

【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】	2019年9月11日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【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】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D C ダイワ・ターゲットイヤー2040
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

DCダイワ・ターゲットイヤー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 <https://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】

2019年9月12日から2020年3月11日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

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

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

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

当ファンドは、積立投資専用です。

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

ロ．収益分配金は、自動的に再投資されます。

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

取得申込金額に利息は付きません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

- ・「為替ヘッジなし」...目論見書等において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの特色 >

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

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

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

〈2019年6月時点の基本配分比率〉

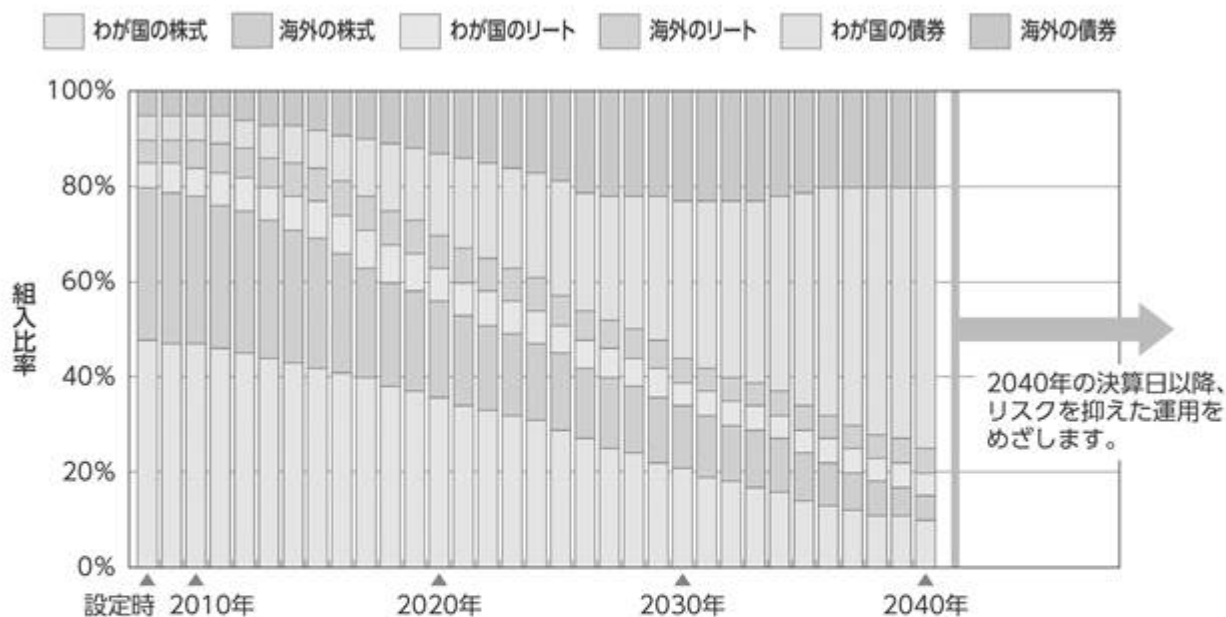
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	37%	21%	8%	7%	15%	12%

〈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) 2019年6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。2018年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要性があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整(リバランス)を行なう場合があります。

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

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

運用プロセス



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

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

3 海外の株式への投資にあたっては、投資成果を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^(注)を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークである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、2003年4月より算出・公表されています。

【算出方法の概要】

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

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

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

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

5

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

運用プロセス



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

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

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

S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

【特徴】

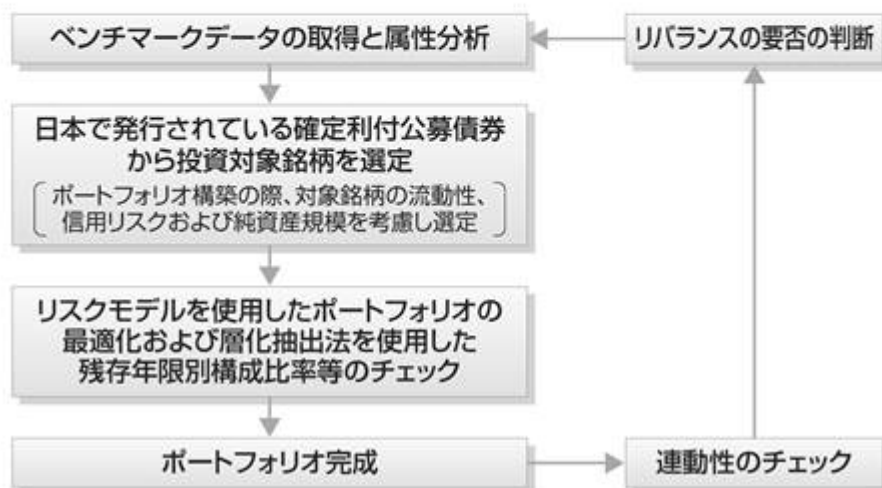
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

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

6

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

運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

NOMURA－BPI総合指数とは

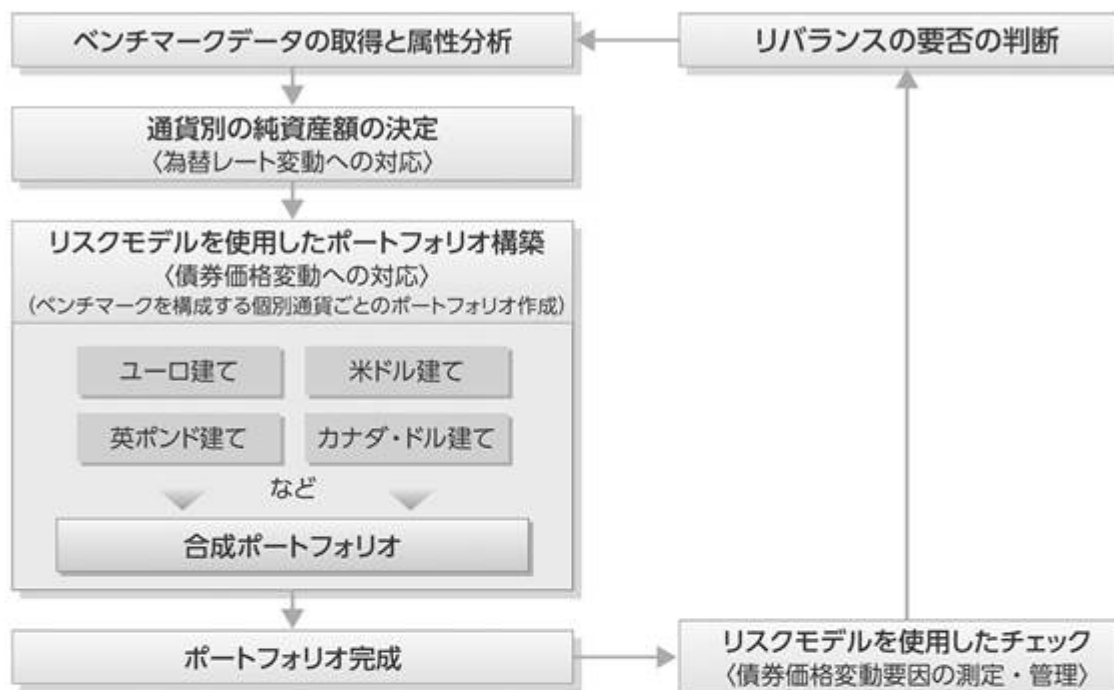
NOMURA－BPIは、野村証券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

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

7

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

運用プロセス



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

①為替レート変動への対応

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

②債券価格変動への対応

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

③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

8

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

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

NOMURA－BPI総合短期指数とは

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

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

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

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

〈2040年の決算日前日まで〉



※ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドに投資することがあります。

〈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。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2008年2月28日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）	
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3）	

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

(注) 収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況(2019年6月末日現在) >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	設立登記
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。

2007年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。

(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長(金商)第352号)

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

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

投資態度

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

ロ. マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2040年に近づくにたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないません。

当初設定時の基本配分比率

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

外国株式インデックスマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の32%

ダイワJ - 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。）

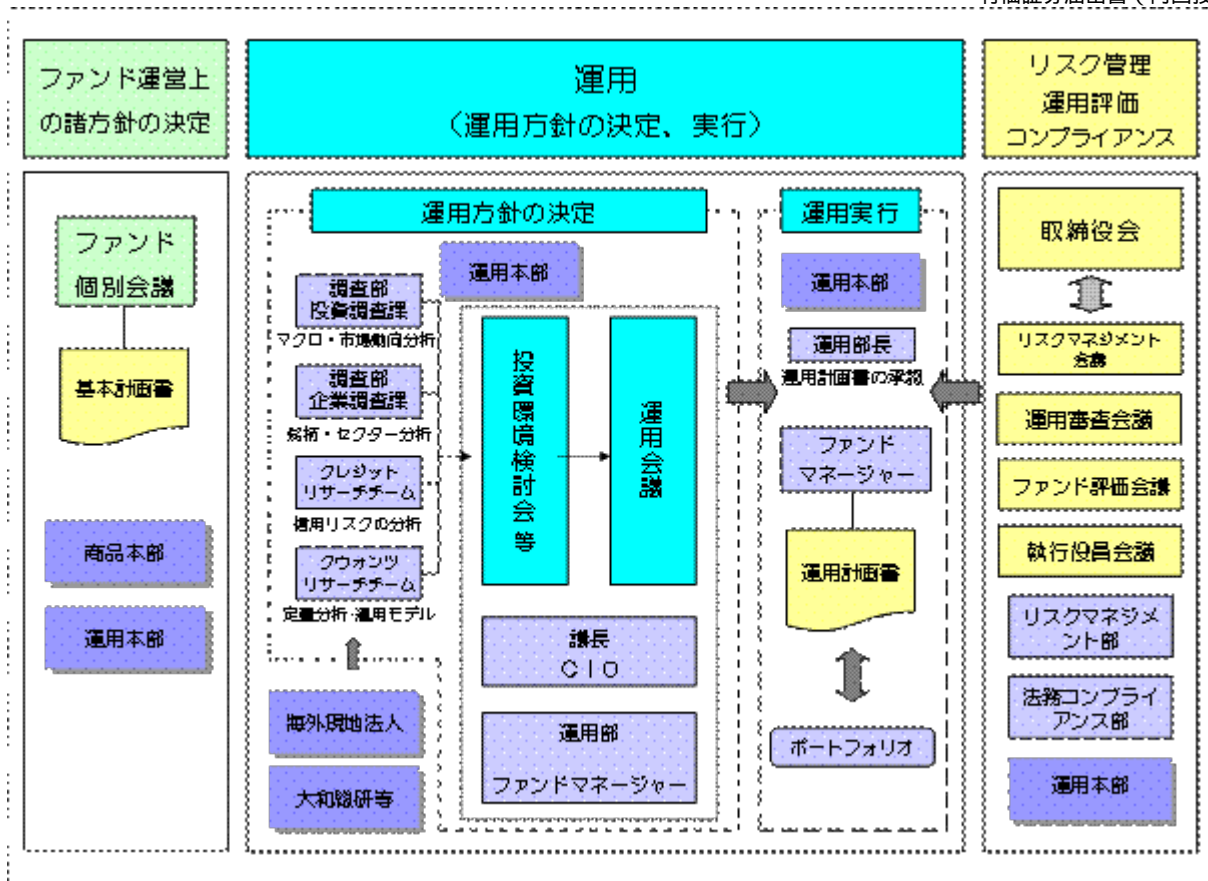
3. コール・ローン

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2019年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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。

信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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、

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せん。

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

（注）東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

2. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

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

(2) 投資対象

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

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

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、2003年4月より算出・公表されています。

〔算出方法の概要〕

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

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

（注2）2003年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市場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ず。

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

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

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

4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。

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．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ニ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

なお、前3.の証券および前4.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

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

（注）S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

〔特徴〕

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

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

5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

12．預託証券（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。）

13．外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

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

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引

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

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

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

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

ホ．委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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、野村證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、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

6．ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

(2) 投資対象

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

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

18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
- 委託会社は、信託金を、前に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注) FTSE世界国債インデックスとは

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

3 【投資リスク】

〈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が予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともありま

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リートの主な価格変動要因〉



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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

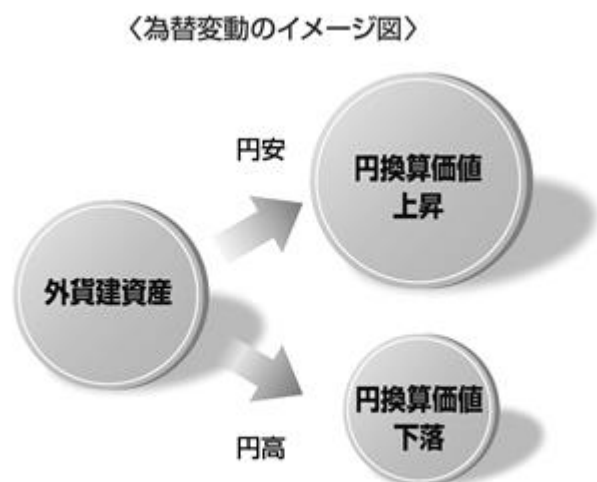
ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。

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

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



※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付けを中止することがあります。

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

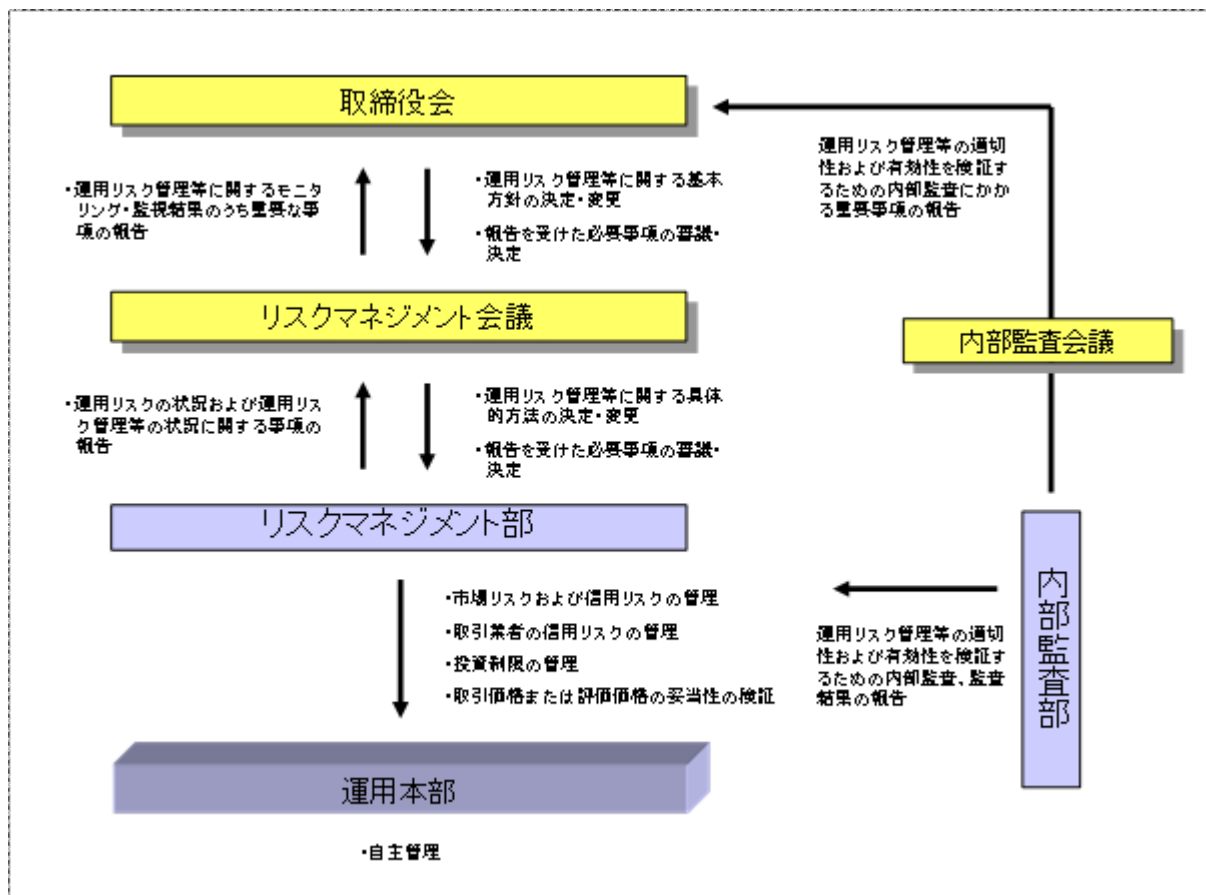
には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者のご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。

