1 株当たり情報）

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

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

(注2) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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（平成28年3月末日現在）

事業の内容

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

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 （平成28年3月 末日現在）	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注1）
第一生命保険株式会社	343,146	（注2）

（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。

### 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（平成28年3月末日現在）

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

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

### 第3 【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

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

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

- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載  
委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

**独立監査人の監査報告書**

平成28年 5月27日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年1月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2040の平成27年12月19日から平成28年12月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成28年12月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。



## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成28年11月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

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

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。