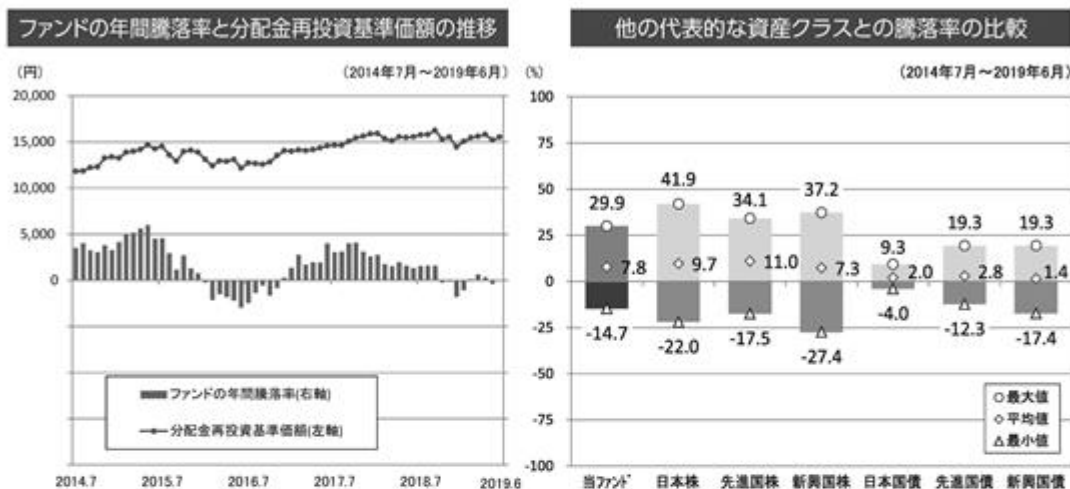


流動性リスクに対する管理体制

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

参 考 情 報

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



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

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
 日本国債：NOMURA-BPI国債
 先進国債：FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円ベース)

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

	信託報酬率
第1計算期間から2016年3月11日まで	年率0.7020% ¹ (税抜0.65%)
2016年3月12日から第18計算期間まで	年率0.3888% ² (税抜0.36%)
第19計算期間から第28計算期間まで	年率0.3672% ³ (税抜0.34%)
第29計算期間から第33計算期間まで	年率0.3024% ⁴ (税抜0.28%)
第34計算期間以降	年率0.2376% ⁵ (税抜0.22%)

1 消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.715%となります。

2 消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.396%となります。

3 消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.374%となります。

4 消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.308%となります。

5 消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.242%となります。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

< 第1計算期間から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 年率0.125% (税抜)	販売会社 年率0.125% (税抜)	受託会社 年率0.03% (税抜)
--------------------------	--------------------------	-------------------------

< 第34計算期間以降 >

委託会社 年率0.095% (税抜)	販売会社 年率0.095% (税抜)	受託会社 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收受した後、販売会社に支払われます。

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

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

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

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合

には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

- () 2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2019年6月末現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2019年6月28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	50,899,827	99.80
内 日本	50,899,827	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	101,449	0.20
純資産総額	51,001,276	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】（2019年6月28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	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	18,823,536	0.9911 18,656,243	0.9985 18,795,300	36.85
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	4,250,389	2.3069 9,805,585	2.5291 10,749,658	21.08
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	5,820,519	1.2822 7,463,271	1.3100 7,624,879	14.95
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	2,186,520	2.7672 6,050,554	2.8067 6,136,905	12.03
5	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,399,634	2.6879 3,762,106	2.9286 4,098,968	8.04
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	1,473,503	2.2326 3,289,862	2.3713 3,494,117	6.85

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第2計算期間末 (2009年12月18日)	1,176,672	1,176,672	0.6991	0.6991
第3計算期間末 (2010年12月20日)	952,605	952,605	0.7319	0.7319
第4計算期間末 (2011年12月19日)	1,354,908	1,354,908	0.6293	0.6293
第5計算期間末 (2012年12月18日)	3,373,491	3,373,491	0.7645	0.7645
第6計算期間末 (2013年12月18日)	9,736,661	9,736,661	1.1001	1.1001
第7計算期間末 (2014年12月18日)	13,831,791	13,831,791	1.2972	1.2972
第8計算期間末 (2015年12月18日)	22,270,544	22,270,544	1.3817	1.3817
第9計算期間末 (2016年12月19日)	28,966,940	28,966,940	1.4141	1.4141
第10計算期間末 (2017年12月18日)	37,746,883	37,746,883	1.5802	1.5802

2018年6月末日	41,692,328	-	1.5534	-
7月末日	43,087,646	-	1.5760	-
8月末日	45,161,741	-	1.5787	-
9月末日	49,080,001	-	1.6238	-
10月末日	47,892,398	-	1.5266	-
11月末日	46,849,674	-	1.5519	-
第11計算期間末 (2018年12月18日)	45,018,917	45,018,917	1.4875	1.4875
12月末日	43,712,206	-	1.4437	-
2019年1月末日	47,692,608	-	1.5048	-
2月末日	48,873,318	-	1.5449	-
3月末日	50,118,196	-	1.5591	-
4月末日	51,708,618	-	1.5802	-
5月末日	47,999,027	-	1.5195	-
6月末日	51,001,276	-	1.5515	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
2018年12月19日～ 2019年6月18日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第10計算期間	11.7
第11計算期間	5.9
2018年12月19日～ 2019年6月18日	3.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第10計算期間	7,259,647	3,856,478
第11計算期間	9,247,574	2,870,316
2018年12月19日～ 2019年6月18日	6,268,149	3,741,151

(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 (2019年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	136,528,797,240	99.28
内 日本	136,528,797,240	99.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	987,472,928	0.72
純資産総額	137,516,270,168	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,209,780,000	0.88
内 日本	1,209,780,000	0.88

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

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

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

(2) 投資資産（2019年6月28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	684,700	7,002.13 4,794,358,634	6,688.00 4,579,273,600	3.33
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	502,600	5,432.23 2,730,241,635	5,165.00 2,595,929,000	1.89
3	ソニー	日本	株式	電気機 器	412,300	6,605.26 2,723,352,608	5,648.00 2,328,670,400	1.69
4	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,172,000	694.17 2,896,112,059	512.00 2,136,064,000	1.55
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	412,400	5,132.86 2,116,793,830	5,017.00 2,069,010,800	1.50
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	536,400	4,556.67 2,444,200,308	3,823.00 2,050,657,200	1.49
7	キーエンス	日本	株式	電気機 器	30,200	63,227.90 1,909,482,653	66,130.00 1,997,126,000	1.45
8	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	427,100	4,506.32 1,924,650,475	3,806.00 1,625,542,600	1.18
9	リクルートホールディン グス	日本	株式	サービ ス 業	420,600	3,643.31 1,532,380,234	3,594.00 1,511,636,400	1.10
10	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	518,400	3,360.02 1,741,839,491	2,785.00 1,443,744,000	1.05
11	任天堂	日本	株式	その他 製品	35,200	39,807.41 1,401,221,162	39,490.00 1,390,048,000	1.01
12	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	494,300	3,066.57 1,515,807,494	2,743.50 1,356,112,050	0.99
13	みずほフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	8,233,500	196.65 1,619,139,859	156.10 1,285,249,350	0.93
14	花王	日本	株式	化学	149,200	9,005.24 1,343,583,051	8,210.00 1,224,932,000	0.89

15	三菱商事	日本	株式	卸売業	424,700	3,440.64 1,461,240,474	2,840.00 1,206,148,000	0.88
16	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	55,000	23,215.72 1,276,864,735	21,580.00 1,186,900,000	0.86
17	ダイキン工業	日本	株式	機械	83,800	15,440.65 1,293,927,266	14,065.00 1,178,647,000	0.86
18	東京海上HD	日本	株式	保険業	216,600	5,446.76 1,179,768,304	5,399.00 1,169,423,400	0.85
19	ファナック	日本	株式	電気機器	58,400	21,966.60 1,282,849,654	19,930.00 1,163,912,000	0.85
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	109,300	10,625.98 1,161,419,768	10,080.00 1,101,744,000	0.80
21	日立	日本	株式	電気機器	276,500	3,730.31 1,031,431,359	3,949.00 1,091,898,500	0.79
22	日本電産	日本	株式	電気機器	74,000	16,358.09 1,210,498,675	14,725.00 1,089,650,000	0.79
23	信越化学	日本	株式	化学	106,000	9,825.51 1,041,504,206	10,035.00 1,063,710,000	0.77
24	キヤノン	日本	株式	電気機器	330,800	3,520.44 1,164,564,730	3,146.00 1,040,696,800	0.76
25	HOYA	日本	株式	精密機器	123,700	6,647.96 822,352,660	8,254.00 1,021,019,800	0.74
26	資生堂	日本	株式	化学	122,100	7,912.72 966,143,938	8,121.00 991,574,100	0.72
27	第一三共	日本	株式	医薬品	175,800	4,600.86 808,832,455	5,635.00 990,633,000	0.72
28	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	381,800	3,014.14 1,150,801,071	2,512.50 959,272,500	0.70
29	村田製作所	日本	株式	電気機器	193,400	5,930.90 1,147,036,173	4,840.00 936,056,000	0.68
30	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	69,400	11,724.38 813,672,509	13,340.00 925,796,000	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 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	99.28%
合計	99.28%

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

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	0.27%
建設業	2.78%
食料品	4.09%
繊維製品	0.65%
パルプ・紙	0.28%
化学	7.35%
医薬品	5.45%
石油・石炭製品	0.62%
ゴム製品	0.78%
ガラス・土石製品	0.86%
鉄鋼	0.90%
非鉄金属	0.77%
金属製品	0.55%
機械	5.14%
電気機器	13.51%
輸送用機器	7.78%
精密機器	2.12%
その他製品	2.15%
電気・ガス業	1.65%
陸運業	4.69%
海運業	0.16%
空運業	0.54%
倉庫・運輸関連業	0.20%
情報・通信業	8.84%
卸売業	4.92%
小売業	4.52%
銀行業	5.82%
証券、商品先物取引業	0.75%
保険業	2.27%
その他金融業	1.12%
不動産業	2.38%
サービス業	5.24%
合計	99.28%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該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 2019年9月	買建	78	1,198,049,120	1,209,780,000	0.88%

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2019年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	109,266,313,042	95.77
内 香港	1,579,453,356	1.38
内 シンガポール	511,814,600	0.45
内 イスラエル	237,701,195	0.21
内 ノルウェー	280,092,477	0.25
内 スウェーデン	1,111,219,030	0.97
内 デンマーク	711,862,636	0.62
内 イギリス	6,938,164,230	6.08
内 アイルランド	225,946,989	0.20
内 オランダ	1,500,357,666	1.32
内 ベルギー	403,332,292	0.35
内 フランス	4,632,445,395	4.06
内 ドイツ	3,665,830,557	3.21
内 スイス	3,891,618,788	3.41
内 ポルトガル	60,383,865	0.05
内 スペイン	1,237,195,312	1.08
内 イタリア	963,929,770	0.84
内 フィンランド	415,090,436	0.36

	内 オーストリア	88,818,601	0.08
	内 カナダ	4,251,221,969	3.73
	内 アメリカ	73,814,148,024	64.70
	内 オーストラリア	2,644,199,230	2.32
	内 ニュージーランド	101,486,624	0.09
投資証券		3,152,156,649	2.76
	内 香港	106,155,972	0.09
	内 シンガポール	53,465,838	0.05
	内 イギリス	70,300,836	0.06
	内 フランス	122,014,003	0.11
	内 カナダ	21,101,920	0.02
	内 アメリカ	2,414,717,886	2.12
	内 オーストラリア	364,400,194	0.32
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,668,371,795	1.46
純資産総額		114,086,841,486	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,816,611,818	1.59
内 アメリカ	1,816,611,818	1.59
為替予約取引(買建)	527,779,000	0.46
内 日本	527,779,000	0.46

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

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

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

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

(2) 投資資産 (2019年6月28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 MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	199,600	11,902.06 2,375,657,926	14,460.02 2,886,221,689	2.53

2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	129,000	19,311.65 2,491,211,684	21,529.97 2,777,366,723	2.43
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	11,430	180,800.26 2,066,547,297	205,262.34 2,346,148,560	2.06
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	65,150	15,002.85 977,436,260	20,426.20 1,330,767,256	1.17
5	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	73,000	15,672.66 1,144,109,576	15,164.97 1,107,043,182	0.97
6	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	89,870	11,832.00 1,063,342,357	11,731.86 1,054,342,582	0.92
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	8,627	117,298.47 1,011,934,223	115,983.11 1,000,586,358	0.88
8	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	8,200	117,980.68 967,442,316	116,049.94 951,609,571	0.83
9	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	85,550	9,434.63 807,136,278	11,106.85 950,191,189	0.83
10	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	116,055	8,490.51 985,371,533	8,172.63 948,475,480	0.83
11	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	48,050	15,031.74 722,277,373	18,456.88 886,853,166	0.78
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	35,800	23,396.46 837,597,232	22,853.63 818,160,162	0.72
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	68,667	10,045.70 689,814,225	11,833.18 812,549,397	0.71
14	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	251,101	3,020.81 758,529,732	3,040.75 763,536,847	0.67
15	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	49,412	12,384.74 611,955,791	15,015.14 741,928,444	0.65
16	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	121,050	5,096.95 616,994,078	6,007.13 727,163,898	0.64

17	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	155,313	4,900.34 761,095,859	4,681.31 727,069,807	0.64
18	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	199,991	3,296.11 659,200,646	3,554.91 710,950,846	0.62
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	25,050	21,245.51 532,201,861	28,143.96 705,006,423	0.62
20	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	113,504	6,390.00 725,294,528	6,170.97 700,430,630	0.61
21	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	26,326	30,365.73 799,408,992	26,552.98 699,033,978	0.61
22	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	52,068	12,800.17 666,483,479	13,270.02 690,943,761	0.61
23	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	30,950	18,973.19 587,222,868	22,314.68 690,639,526	0.61
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	70,771	8,393.93 594,048,940	9,036.03 639,489,283	0.56
25	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	123,550	5,140.18 635,069,453	5,115.71 632,046,391	0.55
26	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	111,550	5,276.96 588,646,957	5,505.91 614,184,617	0.54
27	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	120,222	5,805.89 697,997,010	4,989.59 599,859,583	0.53
28	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	19,640	28,152.71 552,920,798	30,213.59 593,395,055	0.52
29	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	60,200	8,773.37 528,161,041	9,853.24 593,165,319	0.52
30	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・サービス	14,740	36,956.12 544,734,664	39,237.71 578,363,931	0.51

(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	95.77%
投資証券	2.76%
合計	98.54%

(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	5.93%
素材	4.46%
資本財・サービス	10.06%
一般消費財・サービス	9.65%
生活必需品	8.45%
ヘルスケア	12.72%
金融	15.93%
情報技術	16.51%
コミュニケーション・サービス	8.10%
公益事業	3.43%
不動産	0.54%
合計	95.77%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2019年9月	買建	115	1,799,081,930	1,816,611,818	1.59%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2019年7 月	買建	4,900,000	528,011,860	527,779,000	0.46%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況（2019年6月28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	283,269,546,670	98.60
内 日本	283,269,546,670	98.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,009,132,355	1.40
純資産総額	287,278,679,025	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	3,842,000,000	1.34
内 日本	3,842,000,000	1.34

(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（2019年6月28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	28,278	736,892.97 20,837,859,543	738,000.00 20,869,164,000	7.26
2 ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	29,201	643,450.61 18,789,401,532	656,000.00 19,155,856,000	6.67
3 野村不動産マスターF	日本	投資証券	90,857	156,358.04 14,206,222,847	165,700.00 15,055,004,900	5.24
4 日本リテールファンド	日本	投資証券	55,190	221,045.71 12,199,513,203	218,000.00 12,031,420,000	4.19
5 ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	65,563	172,655.82 11,319,833,716	180,600.00 11,840,677,800	4.12

6	オリックス不動産投資	日本	投資証券	58,183	189,641.33 11,033,901,765	196,600.00 11,438,777,800	3.98
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	41,954	235,992.29 9,900,820,637	248,900.00 10,442,350,600	3.63
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	39,180	245,608.89 9,622,956,525	260,100.00 10,190,718,000	3.55
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	28,459	308,155.22 8,769,789,536	320,500.00 9,121,109,500	3.18
10	GLP投資法人	日本	投資証券	72,359	117,753.47 8,520,523,353	122,800.00 8,885,685,200	3.09
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	18,485	442,135.60 8,172,876,650	467,000.00 8,632,495,000	3.00
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	93,995	87,238.83 8,200,014,432	86,800.00 8,158,766,000	2.84
13	API投資法人	日本	投資証券	15,341	469,871.39 7,208,297,142	469,000.00 7,194,929,000	2.50
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	9,033	769,634.14 6,952,105,232	771,000.00 6,964,443,000	2.42
15	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	85,386	81,377.36 6,948,487,872	80,600.00 6,882,111,600	2.40
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	9,703	584,271.74 5,669,188,758	604,000.00 5,860,612,000	2.04
17	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	100,742	52,780.44 5,317,207,313	55,800.00 5,621,403,600	1.96
18	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	6,740	778,945.74 5,250,094,322	773,000.00 5,210,020,000	1.81
19	森ヒルズリート	日本	投資証券	33,490	144,235.07 4,830,432,544	152,600.00 5,110,574,000	1.78
20	産業ファンド	日本	投資証券	35,846	121,789.93 4,365,682,069	134,000.00 4,803,364,000	1.67
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	19,080	232,430.87 4,434,781,043	246,700.00 4,707,036,000	1.64
22	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	9,933	464,594.13 4,614,813,537	460,000.00 4,569,180,000	1.59
23	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	23,606	181,759.65 4,290,618,312	187,100.00 4,416,682,600	1.54
24	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	26,149	159,651.56 4,174,728,719	158,200.00 4,136,771,800	1.44
25	イオンリート投資	日本	投資証券	29,974	131,381.31 3,938,023,554	138,000.00 4,136,412,000	1.44

26	日本リート投資法人	日本	投資証券	9,426	420,920.16 3,967,593,499	419,000.00 3,949,494,000	1.37
27	プレミア投資法人	日本	投資証券	27,763	135,488.82 3,761,576,132	141,800.00 3,936,793,400	1.37
28	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	12,110	293,984.50 3,560,152,302	309,500.00 3,748,045,000	1.30
29	東急リアル・エステート	日本	投資証券	19,578	169,197.88 3,312,556,128	187,200.00 3,665,001,600	1.28
30	森トラスト総合リート	日本	投資証券	20,870	175,098.53 3,654,306,459	175,200.00 3,656,424,000	1.27

(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	98.60%
合計	98.60%

(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 2019年9月	買建	2,000	3,803,816,000	3,842,000,000	1.34%

(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（2019年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	204,669,496	0.92
内 アメリカ	204,669,496	0.92
投資証券	21,785,381,758	97.77
内 ガーンジー	38,166,511	0.17
内 マン島	5,951,752	0.03
内 韓国	3,761,856	0.02
内 香港	553,592,931	2.48
内 シンガポール	875,001,480	3.93
内 イスラエル	15,912,326	0.07
内 イギリス	1,038,961,604	4.66
内 アイルランド	56,758,749	0.25
内 オランダ	56,592,959	0.25
内 ベルギー	201,457,000	0.90
内 フランス	843,385,297	3.78
内 ドイツ	59,002,967	0.26
内 スペイン	151,297,274	0.68
内 イタリア	4,448,445	0.02
内 カナダ	425,269,842	1.91
内 アメリカ	15,742,835,519	70.65
内 オーストラリア	1,605,647,268	7.21
内 ニューージーランド	107,337,978	0.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	292,556,096	1.31
純資産総額	22,282,607,350	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)	272,512,535	1.22
内 ドイツ	49,516,583	0.22
内 アメリカ	222,995,952	1.00
為替予約取引(買建)	138,568,450	0.62
内 日本	138,568,450	0.62

(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 (2019年6月28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	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	105,302	7,266.55 765,187,021	8,554.21 900,775,885	4.04
2	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	51,547	19,731.82 1,017,120,086	17,238.85 888,611,243	3.99
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	25,100	22,905.91 574,938,483	25,550.54 641,318,594	2.88
4	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	67,600	7,807.44 527,788,928	8,798.89 594,805,485	2.67
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	23,300	20,306.12 473,135,043	21,713.21 505,917,970	2.27
6	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	62,000	7,593.69 470,811,220	8,150.00 505,300,118	2.27
7	LINK REIT	香港	投資証券	360,500	1,061.55 382,694,725	1,345.90 485,198,392	2.18
8	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	61,679	6,752.93 416,514,858	7,482.78 461,530,499	2.07
9	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	34,778	12,247.74 425,955,082	12,676.10 440,849,545	1.98
10	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	52,517	6,960.10 365,529,215	7,482.78 392,973,252	1.76
11	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	フランス	投資証券	23,290	18,778.45 437,352,802	15,586.85 363,017,795	1.63
12	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	25,900	13,935.84 360,939,612	13,800.35 357,429,161	1.60
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	10,967	28,079.61 307,949,463	31,083.40 340,891,673	1.53
14	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	274,920	821.70 225,923,162	1,151.22 316,494,090	1.42
15	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	19,000	13,382.88 254,275,899	15,097.06 286,844,281	1.29
16	HCP INC	アメリカ	投資証券	79,600	3,119.11 248,285,053	3,427.72 272,846,671	1.22
17	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	906,410	301.50 273,352,270	299.69 271,646,817	1.22

18	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	28,600	7,463.27 213,452,225	8,776.26 251,001,087	1.13
19	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	21,200	10,224.31 216,756,420	11,383.70 241,334,480	1.08
20	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	123,300	2,065.36 254,665,084	1,941.29 239,362,031	1.07
21	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	19,028	11,037.91 210,030,449	12,538.13 238,575,591	1.07
22	UDR INC	アメリカ	投資証券	47,100	4,530.62 213,394,234	4,805.27 226,328,603	1.02
23	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	15,100	11,330.77 171,095,024	13,646.21 206,057,831	0.92
24	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託受益証券	21,800	9,479.48 206,654,287	9,388.50 204,669,496	0.92
25	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	27,920	6,769.75 189,011,705	7,211.15 201,335,336	0.90
26	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	59,800	3,032.56 181,353,044	3,364.12 201,174,729	0.90
27	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	28,864	7,554.46 218,054,914	6,864.06 198,124,436	0.89
28	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	15,000	10,619.14 159,287,233	12,900.30 193,504,608	0.87
29	DEXUS	オーストラリア	投資証券	184,470	835.59 154,145,586	990.42 182,704,401	0.82
30	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	63,697	2,417.62 153,996,562	2,859.66 182,152,317	0.82

(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
投資信託受益証券	0.92%
投資証券	97.77%
合計	98.69%

(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	アメリカ	DJ US REIT IDXFRS 2019年9月	買建	60	226,790,160	222,995,952	1.00%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFR 2019年9月	買建	50	51,187,652	49,516,583	0.22%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2019年7 月	買建	150,000	18,346,330	18,372,000	0.08%
		英ポンド買/円売 2019年 7月	買建	106,000	14,462,185	14,473,100	0.06%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2019年7月	買建	180,000	14,264,224	14,333,400	0.06%
		米ドル買/円売 2019年7 月	買建	680,000	73,183,062	73,242,800	0.33%
		カナダ・ドル買/円売 2019年7月	買建	70,000	5,634,887	5,759,600	0.03%
		豪ドル買/円売 2019年7 月	買建	145,000	10,944,353	10,943,150	0.05%
		ニュージーランド・ドル 買/円売 2019年7月	買建	20,000	1,419,360	1,444,400	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資状況（2019年6月28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	15,271,636,270	83.25
内 日本	15,271,636,270	83.25
地方債証券	1,141,520,400	6.22
内 日本	1,141,520,400	6.22

特殊債券		716,361,000	3.90
	内 日本	716,361,000	3.90
社債券		1,044,095,200	5.69
	内 日本	1,044,095,200	5.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		171,243,245	0.93
純資産総額		18,344,856,115	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 (2019年6月28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	370,000,000	100.44 371,631,700	100.36 371,357,900	0.100000 2020/09/20	2.02
2	345 10年国債	日本	国債証券	280,000,000	101.90 285,325,300	102.74 287,677,600	0.100000 2026/12/20	1.57
3	126 5年国債	日本	国債証券	233,000,000	100.50 234,170,050	100.46 234,081,120	0.100000 2020/12/20	1.28
4	334 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	103.87 207,755,220	104.33 208,660,000	0.600000 2024/06/20	1.14
5	130 5年国債	日本	国債証券	197,000,000	100.70 198,384,910	100.80 198,589,790	0.100000 2021/12/20	1.08
6	343 10年国債	日本	国債証券	192,000,000	101.06 194,039,280	102.55 196,905,600	0.100000 2026/06/20	1.07
7	131 5年国債	日本	国債証券	190,000,000	100.81 191,543,000	100.90 191,713,800	0.100000 2022/03/20	1.05
8	350 10年国債	日本	国債証券	185,000,000	100.46 185,854,700	102.79 190,176,300	0.100000 2028/03/20	1.04
9	128 5年国債	日本	国債証券	187,000,000	100.59 188,112,600	100.63 188,183,710	0.100000 2021/06/20	1.03
10	347 10年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.89 181,615,150	102.84 185,122,800	0.100000 2027/06/20	1.01
11	129 5年国債	日本	国債証券	182,000,000	100.64 183,170,400	100.72 183,319,500	0.100000 2021/09/20	1.00

12	348 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.84 171,432,600	102.85 174,846,700	0.100000 2027/09/20	0.95
13	349 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.58 170,996,200	102.85 174,846,700	0.100000 2027/12/20	0.95
14	135 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.94 171,613,300	101.29 172,199,800	0.100000 2023/03/20	0.94
15	329 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	104.18 166,688,000	104.21 166,736,000	0.800000 2023/06/20	0.91
16	335 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.43 165,500,800	104.02 166,436,800	0.500000 2024/09/20	0.91
17	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.50 165,614,400	103.34 165,348,800	0.800000 2022/09/20	0.90
18	138 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	101.31 151,972,800	101.62 152,442,000	0.100000 2023/12/20	0.83
19	133 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.85 151,287,000	101.08 151,630,500	0.100000 2022/09/20	0.83
20	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	103.74 145,244,400	103.27 144,590,600	1.100000 2021/12/20	0.79
21	322 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	103.38 144,744,600	103.07 144,306,400	0.900000 2022/03/20	0.79
22	127 5年国債	日本	国債証券	140,000,000	100.54 140,760,050	100.54 140,760,200	0.100000 2021/03/20	0.77
23	331 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	103.42 134,451,200	103.62 134,713,800	0.600000 2023/09/20	0.73
24	351 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.65 130,854,000	102.74 133,562,000	0.100000 2028/06/20	0.73
25	352 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.28 130,367,100	102.67 133,474,900	0.100000 2028/09/20	0.73
26	353 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	101.35 131,761,100	102.64 133,442,400	0.100000 2028/12/20	0.73
27	137 5年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.98 131,283,400	101.53 131,996,800	0.100000 2023/09/20	0.72
28	113 20年国債	日本	国債証券	100,000,000	121.34 121,347,200	123.16 123,165,000	2.100000 2029/09/20	0.67
29	11兵庫県公債20年	日本	地方債証券	100,000,000	117.02 117,023,600	119.18 119,186,500	1.840000 2030/08/16	0.65
30	49 30年国債	日本	国債証券	93,000,000	122.69 114,105,790	127.28 118,377,840	1.400000 2045/12/20	0.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．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	83.25%
地方債証券	6.22%
特殊債券	3.90%
社債券	5.69%
合計	99.07%

(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（2019年6月28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	173,863,649,431	98.33
内 ユーロ	67,306,863,651	38.07
内 シンガポール	691,971,343	0.39
内 マレーシア	812,827,646	0.46
内 ノルウェー	422,431,250	0.24
内 スウェーデン	619,169,833	0.35
内 デンマーク	887,294,456	0.50
内 イギリス	11,083,093,002	6.27
内 ポーランド	1,042,043,221	0.59
内 カナダ	3,370,347,903	1.91
内 アメリカ	81,713,704,513	46.22
内 メキシコ	1,420,336,583	0.80
内 南アフリカ	986,127,716	0.56
内 オーストラリア	3,507,438,314	1.98

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,944,189,285	1.67
純資産総額	176,807,838,716	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,657,486,540	0.94
内 日本	1,657,486,540	0.94

(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 (2019年6月28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	7,907,000	99.98 852,164,622	100.83 859,386,628	2.250000 2021/04/30	0.49
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,400,000	102.66 708,251,520	109.62 756,254,640	3.125000 2028/11/15	0.43
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	99.39 696,384,705	107.32 751,921,482	2.875000 2028/05/15	0.43
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,600,000	100.58 715,580,406	105.39 749,759,214	2.625000 2029/02/15	0.42
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,029,000	91.63 694,276,204	98.35 745,162,164	1.625000 2026/05/15	0.42
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,300,000	97.75 663,845,302	106.25 721,566,847	2.750000 2028/02/15	0.41
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,000,000	98.64 637,944,336	107.42 694,734,575	2.875000 2028/08/15	0.39
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,287,000	96.78 655,861,348	100.89 683,707,043	2.000000 2022/11/30	0.39
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,084,000	159.73 603,394,706	179.44 677,873,702	4.500000 2041/04/25	0.38
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,921,000	96.38 615,133,624	102.29 652,878,226	2.250000 2024/11/15	0.37

11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	94.14 598,744,562	102.34 650,861,566	2.250000 2027/08/15	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	95.58 601,701,457	102.36 644,393,713	2.250000 2025/11/15	0.36
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	95.35 585,839,404	103.32 634,850,331	2.375000 2027/05/15	0.36
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	95.23 594,153,993	101.63 634,070,380	2.125000 2025/05/15	0.36
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,087,000	118.72 594,351,180	126.38 632,694,315	2.500000 2030/05/25	0.36
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,420,000	107.50 582,013,257	115.81 627,012,885	1.500000 2031/05/25	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.71 586,340,384	100.97 625,079,780	2.000000 2025/02/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.26 583,536,142	100.91 624,695,977	2.000000 2025/08/15	0.35
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,097,000	121.43 609,409,647	121.21 608,307,210	4.250000 2023/10/25	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,550,000	97.88 585,567,773	101.64 608,045,545	2.125000 2024/03/31	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	93.94 556,948,235	102.31 606,551,576	2.250000 2027/11/15	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	93.00 551,387,349	100.68 596,917,845	2.000000 2026/11/15	0.34
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,807,000	162.41 558,423,692	173.13 595,282,207	5.750000 2032/10/25	0.34
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,340,000	94.56 544,297,548	102.41 589,493,550	2.250000 2027/02/15	0.33
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	99.33 559,885,744	104.41 588,512,710	2.750000 2024/02/15	0.33
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	89.91 542,742,483	97.38 587,821,123	1.500000 2026/08/15	0.33
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,023,000	148.58 550,191,340	154.78 573,149,150	5.500000 2029/04/25	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,162,000	97.23 541,021,624	102.89 572,536,799	2.375000 2024/08/15	0.32
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	91.36 528,467,769	98.47 569,586,306	1.625000 2026/02/15	0.32
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	99.46 538,334,333	104.20 563,960,797	2.750000 2023/11/15	0.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.33%
合計	98.33%

(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	豪ドル買/円売 2019年7月	買建	233,000	17,541,638	17,584,510	0.01%
		南アフリカ・ランド買/円売 2019年8月	買建	1,100,000	8,303,779	8,294,000	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2019年8月	買建	639,000	52,483,127	52,474,680	0.03%
		デンマーク・クローネ買/円売 2019年8月	買建	477,000	7,828,953	7,827,570	0.00%
		ユーロ買/円売 2019年8月	買建	3,133,000	383,704,489	383,635,850	0.22%
		ユーロ買/円売 2019年7月	買建	1,592,000	194,916,201	194,988,160	0.11%
		英ポンド買/円売 2019年8月	買建	481,000	65,599,020	65,589,160	0.04%
		英ポンド買/円売 2019年7月	買建	326,000	44,566,808	44,515,300	0.03%
		メキシコ・ペソ買/円売 2019年8月	買建	3,611,000	20,129,487	20,077,160	0.01%
		マレーシア・リンギット買/円売 2019年7月	買建	522,000	13,587,660	13,572,000	0.01%

ノルウェー・クローネ 買/円売 2019年8月	買建	972,000	12,282,481	12,276,360	0.01%
ポーランド・ズロチ買/ 円売 2019年7月	買建	837,000	23,728,799	24,105,600	0.01%
スウェーデン・クローネ 買/円売 2019年7月	買建	188,000	2,156,276	2,182,680	0.00%
シンガポール・ドル買/ 円売 2019年8月	買建	300,000	23,839,500	23,835,000	0.01%
米ドル買/円売 2019年8 月	買建	4,740,000	509,423,918	509,218,200	0.29%
米ドル買/円売 2019年7 月	買建	2,538,000	273,311,128	273,469,500	0.15%
豪ドル買/円売 2019年8 月	買建	51,000	3,844,074	3,840,810	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

●DCダイワ・ターゲットイヤー 2040

2019年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	15,515円
純資産総額	51百万円



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
	08年12月	09年12月	10年12月	11年12月	12年12月	13年12月	14年12月	15年12月	16年12月	17年12月	18年12月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	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	2,127	38.9%	日本円	60.0%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.2%	
外国株式・先物	1,264	20.5%	米ドル	25.1%	最終利回り(%)	ソフトバンクグループ	日本	0.7%	
国内債券	266	14.8%	ユーロ	7.5%	修正デュレーション	ソニー	日本	0.6%	
外国債券	772	11.8%	英ポンド	2.4%	残存年数	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.6%	
国内リート・先物	64	8.0%	豪ドル	1.3%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.6%	
外国リート・先物	311	7.3%	カナダドル	1.2%	AAA	84.7%	日本ビルファンド	日本	0.6%
外国投資信託等	9	0.1%	スイスフラン	0.7%	AA	6.8%	ジャパリアルエステイト	日本	0.5%
			香港ドル	0.5%	A	6.0%	野村不動産マスターF	日本	0.4%
			シンガポールドル	0.4%	BBB	0.3%	日本リート	日本	0.3%
コール・ローン、その他		1.3%	その他	0.9%	BB以下・無格付	2.2%	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.3%
合計	4,813	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	5.9%	

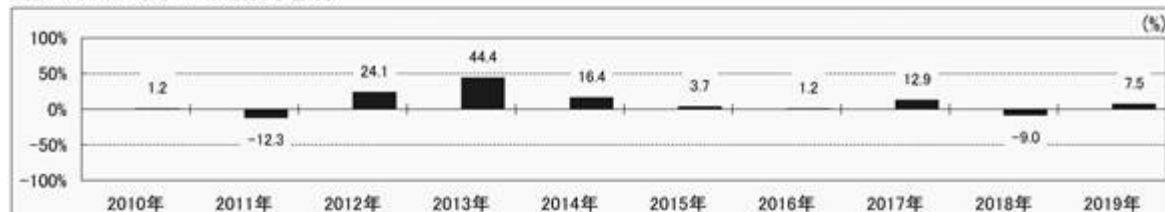
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.2%保有しております。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2019年は6月28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できます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、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 <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、あるいは、第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、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

信託約款の変更等

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

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

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を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 <https://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。
<https://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11期計算期間（平成29年12月19日から平成30年12月18日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 平成29年12月18日現在	第11期 平成30年12月18日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	34,957
コール・ローン	135,817	146,425
親投資信託受益証券	37,677,566	44,928,054
流動資産合計	37,813,383	45,109,436
資産合計	37,813,383	45,109,436
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	5,381	7,359
未払委託者報酬	59,850	81,409
その他未払費用	1,269	1,751
流動負債合計	66,500	90,519
負債合計	66,500	90,519
純資産の部		
元本等		
元本	1 23,887,345	1 30,264,603
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,859,538	14,754,314
（分配準備積立金）	8,101,051	7,344,925
元本等合計	37,746,883	45,018,917
純資産合計	37,746,883	45,018,917
負債純資産合計	37,813,383	45,109,436

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期		第11期	
	自	平成28年12月20日 至 平成29年12月18日	自	平成29年12月19日 至 平成30年12月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,853,929		2,522,512
営業収益合計		3,853,929		2,522,512
営業費用				
受託者報酬		10,355		13,784
委託者報酬		115,007		152,469
その他費用		2,415		3,269
営業費用合計		127,777		169,522
営業利益又は営業損失（ ）		3,726,152		2,692,034
経常利益又は経常損失（ ）		3,726,152		2,692,034
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,726,152		2,692,034
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（ ）		197,797		86,332
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,482,764		13,859,538
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,454,426		5,151,110
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,454,426		5,151,110
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,606,007		1,650,632
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,606,007		1,650,632
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		13,859,538		14,754,314

(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11期	
	自 平成29年12月19日	至 平成30年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第10期	第11期
	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1. 1 期首元本額	20,484,176円	23,887,345円
期中追加設定元本額	7,259,647円	9,247,574円
期中一部解約元本額	3,856,478円	2,870,316円
2. 計算期間末日における受益権の総数	23,887,345口	30,264,603口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第10期	第11期
	自 平成28年12月20日 至 平成29年12月18日	自 平成29年12月19日 至 平成30年12月18日

<p>1 分配金の計算過程</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(3,528,355円)、投資信託約款に規定される収益調整金(8,544,593円)及び分配準備積立金(4,572,696円)より分配可能額は16,645,644円(1万口当たり6,968.39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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(13,744,603円)及び分配準備積立金(7,344,925円)より分配可能額は21,089,528円(1万口当たり6,968.38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11期 自 平成29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第11期
	平成30年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第10期	第11期
	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	3,616,361	2,440,435
合計	3,616,361	2,440,435

（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10期	第11期
平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期
自 平成29年12月19日
至 平成30年12月18日

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

(1口当たり情報)

	第10期 平成29年12月18日現在	第11期 平成30年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5802円 (15,802円)	1.4875円 (14,875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	16,953,280	16,797,309	
	外国株式インデックスマザーファンド	4,236,847	9,688,398	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,851,074	5,115,072	
	ダイワJ-REITマザーファンド	1,385,927	3,689,892	
	ダイワ・グローバルREITインデッ クス・マザーファンド	1,416,414	3,127,583	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	5,092,545	6,509,800	
親投資信託受益証券 合計			44,928,054	
合計			44,928,054	

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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	3,981,864,844
コール・ローン	5,325,669,538	16,678,698,103
株式 3 4	143,644,364,120	132,803,813,650
派生商品評価勘定	20,448,280	-
未収入金	28,787,680	2,682,956
未収配当金	13,410,638	16,140,750
未収利息	203,658	719,210
前払金	-	11,280,000
その他未収収益 5	2,465,912	4,527,606
流動資産合計	149,035,349,826	153,499,727,119
資産合計	149,035,349,826	153,499,727,119
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	28,126,860
前受金	3,005,000	-
未払解約金	146,171,100	58,304,300
受入担保金	3,932,576,602	19,684,511,815
その他未払費用	-	81,047
流動負債合計	4,081,752,702	19,771,024,022
負債合計	4,081,752,702	19,771,024,022
純資産の部		
元本等		

元本	1	128,399,557,544	134,974,559,390
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	16,554,039,580	1,245,856,293
元本等合計		144,953,597,124	133,728,703,097
純資産合計		144,953,597,124	133,728,703,097
負債純資産合計		149,035,349,826	153,499,727,119

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	138,207,285,313円	128,399,557,544円
期中追加設定元本額	15,341,862,921円	18,708,118,755円
期中一部解約元本額	25,149,590,690円	12,133,116,909円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス ファンド	4,340,213,526円	4,201,513,179円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	10,950,187,562円	8,723,420,410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V A 2	62,130,624円	50,876,443円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	80,019,243円	65,059,832円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,368,511,576円	1,048,156,296円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	70,073,352円	59,087,088円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,923,003,980円	1,439,870,693円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	4,688,328円
D-I's TOPIXイン デックス	28,362,087円	40,048,507円

為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	24,808,577円	20,229,721円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	571,628円	687,039円
iFree TOPIXイン デックス	276,190,632円	806,893,142円
iFree 8資産バランス	638,889,399円	1,341,607,768円
iFree 年金バランス	- 円	19,858,640円
DCダイワ日本株式インデッ クス	60,774,772,193円	65,589,578,535円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,165,831,652円	2,638,256,874円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,314,028,426円	2,934,310,951円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,187,409,592円	2,837,773,343円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,029,488,955円	4,616,032,022円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	16,986,957円	15,233,589円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	51,136,828円	53,028,188円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	13,388,722円	16,953,280円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	- 円	18,427,073円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	364,602円	350,718円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	362,318円	359,201円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	690,983円	712,052円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	6,930,943円	4,149,572円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	17,156,249円	4,912,940円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	15,921,448円	9,756,807円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	345,195,537円	184,088,109円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	169,150,600円	161,522,359円

	ダイワ・バランスファンド3 5VA	10,851,915,853円	9,663,609,360円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	220,121,595円	11,266,082円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	228,337,957円	14,433,489円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	885,899,660円	825,057,420円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	144,200,065円	129,734,372円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	241,089,158円	221,128,598円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	73,865,612円	145,177,137円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス	6,118,126,552円	8,514,418,449円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	4,248,902円	305,043,025円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	1,205,509,199円	1,909,937,672円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,197,963,794円	1,392,102,290円
	ダイワライフスタイル25	175,105,430円	181,541,595円
	ダイワライフスタイル50	625,654,835円	651,110,098円
	ダイワライフスタイル75	504,751,457円	544,233,554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)	14,050,989,284円	13,558,323,550円
	計	128,399,557,544円	134,974,559,390円
2.	期末日における受益権の総数	128,399,557,544口	134,974,559,390口
3.	2 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は1,245,856,293円であり ます。

4.	3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 3,768,357,250円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 18,392,303,350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 716,200,000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 677,500,000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1,725,920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2,970,375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29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	11,644,035,480	18,231,339,771
合計	11,644,035,480	18,231,339,771

(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29年9月20日から平成29年12月18日まで、及び平成30年9月20日から平成30年12月18日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成29年12月18日 現在			平成30年12月18日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,214,735,000	-	1,235,220,000	20,485,000	948,200,000	-	920,105,000	28,095,000
合計	1,214,735,000	-	1,235,220,000	20,485,000	948,200,000	-	920,105,000	28,095,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.1289円	0.9908円
(1万口当たり純資産額)	(11,289円)	(9,908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	2,600	2,975.00	7,735,000	
日本水産	81,300	649.00	52,763,700	
マル八二チ口	11,700	3,775.00	44,167,500	
ハウスイ	500	853.00	426,500	
カネコ種苗	2,200	1,341.00	2,950,200	
サカタのタネ	9,900	3,605.00	35,689,500	
ホクト	6,800	1,980.00	13,464,000	貸付株式数 2,600株
ホクリヨウ	1,000	658.00	658,000	
ヒノキヤグループ	1,700	2,034.00	3,457,800	

ショーボンドHD	6,400	8,730.00	55,872,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ミライト・ホールディングス	20,800	1,557.00	32,385,600	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
タマホーム	5,200	1,120.00	5,824,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	1,400	817.00	1,143,800	貸付株式数 400株
日本アクア	2,000	387.00	774,000	貸付株式数 800株
ファーストコーポレーション	2,300	853.00	1,961,900	
ベステラ	1,600	1,620.00	2,592,000	
スペースバリューHD	9,900	1,010.00	9,999,000	
住石ホールディングス	17,000	101.00	1,717,000	
日鉄鉱業	1,900	4,780.00	9,082,000	
三井松島HLDGS	3,300	1,483.00	4,893,900	
国際石油開発帝石	327,600	1,084.00	355,118,400	
石油資源開発	11,700	2,168.00	25,365,600	
K&Oエナジーグループ	3,900	1,573.00	6,134,700	
ダイセキ環境ソリューション	1,500	706.00	1,059,000	
第一カッター興業	900	1,860.00	1,674,000	
安藤・間	52,100	706.00	36,782,600	
東急建設	23,700	1,038.00	24,600,600	
コムシスホールディングス	29,000	2,696.00	78,184,000	貸付株式数 11,400株
ミサワホーム	6,800	779.00	5,297,200	
ピーアールホールディングス	6,500	350.00	2,275,000	
高松コンストラクションGP	5,100	2,735.00	13,948,500	
東建コーポレーション	2,500	6,460.00	16,150,000	貸付株式数 900株
ソネック	800	761.00	608,800	
ヤマウラ	3,000	951.00	2,853,000	貸付株式数 1,500株
大成建設	67,100	4,800.00	322,080,000	
大林組	201,900	1,042.00	210,379,800	
清水建設	205,800	901.00	185,425,800	
飛島建設	5,600	1,436.00	8,041,600	
長谷工コーポレーション	83,700	1,214.00	101,611,800	
松井建設	7,300	753.00	5,496,900	
銭高組	800	5,210.00	4,168,000	
鹿島建設	157,800	1,532.00	241,749,600	

不動テトラ	5,000	1,752.00	8,760,000	
大末建設	2,300	1,076.00	2,474,800	
鉄建建設	4,000	2,668.00	10,672,000	
西松建設	14,400	2,483.00	35,755,200	
三井住友建設	48,400	670.00	32,428,000	
大豊建設	4,600	3,595.00	16,537,000	
前田建設	47,700	1,071.00	51,086,700	
佐田建設	4,000	401.00	1,604,000	
ナカノフドー建設	4,900	519.00	2,543,100	貸付株式数 1,000株
奥村組	11,000	3,380.00	37,180,000	
東鉄工業	8,100	3,060.00	24,786,000	
イチケン	1,200	1,993.00	2,391,600	
富士ピー・エス	2,000	396.00	792,000	
浅沼組	2,400	3,000.00	7,200,000	
戸田建設	77,800	673.00	52,359,400	
熊谷組	9,600	3,420.00	32,832,000	
青木あすなろ建設	3,600	946.00	3,405,600	
北野建設	1,400	3,980.00	5,572,000	
植木組	800	2,313.00	1,850,400	
矢作建設	9,100	725.00	6,597,500	
ピーエス三菱	7,000	626.00	4,382,000	
日本ハウスHLDGS	12,900	461.00	5,946,900	貸付株式数 3,100株
大東建託	23,900	15,600.00	372,840,000	
新日本建設	8,200	1,080.00	8,856,000	
NIPPO	17,700	2,067.00	36,585,900	
東亜道路	1,300	3,305.00	4,296,500	貸付株式数 800株
前田道路	21,200	2,179.00	46,194,800	
日本道路	1,800	6,050.00	10,890,000	
東亜建設	5,900	1,395.00	8,230,500	
若築建設	3,400	1,625.00	5,525,000	貸付株式数 1,000株
東洋建設	24,300	380.00	9,234,000	
五洋建設	80,100	647.00	51,824,700	
世紀東急	9,700	640.00	6,208,000	
福田組	2,200	4,300.00	9,460,000	貸付株式数 800株
日本ドライケミカル	1,500	1,224.00	1,836,000	
住友林業	47,700	1,500.00	71,550,000	
日本基礎技術	6,600	344.00	2,270,400	
巴コーポレーション	8,300	378.00	3,137,400	貸付株式数 500株
大和ハウス	186,200	3,602.00	670,692,400	
ライト工業	12,900	1,492.00	19,246,800	

積水ハウス	205,200	1,649.50	338,477,400	
日特建設	5,600	659.00	3,690,400	
北陸電気工事	3,100	945.00	2,929,500	
ユアテック	10,800	889.00	9,601,200	貸付株式数 500株
四電工	1,000	2,618.00	2,618,000	
中電工	8,800	2,310.00	20,328,000	
関電工	30,600	1,062.00	32,497,200	貸付株式数 6,800株
きんでん	44,900	1,795.00	80,595,500	
東京エネシス	6,800	960.00	6,528,000	貸付株式数 3,200株
トーエネック	1,900	3,110.00	5,909,000	
住友電設	4,600	1,790.00	8,234,000	貸付株式数 2,000株
日本電設工業	11,600	2,220.00	25,752,000	
協和エクシオ	26,400	2,580.00	68,112,000	
新日本空調	5,700	1,941.00	11,063,700	
日本工営	3,900	2,588.00	10,093,200	
九電工	13,300	4,110.00	54,663,000	
三機工業	15,100	1,155.00	17,440,500	
日揮	58,000	1,594.00	92,452,000	貸付株式数 10,000株
中外炉工業	1,900	2,159.00	4,102,100	
ヤマト	5,900	533.00	3,144,700	
太平電業	4,500	2,613.00	11,758,500	
高砂熱学	17,000	1,859.00	31,603,000	
三晃金属	800	2,807.00	2,245,600	
NEC ネットエスアイ	6,500	2,437.00	15,840,500	
朝日工業社	1,400	3,115.00	4,361,000	
明星工業	12,000	738.00	8,856,000	貸付株式数 1,000株
大気社	9,100	2,918.00	26,553,800	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
ダイダン	4,500	2,436.00	10,962,000	
日比谷総合設備	6,300	1,819.00	11,459,700	貸付株式数 1,000株
東芝プラントシステム	14,500	2,099.00	30,435,500	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
日本製粉	20,000	1,883.00	37,660,000	
日清製粉G本社	68,200	2,376.00	162,043,200	
日東富士製粉	400	5,580.00	2,232,000	
昭和産業	5,500	3,015.00	16,582,500	貸付株式数 200株
鳥越製粉	5,300	876.00	4,642,800	貸付株式数 1,000株
中部飼料	7,300	1,251.00	9,132,300	
フィード・ワン	40,000	181.00	7,240,000	貸付株式数 5,000株
東洋精糖	900	1,113.00	1,001,700	

日本甜菜糖	3,400	1,842.00	6,262,800	
三井製糖	4,700	2,785.00	13,089,500	
塩水港精糖	6,500	232.00	1,508,000	
日新製糖	2,900	2,128.00	6,171,200	
L I F U L L	19,900	733.00	14,586,700	貸付株式数 6,300株
ジェイエシーリクルートメント	4,600	2,025.00	9,315,000	貸付株式数 1,300株
日本M&Aセンター	42,800	2,308.00	98,782,400	
メンバーズ	1,900	910.00	1,729,000	
中広	500	577.00	288,500	
タケエイ	5,900	706.00	4,165,400	
E・Jホールディングス	700	1,088.00	761,600	貸付株式数 200株
トラスト・テック	2,700	3,040.00	8,208,000	貸付株式数 1,000株
コシダカホールディングス	15,300	1,414.00	21,634,200	
アルトナー	1,000	759.00	759,000	
パソナグループ	5,400	1,181.00	6,377,400	貸付株式数 500株 (500株)
C D S	1,400	1,283.00	1,796,200	貸付株式数 700株
リンクアンドモチベーション	10,500	862.00	9,051,000	貸付株式数 4,100株
G C A	5,800	712.00	4,129,600	
エス・エム・エス	21,100	1,762.00	37,178,200	
パーソルホールディングス	57,500	1,790.00	102,925,000	
リニカル	3,200	1,500.00	4,800,000	
クックパッド	18,000	332.00	5,976,000	貸付株式数 3,400株
エスクリ	1,600	596.00	953,600	
アイ・ケイ・ケイ	2,800	701.00	1,962,800	
森永製菓	15,200	4,840.00	73,568,000	
中村屋	1,600	4,345.00	6,952,000	
江崎グリコ	18,100	5,600.00	101,360,000	貸付株式数 1,000株
名糖産業	2,900	1,408.00	4,083,200	
井村屋グループ	2,600	2,585.00	6,721,000	
不二家	3,300	2,406.00	7,939,800	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
山崎製パン	49,300	2,366.00	116,643,800	
第一屋製パン	1,100	1,103.00	1,213,300	貸付株式数 400株
モロゾフ	1,000	5,250.00	5,250,000	
亀田製菓	3,700	4,995.00	18,481,500	
寿スピリッツ	6,400	4,520.00	28,928,000	
カルビー	27,500	3,570.00	98,175,000	貸付株式数 10,200株

森永乳業	12,100	3,140.00	37,994,000	
六甲バター	4,300	2,136.00	9,184,800	貸付株式数 300株
ヤクルト	44,700	8,270.00	369,669,000	
明治ホールディングス	42,800	8,840.00	378,352,000	
雪印メグミルク	14,500	2,819.00	40,875,500	
プリマハム	8,400	1,964.00	16,497,600	
日本ハム	26,100	4,355.00	113,665,500	
林兼産業	1,800	614.00	1,105,200	
丸大食品	6,400	1,818.00	11,635,200	
S Foods	5,400	4,365.00	23,571,000	
伊藤ハム米久HLDGS	38,600	684.00	26,402,400	貸付株式数 3,000株
学情	2,300	1,234.00	2,838,200	
スタジオアリス	2,900	2,356.00	6,832,400	
シミックホールディングス	3,200	1,793.00	5,737,600	
システナ	21,000	1,357.00	28,497,000	
NJS	1,200	1,689.00	2,026,800	
デジタルアーツ	3,200	6,160.00	19,712,000	貸付株式数 1,200株
新日鉄住金SOL	8,800	2,772.00	24,393,600	
総合警備保障	22,900	5,320.00	121,828,000	
キューブシステム	3,100	657.00	2,036,700	貸付株式数 1,000株
いちご	74,300	341.00	25,336,300	
エイジア	1,200	1,193.00	1,431,600	貸付株式数 400株
日本駐車場開発	75,600	150.00	11,340,000	
コア	2,500	1,265.00	3,162,500	
カカコム	43,300	2,170.00	93,961,000	貸付株式数 3,400株
アイロムグループ	2,200	1,730.00	3,806,000	
セントケア・ホールディング	3,100	535.00	1,658,500	
サイネックス	900	708.00	637,200	
ルネサンス	3,100	2,204.00	6,832,400	
ディップ	9,200	1,879.00	17,286,800	
SBSホールディングス	6,100	1,431.00	8,729,100	
オプトホールディング	3,500	1,654.00	5,789,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
新日本科学	7,900	683.00	5,395,700	
ツクイ	13,400	808.00	10,827,200	貸付株式数 5,300株
キャリアデザインセンター	1,400	1,043.00	1,460,200	
エムスリー	120,900	1,546.00	186,911,400	
ツカダ・グローバルHOLD	3,800	606.00	2,302,800	貸付株式数 1,500株

プラス	500	564.00	282,000		
アウトソーシング	30,200	1,096.00	33,099,200	貸付株式数	12,000株
ウェルネット	5,700	999.00	5,694,300	貸付株式数	3,000株
ワールドホールディングス	1,600	2,296.00	3,673,600	貸付株式数	100株
ディー・エヌ・エー	31,000	1,961.00	60,791,000		
博報堂D Y H L D G S	79,900	1,655.00	132,234,500		
ぐるなび	8,100	703.00	5,694,300	貸付株式数	1,300株
エスアールジータカミヤ	6,100	653.00	3,983,300	貸付株式数	2,300株
ジャパンベストレスキュー S	4,400	1,374.00	6,045,600	貸付株式数	1,700株
ファンコミュニケーション ズ	15,900	591.00	9,396,900	貸付株式数	6,200株
ライク	2,200	1,436.00	3,159,200	貸付株式数	800株
ビジネス・ブレークスルー	2,300	331.00	761,300		
WDBホールディングス	2,600	2,520.00	6,552,000		
ティア	2,600	622.00	1,617,200	貸付株式数	1,000株
C D G	500	1,282.00	641,000	貸付株式数	200株
バリューコマース	3,900	1,368.00	5,335,200	貸付株式数	1,500株
インフォマート	31,300	1,125.00	35,212,500	貸付株式数	12,400株
サッポロホールディングス	21,900	2,434.00	53,304,600	貸付株式数	8,700株
アサヒグループホールディ ン	126,400	4,450.00	562,480,000		
キリンHD	273,000	2,342.50	639,502,500		
宝ホールディングス	45,100	1,404.00	63,320,400		
オエノンホールディングス	16,900	359.00	6,067,100	貸付株式数	6,700株
養命酒	1,900	2,205.00	4,189,500		
コカ・コーラボトラーズJ HD	46,200	3,060.00	141,372,000		
サントリー食品インター	40,400	4,680.00	189,072,000		
ダイドーグループHD	3,400	5,650.00	19,210,000	貸付株式数	800株
伊藤園	20,000	4,905.00	98,100,000		
キーコーヒー	5,900	2,056.00	12,130,400		
ユニカフェ	1,800	1,128.00	2,030,400		
ジャパンフーズ	800	1,201.00	960,800		
日清オイリオグループ	7,700	3,195.00	24,601,500		
不二製油グループ	14,700	3,730.00	54,831,000		
かどや製油	600	5,710.00	3,426,000		
J - オイルミルズ	3,100	4,030.00	12,493,000		
ローソン	15,000	7,210.00	108,150,000		
サンエー	4,500	4,535.00	20,407,500		

カワチ薬品	4,600	1,921.00	8,836,600	
エービーシー・マート	9,200	6,130.00	56,396,000	
ハードオフコーポレーション	2,300	851.00	1,957,300	
高千穂交易	2,200	969.00	2,131,800	
アスクル	5,200	2,628.00	13,665,600	貸付株式数 2,000株
ゲオホールディングス	9,000	1,675.00	15,075,000	貸付株式数 3,500株
アダストリア	8,200	1,980.00	16,236,000	貸付株式数 700株
ジーフット	3,900	740.00	2,886,000	貸付株式数 1,000株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	700	712.00	498,400	
伊藤忠食品	1,400	4,790.00	6,706,000	
くらコーポレーション	3,500	5,620.00	19,670,000	
キャンドゥ	2,800	1,652.00	4,625,600	
エレマテック	2,700	2,017.00	5,445,900	
パルグループHLDGS	3,000	2,779.00	8,337,000	
JALUX	1,700	2,647.00	4,499,900	貸付株式数 200株
エディオン	25,100	1,104.00	27,710,400	
あらた	3,300	4,395.00	14,503,500	貸付株式数 1,200株
サーラコーポレーション	11,900	651.00	7,746,900	
ワッツ	2,000	751.00	1,502,000	貸付株式数 100株
トーメンデバイス	900	2,302.00	2,071,800	
ハローズ	2,200	2,350.00	5,170,000	
J Pホールディングス	16,100	265.00	4,266,500	貸付株式数 6,400株 (2,000株)
あみやき亭	1,300	3,780.00	4,914,000	
東京エレクトロンデバイス	2,100	1,726.00	3,624,600	
ひらまつ	11,600	340.00	3,944,000	貸付株式数 5,900株
フィールズ	5,200	843.00	4,383,600	貸付株式数 1,200株
双日	326,200	408.00	133,089,600	
アルフレッサホールディングス	65,800	2,960.00	194,768,000	
大黒天物産	1,400	4,360.00	6,104,000	貸付株式数 400株
ハニーズホールディングス	5,600	798.00	4,468,800	
ファーマライズHD	1,400	596.00	834,400	貸付株式数 500株 (500株)
キッコーマン	39,800	6,280.00	249,944,000	
味の素	135,500	1,972.50	267,273,750	貸付株式数 20,600株
キューピー	33,600	2,599.00	87,326,400	
ハウス食品G本社	23,000	3,935.00	90,505,000	

カゴメ	24,100	2,954.00	71,191,400	
焼津水産化工	2,900	1,008.00	2,923,200	貸付株式数 1,000株
アリアケジャパン	5,500	7,430.00	40,865,000	
ピエトロ	700	1,648.00	1,153,600	貸付株式数 200株
エバラ食品工業	1,400	2,132.00	2,984,800	
ニチレイ	31,300	3,125.00	97,812,500	
横浜冷凍	15,400	974.00	14,999,600	
東洋水産	31,100	4,005.00	124,555,500	
イトアンド	2,000	1,605.00	3,210,000	
大冷	700	1,760.00	1,232,000	
ヨシムラ・フード・HLD GS	1,600	556.00	889,600	
日清食品HD	25,600	7,130.00	182,528,000	
永谷園ホールディングス	3,100	2,550.00	7,905,000	
一正蒲鉾	2,300	1,024.00	2,355,200	貸付株式数 800株
フジッコ	6,500	2,383.00	15,489,500	
ロックフィールド	6,500	1,666.00	10,829,000	
日本たばこ産業	348,500	2,831.00	986,603,500	
ケンコーマヨネーズ	3,300	2,101.00	6,933,300	貸付株式数 200株
わらべや日洋HD	3,900	1,847.00	7,203,300	貸付株式数 600株
なとり	3,300	1,781.00	5,877,300	
イフジ産業	1,000	683.00	683,000	
ピクルスコーポレーション	1,400	2,310.00	3,234,000	貸付株式数 500株
北の達人コーポ	23,500	380.00	8,930,000	貸付株式数 9,400株
ユーグレナ	25,000	640.00	16,000,000	貸付株式数 9,800株 (5,800株)
片倉工業	7,200	1,137.00	8,186,400	
グンゼ	4,200	4,135.00	17,367,000	
ヒューリック	124,000	1,034.00	128,216,000	
神栄	700	959.00	671,300	貸付株式数 200株
ラサ商事	3,200	883.00	2,825,600	
アルペン	4,500	1,791.00	8,059,500	貸付株式数 1,800株
ハブ	1,900	980.00	1,862,000	
ラクーンホールディングス	3,400	660.00	2,244,000	貸付株式数 1,300株
クオールホールディングス	8,700	1,863.00	16,208,100	貸付株式数 2,700株
アルコニックス	6,200	1,148.00	7,117,600	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
神戸物産	8,900	3,130.00	27,857,000	
ソリトンシステムズ	3,300	777.00	2,564,100	貸付株式数 1,300株

ジンス	4,000	6,170.00	24,680,000		
ビックカメラ	31,600	1,525.00	48,190,000	貸付株式数	8,900株 (8,900株)
D C Mホールディングス	31,900	1,100.00	35,090,000	貸付株式数	12,600株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	4,700	3,325.00	15,627,500	貸付株式数	1,800株 (300株)
MonotaRO	37,400	2,893.00	108,198,200	貸付株式数	11,500株
東京一番フーズ	1,400	603.00	844,200	貸付株式数	500株 (500株)
DDホールディングス	1,300	2,220.00	2,886,000		
あいホールディングス	9,400	1,997.00	18,771,800	貸付株式数	3,700株
ディービーエックス	2,300	1,121.00	2,578,300		
きちり	1,500	810.00	1,215,000	貸付株式数	600株
アークランドサービスHD	4,300	2,287.00	9,834,100		
J. フロント リテイリング	75,600	1,464.00	110,678,400	貸付株式数	26,800株
ドトール・日レスHD	10,400	2,155.00	22,412,000		
マツモトキヨシHLDGS	24,500	3,695.00	90,527,500		
ブロンコビリー	3,100	2,873.00	8,906,300	貸付株式数	1,400株 (900株)
ZOZO	64,000	2,459.00	157,376,000	貸付株式数	22,500株
トレジャー・ファクトリー	1,700	689.00	1,171,300		
物語コーポレーション	1,700	9,490.00	16,133,000	貸付株式数	600株
ココカラファイン	6,700	5,610.00	37,587,000		
三越伊勢丹HD	110,700	1,300.00	143,910,000	貸付株式数	43,900株
東洋紡	24,900	1,554.00	38,694,600		
ユニチカ	17,300	499.00	8,632,700		
富士紡ホールディングス	3,000	2,799.00	8,397,000		
日清紡ホールディングス	33,200	886.00	29,415,200		
倉敷紡績	5,500	2,596.00	14,278,000		
ダイワボウHD	5,400	5,080.00	27,432,000		
シキボウ	3,200	1,069.00	3,420,800		
日東紡績	9,000	1,860.00	16,740,000		
トヨタ紡織	21,000	1,677.00	35,217,000		
マクニカ・富士エレHLDGS	16,400	1,446.00	23,714,400		
Hamee	1,500	1,232.00	1,848,000	貸付株式数	500株
ラクト・ジャパン	1,300	7,170.00	9,321,000	貸付株式数	500株
ウエルシアHD	15,600	5,820.00	90,792,000		

クリエイトSDH	8,800	2,768.00	24,358,400	
バイタルKSKHD	11,000	1,154.00	12,694,000	
八洲電機	6,000	794.00	4,764,000	貸付株式数 1,000株
メディアスホールディングス	3,200	683.00	2,185,600	
UKCホールディングス	3,800	2,060.00	7,828,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ジューテックHD	1,300	950.00	1,235,000	
丸善CHI HD	6,600	339.00	2,237,400	
大光	1,400	575.00	805,000	
OCHIホールディングス	1,800	1,150.00	2,070,000	
TOKAIホールディングス	31,200	926.00	28,891,200	
黒谷	1,000	434.00	434,000	貸付株式数 300株
ミサワ	1,000	445.00	445,000	
ティーライフ	800	992.00	793,600	貸付株式数 300株
Cominix	900	804.00	723,600	
エー・ピーカンパニー	900	506.00	455,400	貸付株式数 300株
三洋貿易	3,000	1,766.00	5,298,000	
チムニー	1,700	2,662.00	4,525,400	貸付株式数 600株
シュッピン	4,000	796.00	3,184,000	貸付株式数 1,500株
ビューティガレージ	800	1,717.00	1,373,600	
ウイン・パートナーズ	3,700	983.00	3,637,100	貸付株式数 1,000株
ネクステージ	9,000	1,054.00	9,486,000	貸付株式数 3,500株
ジョイフル本田	17,300	1,512.00	26,157,600	貸付株式数 4,600株
鳥貴族	1,900	1,934.00	3,674,600	貸付株式数 900株
キリン堂ホールディングス	2,300	1,441.00	3,314,300	
ホットランド	3,000	1,379.00	4,137,000	貸付株式数 1,400株 (1,300株)
すかいらーくHD	55,100	1,903.00	104,855,300	貸付株式数 21,800株 (2,800株)
綿半ホールディングス	2,200	2,400.00	5,280,000	貸付株式数 700株
日本毛織	19,700	845.00	16,646,500	
ダイトウボウ	12,700	88.00	1,117,600	貸付株式数 3,800株
トーア紡コーポレーション	2,600	517.00	1,344,200	
ガイドーリミテッド	6,900	349.00	2,408,100	貸付株式数 1,000株
ヨシックス	1,000	2,741.00	2,741,000	
ユナイテッド・スーパー マーケ	17,200	1,237.00	21,276,400	
三栄建築設計	2,600	1,521.00	3,954,600	

野村不動産HLDGS	40,300	2,108.00	84,952,400		
三重交通グループHD	12,500	595.00	7,437,500	貸付株式数	3,000株
サムティ	8,300	1,271.00	10,549,300	貸付株式数	3,200株
エー・ディー・ワークス	96,100	37.00	3,555,700		
日本商業開発	4,200	1,656.00	6,955,200	貸付株式数	1,900株
プレサンスコーポレーション	9,600	1,464.00	14,054,400	貸付株式数	3,600株
ユニゾホールディングス	9,100	2,191.00	19,938,100	貸付株式数	3,500株
日本管理センター	4,100	931.00	3,817,100		
サンセイランディック	1,900	919.00	1,746,100		
エストラスト	1,300	751.00	976,300		
フージャースHD	13,500	646.00	8,721,000	貸付株式数	6,000株
オープンハウス	9,600	3,780.00	36,288,000	貸付株式数	3,800株
東急不動産HD	160,200	569.00	91,153,800		
飯田GHD	49,600	2,021.00	100,241,600	貸付株式数	3,000株
イーグランド	1,100	675.00	742,500	貸付株式数	200株
帝国繊維	6,600	2,119.00	13,985,400		
日本コークス工業	50,100	95.00	4,759,500		
ゴルフダイジェスト・オン	2,400	752.00	1,804,800	貸付株式数	900株
ミタチ産業	1,400	722.00	1,010,800	貸付株式数	500株
B E E N O S	1,400	1,347.00	1,885,800		
あさひ	4,800	1,321.00	6,340,800		
日本調剤	2,100	3,455.00	7,255,500	貸付株式数	400株 (100株)
コスモス薬品	3,000	19,890.00	59,670,000	貸付株式数	1,100株
シップヘルスケアHD	12,300	4,275.00	52,582,500		
トーエル	2,800	708.00	1,982,400		
一六堂	1,200	499.00	598,800		
ソフトクリエイトHD	2,500	1,532.00	3,830,000		
オンリー	1,000	1,071.00	1,071,000		
セブン&アイ・HLDGS	248,200	4,888.00	1,213,201,600		
薬王堂	2,500	2,864.00	7,160,000	貸付株式数	1,000株
クリエイト・レストランツ・ホール	15,800	1,251.00	19,765,800	貸付株式数	6,200株
明治電機工業	1,800	1,738.00	3,128,400		
ツルハホールディングス	12,900	10,780.00	139,062,000		
デリカフーズHLDGS	1,000	1,416.00	1,416,000		
スターティアホールディングス	1,100	591.00	650,100	貸付株式数	400株

サンマルクホールディングス	4,700	2,699.00	12,685,300	
フェリシモ	1,300	1,189.00	1,545,700	貸付株式数 500株
トリドールホールディングス	7,300	2,060.00	15,038,000	貸付株式数 2,800株 (800株)
帝人	48,100	1,820.00	87,542,000	
東レ	456,700	799.00	364,903,300	
クラレ	99,300	1,572.00	156,099,600	
旭化成	418,900	1,144.00	479,221,600	
サカイオーベックス	1,400	2,187.00	3,061,800	
TOKYO BASE	5,200	578.00	3,005,600	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
稲葉製作所	3,200	1,318.00	4,217,600	
宮地エンジニアリングG	1,800	1,980.00	3,564,000	
トーカロ	15,300	865.00	13,234,500	
アルファCO	2,100	1,313.00	2,757,300	貸付株式数 800株
SUMCO	65,700	1,379.00	90,600,300	貸付株式数 17,800株
川田テクノロジーズ	1,300	7,650.00	9,945,000	
RS TECHNOLOGIES	1,200	2,971.00	3,565,200	貸付株式数 400株
ビーロット	1,000	1,412.00	1,412,000	貸付株式数 300株
ファーストブラザーズ	1,600	1,144.00	1,830,400	貸付株式数 500株
ハウスドゥ	2,300	1,068.00	2,456,400	貸付株式数 800株
シーアールイー	2,600	1,004.00	2,610,400	
プロパティエージェント	800	851.00	680,800	貸付株式数 200株
ケイアイスター不動産	1,800	1,687.00	3,036,600	貸付株式数 600株
アグレ都市デザイン	1,000	608.00	608,000	
ジェイ・エス・ビー	200	4,055.00	811,000	
テンポイノベーション	500	1,486.00	743,000	
住江織物	1,600	2,618.00	4,188,800	貸付株式数 500株
日本フェルト	3,200	460.00	1,472,000	
イチカワ	800	1,432.00	1,145,600	
エコナックホールディングス	10,400	103.00	1,071,200	
日東製網	600	1,281.00	768,600	
芦森工業	1,200	1,453.00	1,743,600	
アツギ	4,800	990.00	4,752,000	
ウイルプラスHLDGS	500	894.00	447,000	
ジャパンミート	2,200	2,033.00	4,472,600	
コマダホールディングス	13,600	2,259.00	30,722,400	

サツドラホールディングス	1,000	1,901.00	1,901,000	
デファクトスタンダード	400	502.00	200,800	貸付株式数 100株
ダイユー・リックHLDGS	3,200	1,006.00	3,219,200	
バロックジャパン	4,700	1,033.00	4,855,100	
クスリのアオキHLDGS	4,700	7,690.00	36,143,000	
ダイニック	2,400	756.00	1,814,400	
共和レザー	3,400	790.00	2,686,000	貸付株式数 1,300株
力の源HD	1,600	757.00	1,211,200	
スシローグローバルHLDGS	6,500	6,080.00	39,520,000	
LIXILビバ	4,900	1,763.00	8,638,700	貸付株式数 1,000株
セーレン	14,400	1,741.00	25,070,400	
ソトー	2,200	955.00	2,101,000	
東海染工	700	1,054.00	737,800	
小松マテーレ	9,600	796.00	7,641,600	
ワコールホールディングス	17,200	2,904.00	49,948,800	
ホギメディカル	7,300	3,180.00	23,214,000	
レナウン	16,700	100.00	1,670,000	
クラウドディアHLDGS	1,400	472.00	660,800	
T S Iホールディングス	21,500	694.00	14,921,000	貸付株式数 100株
マツオカコーポレーション	1,800	3,085.00	5,553,000	
ワールド	6,000	1,593.00	9,558,000	貸付株式数 2,400株
T I S	19,700	4,725.00	93,082,500	
ネオス	2,100	1,242.00	2,608,200	貸付株式数 800株
電算システム	2,200	2,251.00	4,952,200	貸付株式数 800株 (800株)
グリー	31,800	448.00	14,246,400	
コーエーテクモHD	12,100	1,922.00	23,256,200	
三菱総合研究所	2,300	3,230.00	7,429,000	
ボルテージ	1,200	607.00	728,400	貸付株式数 400株
電算	700	2,091.00	1,463,700	
A G S	3,300	671.00	2,214,300	
ファインデックス	5,000	596.00	2,980,000	貸付株式数 1,900株
ヒト・コミュニケーションズ	1,300	1,566.00	2,035,800	
ブレインパッド	1,300	6,150.00	7,995,000	
K L a b	10,500	878.00	9,219,000	貸付株式数 4,100株
ポールトゥウィン・ピットクル	3,900	1,936.00	7,550,400	貸付株式数 1,200株

イーブックイニシアティブ	900	1,680.00	1,512,000	貸付株式数	300株
ネクソン	150,200	1,311.00	196,912,200		
アイスタイル	15,000	898.00	13,470,000	貸付株式数	6,000株
エムアップ	2,000	1,889.00	3,778,000	貸付株式数	800株
エイチーム	3,600	1,477.00	5,317,200	貸付株式数	1,700株
テクノスジャパン	4,900	827.00	4,052,300	貸付株式数	2,000株
e n i s h	2,000	436.00	872,000		
コロプラ	16,900	801.00	13,536,900	貸付株式数	4,500株 (4,500株)
オルトプラス	3,600	340.00	1,224,000	貸付株式数	1,400株
ブロードリーフ	29,200	568.00	16,585,600	貸付株式数	11,500株
クロス・マーケティングG	1,700	346.00	588,200		
デジタルハーツHLDGS	2,700	1,586.00	4,282,200	貸付株式数	1,100株
メディアドゥHLDGS	1,800	2,450.00	4,410,000	貸付株式数	900株
じげん	6,300	526.00	3,313,800	貸付株式数	2,400株
ブイキューブ	3,100	396.00	1,227,600		
サイバーリンクス	900	1,016.00	914,400	貸付株式数	300株
ディー・エル・イー	3,800	206.00	782,800	貸付株式数	1,500株
フィックスターズ	5,600	1,075.00	6,020,000	貸付株式数	2,200株
VOYAGE GROUP	3,100	1,055.00	3,270,500		
オプティム	1,300	4,660.00	6,058,000	貸付株式数	500株
セレス	1,900	1,748.00	3,321,200	貸付株式数	700株
特種東海製紙	3,700	4,205.00	15,558,500		
ベリサーブ	600	4,820.00	2,892,000	貸付株式数	200株
ティーガイア	5,900	2,130.00	12,567,000		
セック	900	3,740.00	3,366,000		
日本アジアグループ	6,400	338.00	2,163,200		
豆蔵ホールディングス	4,000	1,029.00	4,116,000	貸付株式数	1,700株
テクマトリックス	4,100	1,781.00	7,302,100		
プロシップ	800	2,477.00	1,981,600		
ガンホー・オンライン・エンター	141,900	211.00	29,940,900	貸付株式数	53,800株
GMOペイメントゲートウェイ	9,700	4,990.00	48,403,000	貸付株式数	3,800株
ザッパラス	3,000	389.00	1,167,000		
システムリサーチ	800	2,768.00	2,214,400		
インターネットイニシアティブ	9,600	2,488.00	23,884,800		
さくらインターネット	7,000	493.00	3,451,000	貸付株式数	2,800株
ヴィンクス	2,000	1,325.00	2,650,000		

GMOクラウド	1,300	3,260.00	4,238,000	
S R Aホールディングス	3,100	2,737.00	8,484,700	
M I N O R Iソリューションズ	1,100	1,620.00	1,782,000	
システムインテグレータ	1,600	833.00	1,332,800	貸付株式数 600株
朝日ネット	4,900	511.00	2,503,900	
e B A S E	1,700	1,520.00	2,584,000	
アバント	1,600	1,188.00	1,900,800	
アドソル日進	2,000	1,814.00	3,628,000	
フリービット	4,000	787.00	3,148,000	
コムチュア	3,300	3,215.00	10,609,500	
サイバーコム	1,000	1,850.00	1,850,000	
アステリア	2,900	761.00	2,206,900	
王子ホールディングス	265,200	603.00	159,915,600	
日本製紙	28,400	2,070.00	58,788,000	貸付株式数 600株
三菱製紙	9,800	532.00	5,213,600	貸付株式数 4,300株
北越コーポレーション	39,200	527.00	20,658,400	貸付株式数 1,000株
中越パルプ	2,600	1,470.00	3,822,000	
巴川製紙	1,900	1,026.00	1,949,400	
大王製紙	28,800	1,286.00	37,036,800	貸付株式数 9,200株 (6,200株)
阿波製紙	1,500	497.00	745,500	貸付株式数 500株
マークラインズ	2,000	1,215.00	2,430,000	
メディカル・データ・ビジ	5,200	989.00	5,142,800	貸付株式数 2,000株
g u m i	6,700	528.00	3,537,600	貸付株式数 2,600株
ショーケース・ティービー	1,200	677.00	812,400	貸付株式数 400株
モバイルファクトリー	1,600	1,138.00	1,820,800	貸付株式数 600株
デジタル・インフォメーション	2,600	1,546.00	4,019,600	貸付株式数 1,000株
P C Iホールディングス	1,000	2,204.00	2,204,000	
パイプドHD	900	1,007.00	906,300	
アイビーシー	900	1,083.00	974,700	貸付株式数 300株
ネオジャパン	1,100	681.00	749,100	貸付株式数 400株
P R T I M E S	400	2,117.00	846,800	貸付株式数 100株
ランドコンピュータ	700	1,011.00	707,700	
オープンドア	2,900	2,470.00	7,163,000	
マイネット	1,900	1,987.00	3,775,300	貸付株式数 700株
アカツキ	2,100	5,770.00	12,117,000	貸付株式数 600株
ベネフィットジャパン	300	741.00	222,300	

UBICOMホールディングス	1,100	1,053.00	1,158,300	貸付株式数	400株
LINE	18,000	3,620.00	65,160,000	貸付株式数	7,100株 (2,100株)
カナミックネットワーク	900	1,783.00	1,604,700	貸付株式数	300株
ノムラシステムコーポレーション	500	911.00	455,500		
レンゴー	60,500	837.00	50,638,500		
トーモク	3,500	1,660.00	5,810,000	貸付株式数	1,400株
ザ・パック	4,400	3,120.00	13,728,000		
チェンジ	400	6,620.00	2,648,000	貸付株式数	100株
シンクロ・フード	2,400	530.00	1,272,000	貸付株式数	900株
オークネット	3,100	1,046.00	3,242,600	貸付株式数	1,200株
AOI TYO HOLDINGS	6,400	828.00	5,299,200	貸付株式数	1,000株
マクロミル	7,400	1,547.00	11,447,800	貸付株式数	2,000株
ビーグリー	1,100	904.00	994,400		
オロ	600	4,110.00	2,466,000	貸付株式数	200株
昭和電工	39,100	3,840.00	150,144,000		
住友化学	463,400	552.00	255,796,800		
住友精化	2,900	4,275.00	12,397,500		
日産化学	36,100	6,000.00	216,600,000		
ラサ工業	2,100	1,326.00	2,784,600	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,400	6,490.00	35,046,000		
多木化学	900	8,990.00	8,091,000	貸付株式数	300株
テイカ	4,800	1,751.00	8,404,800		
石原産業	11,200	1,046.00	11,715,200		
片倉コープアグリ	2,200	1,157.00	2,545,400		
日東エフシー	4,600	751.00	3,454,600		
日本曹達	9,300	2,796.00	26,002,800		
東ソー	90,900	1,461.00	132,804,900		
トクヤマ	16,900	2,599.00	43,923,100	貸付株式数	3,500株
セントラル硝子	12,800	2,293.00	29,350,400		
東亜合成	36,800	1,219.00	44,859,200		
大阪ソーダ	6,400	2,518.00	16,115,200	貸付株式数	2,600株
関東電化	13,900	810.00	11,259,000		
デンカ	23,100	3,180.00	73,458,000		
イビデン	36,800	1,620.00	59,616,000	貸付株式数	14,600株
信越化学	103,700	9,003.00	933,611,100	貸付株式数	40,600株
日本カ-バイド	2,000	1,757.00	3,514,000		

堺化学	3,900	2,409.00	9,395,100	
第一稀元素化学工	4,800	865.00	4,152,000	
エア・ウォーター	47,900	1,713.00	82,052,700	貸付株式数 12,000株
大陽日酸	48,300	1,936.00	93,508,800	
日本化学工業	2,000	2,294.00	4,588,000	
東邦アセチレン	1,000	1,354.00	1,354,000	
日本パ・カラライジング	32,000	1,305.00	41,760,000	
高压ガス	9,600	816.00	7,833,600	
チタン工業	800	2,387.00	1,909,600	貸付株式数 200株
四国化成	9,900	1,102.00	10,909,800	
戸田工業	1,300	2,225.00	2,892,500	貸付株式数 400株
ステラ ケミファ	3,400	2,778.00	9,445,200	貸付株式数 1,300株
保土谷化学	2,000	2,100.00	4,200,000	
日本触媒	9,900	6,900.00	68,310,000	貸付株式数 2,800株
大日精化	4,900	2,748.00	13,465,200	
カネカ	15,600	4,095.00	63,882,000	
協和発酵キリン	75,300	2,236.00	168,370,800	貸付株式数 20,000株
三菱瓦斯化学	60,400	1,715.00	103,586,000	
三井化学	53,400	2,565.00	136,971,000	
J S R	59,000	1,702.00	100,418,000	
東京応化工業	10,100	3,170.00	32,017,000	
大阪有機化学	5,400	1,160.00	6,264,000	貸付株式数 1,700株
三菱ケミカルHLDGS	393,300	825.00	324,472,500	貸付株式数 161,600株
KHネオケム	8,900	2,309.00	20,550,100	
ダイセル	91,400	1,189.00	108,674,600	
住友ベークライト	10,100	3,905.00	39,440,500	
積水化学	128,800	1,714.00	220,763,200	
日本ゼオン	53,000	1,053.00	55,809,000	貸付株式数 21,000株 (21,000株)
アイカ工業	17,700	3,520.00	62,304,000	
宇部興産	29,700	2,305.00	68,458,500	
積水樹脂	9,700	1,940.00	18,818,000	
タキロンシーアイ	12,600	615.00	7,749,000	
旭有機材	4,000	1,499.00	5,996,000	貸付株式数 700株
日立化成	27,200	1,633.00	44,417,600	
ニチバン	3,100	1,953.00	6,054,300	
リケンテクノス	16,300	454.00	7,400,200	
大倉工業	3,000	1,965.00	5,895,000	
積水化成成品	8,700	935.00	8,134,500	
群栄化学	1,700	2,754.00	4,681,800	貸付株式数 600株

タイガース ポリマー	2,800	632.00	1,769,600	
ミライアル	1,700	924.00	1,570,800	
ダイキアクシス	2,000	968.00	1,936,000	貸付株式数 800株
ダイキョーニシカワ	12,400	1,099.00	13,627,600	
竹本容器	1,000	2,970.00	2,970,000	
森六ホールディングス	3,200	2,728.00	8,729,600	
日本化薬	37,400	1,425.00	53,295,000	
カーリットホールディングス	6,300	775.00	4,882,500	貸付株式数 2,400株
E P Sホールディングス	8,500	1,825.00	15,512,500	
ソルクシーズ	2,400	679.00	1,629,600	貸付株式数 900株
レッグス	1,500	1,012.00	1,518,000	貸付株式数 500株 (500株)
プレステージ・インター	10,700	1,275.00	13,642,500	
フェイス	2,300	996.00	2,290,800	
ハイマックス	700	1,667.00	1,166,900	
アミューズ	3,400	2,359.00	8,020,600	
野村総合研究所	37,600	4,520.00	169,952,000	
ドリームインキュベータ	1,700	1,505.00	2,558,500	貸付株式数 800株
サイバネットシステム	4,800	595.00	2,856,000	貸付株式数 1,900株
クイック	3,500	1,296.00	4,536,000	
T A C	3,100	228.00	706,800	
C Eホールディングス	1,500	660.00	990,000	
ケネディクス	53,800	461.00	24,801,800	
日本システム技術	900	1,732.00	1,558,800	貸付株式数 300株
電通	70,000	5,020.00	351,400,000	貸付株式数 400株 (400株)
インテージホールディングス	7,600	938.00	7,128,800	
テイクアンドギヴニーズ	2,200	2,004.00	4,408,800	
東邦システムサイエンス	1,800	879.00	1,582,200	
びあ	1,600	4,265.00	6,824,000	貸付株式数 700株
イオンファンタジー	1,800	2,940.00	5,292,000	貸付株式数 700株
ソースネクスト	22,800	562.00	12,813,600	貸付株式数 9,000株
シーティーエス	6,400	625.00	4,000,000	
ネクシーズグループ	1,700	1,826.00	3,104,200	
メディカルシステムネット ワーク	6,200	385.00	2,387,000	
日本精化	4,900	1,040.00	5,096,000	貸付株式数 1,300株
扶桑化学工業	5,900	2,092.00	12,342,800	

トリケミカル	1,300	4,620.00	6,006,000	
F I G	5,100	340.00	1,734,000	貸付株式数 1,000株
A D E K A	28,900	1,648.00	47,627,200	
日油	22,600	3,855.00	87,123,000	
ミヨシ油脂	2,800	1,153.00	3,228,400	貸付株式数 1,000株
新日本理化	11,300	158.00	1,785,400	
ハリマ化成グループ	5,000	997.00	4,985,000	
花 王	146,000	7,961.00	1,162,306,000	
第一工業製薬	2,200	3,120.00	6,864,000	貸付株式数 800株
石原ケミカル	1,600	1,831.00	2,929,600	
日華化学	2,100	1,134.00	2,381,400	貸付株式数 800株
ニイタカ	900	1,698.00	1,528,200	
三洋化成	4,000	5,170.00	20,680,000	
武田薬品	237,300	3,590.00	851,907,000	貸付株式数 94,100株 (800株)
アステラス製薬	554,200	1,554.50	861,503,900	貸付株式数 217,600株
大日本住友製薬	44,500	3,715.00	165,317,500	
塩野義製薬	78,600	6,792.00	533,851,200	
田辺三菱製薬	62,900	1,667.00	104,854,300	
わかもと製薬	7,100	265.00	1,881,500	
あすか製薬	7,400	1,162.00	8,598,800	
日本新薬	15,700	7,450.00	116,965,000	
ビオフェルミン製薬	1,000	2,643.00	2,643,000	
中外製薬	62,700	7,140.00	447,678,000	貸付株式数 4,400株
科研製薬	10,700	5,170.00	55,319,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
エーザイ	71,900	9,301.00	668,741,900	
理研ビタミン	2,800	3,570.00	9,996,000	
ロート製薬	30,800	3,290.00	101,332,000	
小野薬品	141,900	2,577.00	365,676,300	
久光製薬	17,800	6,660.00	118,548,000	
有機合成薬品	6,700	211.00	1,413,700	
持田製薬	4,500	9,800.00	44,100,000	
参天製薬	113,900	1,737.00	197,844,300	
扶桑薬品	2,100	2,653.00	5,571,300	
日本ケミファ	800	3,270.00	2,616,000	
ツムラ	18,600	3,315.00	61,659,000	
日医工	14,900	1,859.00	27,699,100	
テ ル モ	85,100	6,264.00	533,066,400	
みらかホールディングス	16,000	2,654.00	42,464,000	

キッセイ薬品工業	10,600	3,060.00	32,436,000	
生化学工業	11,600	1,353.00	15,694,800	
栄研化学	10,500	2,550.00	26,775,000	貸付株式数 3,800株
日水製薬	2,500	1,118.00	2,795,000	
鳥居薬品	3,200	2,600.00	8,320,000	
JCRファーマ	4,200	5,250.00	22,050,000	
東和薬品	2,900	8,350.00	24,215,000	貸付株式数 1,100株
富士製薬工業	4,000	1,760.00	7,040,000	
沢井製薬	12,300	6,040.00	74,292,000	
ゼリア新薬工業	11,800	1,997.00	23,564,600	
第一三共	172,000	3,995.00	687,140,000	
キョーリン製薬HD	15,100	2,564.00	38,716,400	
大幸薬品	2,700	1,796.00	4,849,200	貸付株式数 1,000株
ダイト	3,400	3,120.00	10,608,000	
大塚ホールディングス	114,500	5,255.00	601,697,500	
大正製薬HD	13,500	12,200.00	164,700,000	
ペプチドリーム	27,600	4,480.00	123,648,000	貸付株式数 9,400株
大日本塗料	7,000	1,009.00	7,063,000	貸付株式数 2,000株
日本ペイントHOLD	48,500	3,835.00	185,997,500	貸付株式数 19,200株
関西ペイント	66,100	2,064.00	136,430,400	貸付株式数 26,200株
神東塗料	7,900	168.00	1,327,200	貸付株式数 1,000株
中国塗料	19,200	976.00	18,739,200	貸付株式数 5,600株
日本特殊塗料	4,300	1,361.00	5,852,300	
藤倉化成	8,700	617.00	5,367,900	
太陽ホールディングス	4,900	3,265.00	15,998,500	
DIC	26,500	3,500.00	92,750,000	
サカイクス	12,800	1,171.00	14,988,800	貸付株式数 5,100株
東洋インキSCホールディングン	12,500	2,581.00	32,262,500	
T&K TOKA	5,000	1,034.00	5,170,000	貸付株式数 2,000株
アルプス技研	5,000	1,773.00	8,865,000	
サニックス	10,000	189.00	1,890,000	貸付株式数 2,200株
ダイオーズ	1,300	1,400.00	1,820,000	
日本空調サービス	6,500	727.00	4,725,500	貸付株式数 600株
オリエンタルランド	67,900	11,195.00	760,140,500	
フォーカスシステムズ	3,900	1,009.00	3,935,100	
ダスキン	15,500	2,456.00	38,068,000	
パーク24	34,600	2,660.00	92,036,000	貸付株式数 9,700株
明光ネットワークジャパン	7,200	928.00	6,681,600	貸付株式数 2,900株
ファルコホールディングス	3,200	1,545.00	4,944,000	貸付株式数 1,000株

クレスコ	1,800	3,140.00	5,652,000	
フジ・メディア・HD	60,900	1,590.00	96,831,000	
秀英予備校	1,500	487.00	730,500	貸付株式数 600株
田谷	1,400	639.00	894,600	
ラウンドワン	17,700	1,126.00	19,930,200	
リゾートトラスト	24,200	1,622.00	39,252,400	貸付株式数 3,000株
オービック	20,500	8,860.00	181,630,000	
ジャストシステム	8,400	2,275.00	19,110,000	貸付株式数 3,800株
TDCソフト	5,100	848.00	4,324,800	貸付株式数 1,000株
ヤフー	385,100	282.00	108,598,200	
ビー・エム・エル	7,400	2,842.00	21,030,800	
ワタベウェディング	1,000	665.00	665,000	
トレンドマイクロ	31,500	6,280.00	197,820,000	貸付株式数 3,900株 (3,800株)
りらいあコミュニケーション	10,400	946.00	9,838,400	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
インフォメーションディベロ	1,600	1,272.00	2,035,200	
リソー教育	28,800	386.00	11,116,800	
日本オラクル	9,600	6,900.00	66,240,000	
早稲田アカデミー	800	2,011.00	1,608,800	
アルファシステムズ	1,900	2,740.00	5,206,000	
フューチャー	8,000	1,554.00	12,432,000	
CAC HOLDINGS	4,400	992.00	4,364,800	貸付株式数 1,000株
ソフトバンク・テクノ	2,500	1,796.00	4,490,000	貸付株式数 1,000株
トーセ	1,600	830.00	1,328,000	貸付株式数 600株
ユー・エス・エス	70,200	1,915.00	134,433,000	
オービックビジネスC	3,000	9,390.00	28,170,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	26,900	2,100.00	56,490,000	
アイティフォー	7,100	693.00	4,920,300	貸付株式数 2,800株
東京個別指導学院	2,000	1,168.00	2,336,000	
東計電算	900	3,150.00	2,835,000	
サイバーエージェント	35,400	4,685.00	165,849,000	貸付株式数 14,000株
楽天	267,800	826.00	221,202,800	
エクスネット	1,100	879.00	966,900	
クリーク・アンド・リバー社	3,400	997.00	3,389,800	貸付株式数 1,300株
テー・オー・ダブリュー	5,400	762.00	4,114,800	
大塚商会	31,900	3,295.00	105,110,500	
サイボウズ	6,800	643.00	4,372,400	

ソフトブレン	4,500	463.00	2,083,500	貸付株式数	1,000株
セントラルスポーツ	2,100	3,605.00	7,570,500		
バラカ	1,500	1,724.00	2,586,000	貸付株式数	800株
電通国際情報S	3,600	2,973.00	10,702,800	貸付株式数	900株
デジタルガレージ	11,500	2,687.00	30,900,500	貸付株式数	4,500株
イーエムシステムズ	4,800	1,041.00	4,996,800	貸付株式数	1,800株
ウェザーニューズ	2,000	3,035.00	6,070,000	貸付株式数	700株 (700株)
C I J	4,600	710.00	3,266,000	貸付株式数	1,000株
東洋ビジネスエンジ	600	2,012.00	1,207,200	貸付株式数	200株
日本エンタープライズ	5,800	203.00	1,177,400	貸付株式数	2,200株
WOWOW	2,800	3,090.00	8,652,000	貸付株式数	1,200株
スカラ	4,700	739.00	3,473,300		
フルキャストホールディングス	5,700	1,844.00	10,510,800		
エン・ジャパン	6,300	4,030.00	25,389,000		
富士フイルムHLDGS	124,900	4,387.00	547,936,300	貸付株式数	49,500株
コニカミノルタ	131,400	1,029.00	135,210,600		
資生堂	119,400	6,953.00	830,188,200	貸付株式数	6,500株
ライオン	83,700	2,226.00	186,316,200		
高砂香料	4,100	3,430.00	14,063,000		
マンダム	13,500	3,220.00	43,470,000	貸付株式数	2,900株 (2,900株)
ミルボン	7,400	4,360.00	32,264,000		
ファンケル	26,700	2,788.00	74,439,600		
コーセー	10,200	16,720.00	170,544,000		
コタ	2,800	1,437.00	4,023,600		
シーズ・ホールディングス	7,400	5,870.00	43,438,000		
シーボン	700	2,701.00	1,890,700		
ポーラ・オルビスHD	25,700	2,824.00	72,576,800	貸付株式数	10,100株
ノエビアホールディングス	3,800	4,855.00	18,449,000		
アジュバンコスメジャパン	1,300	951.00	1,236,300	貸付株式数	500株
エステー	4,300	1,935.00	8,320,500		
アグロカネショウ	2,400	1,962.00	4,708,800		
コニシ	10,600	1,648.00	17,468,800		
長谷川香料	7,200	1,520.00	10,944,000		
星光PMC	4,300	760.00	3,268,000		
小林製薬	16,900	7,390.00	124,891,000	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
荒川化学工業	5,400	1,433.00	7,738,200		

メック	4,100	1,139.00	4,669,900	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	2,000	2,329.00	4,658,000	
タカラバイオ	15,600	2,674.00	41,714,400	
J C U	7,700	1,515.00	11,665,500	
新田ゼラチン	3,700	682.00	2,523,400	貸付株式数 2,000株
O A T アグリオ	800	2,053.00	1,642,400	
デクセリアルズ	15,400	809.00	12,458,600	貸付株式数 300株
アース製薬	4,500	5,140.00	23,130,000	貸付株式数 1,700株
北興化学	6,500	465.00	3,022,500	
大成ラミック	1,900	2,965.00	5,633,500	
クミアイ化学	24,600	759.00	18,671,400	
日本農薬	14,600	478.00	6,978,800	
昭和シエル石油	55,600	1,574.00	87,514,400	
富士興産	2,200	607.00	1,335,400	
ニチレキ	7,700	1,096.00	8,439,200	貸付株式数 1,000株
ユシロ化学	3,100	1,208.00	3,744,800	貸付株式数 1,900株
ビーピー・カストロール	2,200	1,432.00	3,150,400	貸付株式数 800株
富士石油	14,300	288.00	4,118,400	
M O R E S C O	2,400	1,578.00	3,787,200	
出光興産	46,600	3,690.00	171,954,000	貸付株式数 18,100株 (18,100株)
J X T G ホールディングス	1,011,700	594.00	600,949,800	
コスモエネルギーH L D G S	17,400	2,450.00	42,630,000	貸付株式数 6,800株 (4,500株)
横浜ゴム	34,700	2,262.00	78,491,400	
東洋ゴム	30,800	1,508.00	46,446,400	
ブリヂストン	184,800	4,471.00	826,240,800	貸付株式数 1,500株
住友ゴム	53,800	1,403.00	75,481,400	
藤倉ゴム	4,900	463.00	2,268,700	貸付株式数 1,000株
オカモト	4,200	5,870.00	24,654,000	
アキレス	4,300	2,150.00	9,245,000	
フ コ ク	2,500	904.00	2,260,000	
ニッタ	6,800	3,635.00	24,718,000	
クリエートメディック	1,800	1,035.00	1,863,000	
住友理工	11,700	961.00	11,243,700	
三ツ星ベルト	7,900	2,133.00	16,850,700	
バンドー化学	11,400	1,120.00	12,768,000	
A G C	59,700	3,535.00	211,039,500	
日本板硝子	28,700	870.00	24,969,000	貸付株式数 11,300株

石塚硝子	800	2,039.00	1,631,200	貸付株式数	300株
有沢製作所	9,300	770.00	7,161,000	貸付株式数	2,300株
日本山村硝子	2,400	1,571.00	3,770,400		
日本電気硝子	26,100	2,842.00	74,176,200		
オハラ	2,400	1,738.00	4,171,200		
住友大阪セメント	12,100	4,660.00	56,386,000		
太平洋セメント	38,000	3,570.00	135,660,000		
リソルホールディングス	600	3,875.00	2,325,000		
日本ヒュ - ム	5,900	881.00	5,197,900		
日本コンクリ - ト	12,900	264.00	3,405,600		
三谷セキサン	2,800	2,800.00	7,840,000		
アジアパイルHD	8,300	639.00	5,303,700	貸付株式数	2,900株
東海カーボン	54,500	1,396.00	76,082,000	貸付株式数	21,600株
日本カーボン	2,900	4,535.00	13,151,500	貸付株式数	1,100株
東洋炭素	3,500	2,368.00	8,288,000		
ノリタケ	3,600	4,695.00	16,902,000		
TOTO	46,300	4,000.00	185,200,000	貸付株式数	18,300株
日本碍子	73,400	1,573.00	115,458,200		
日本特殊陶業	50,700	2,207.00	111,894,900		
ダントーホールディングス	5,600	106.00	593,600		
MARUWA	2,100	5,950.00	12,495,000		
品川リフラクトリーズ	1,600	3,890.00	6,224,000		
黒崎播磨	1,200	7,040.00	8,448,000	貸付株式数	400株 (400株)
ヨータイ	5,100	611.00	3,116,100	貸付株式数	1,900株
イソライト	3,100	452.00	1,401,200	貸付株式数	1,200株
東京窯業	7,500	388.00	2,910,000	貸付株式数	1,000株
ニッカトー	2,700	868.00	2,343,600		
フジインコーポレーテッド	5,400	2,155.00	11,637,000		
クニミネ工業	2,000	891.00	1,782,000		
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,005.00	1,105,500		
ニチアス	16,500	1,969.00	32,488,500		
新日鐵住金	266,300	1,998.50	532,200,550		
神戸製鋼所	108,700	831.00	90,329,700		
中山製鋼所	7,900	501.00	3,957,900		
合同製鐵	2,800	1,673.00	4,684,400		
JFEホールディングス	160,500	1,863.00	299,011,500		
日新製鋼	14,400	1,416.00	20,390,400		
東京製鐵	31,800	928.00	29,510,400		

共英製鋼	6,700	1,726.00	11,564,200	
大和工業	12,600	2,687.00	33,856,200	
東京鐵鋼	2,500	1,211.00	3,027,500	貸付株式数 600株
大阪製鐵	4,000	1,862.00	7,448,000	
淀川製鋼所	8,000	2,261.00	18,088,000	貸付株式数 2,000株
丸一鋼管	21,100	3,520.00	74,272,000	
モリ工業	1,700	2,482.00	4,219,400	
大同特殊鋼	9,800	4,485.00	43,953,000	
日本高周波	2,100	606.00	1,272,600	
日本冶金工	48,900	239.00	11,687,100	貸付株式数 19,900株
山陽特殊製鋼	7,500	2,450.00	18,375,000	
愛知製鋼	3,300	3,655.00	12,061,500	
日立金属	64,100	1,202.00	77,048,200	貸付株式数 3,000株
日本金属	1,400	1,194.00	1,671,600	
大平洋金属	4,000	2,946.00	11,784,000	貸付株式数 1,500株
新日本電工	35,300	230.00	8,119,000	貸付株式数 14,000株
栗本鉄工所	3,100	1,437.00	4,454,700	
虹 技	800	1,452.00	1,161,600	貸付株式数 200株
日本鑄鉄管	500	1,172.00	586,000	貸付株式数 200株
日本製鋼所	18,000	1,891.00	34,038,000	
三菱製鋼	4,400	1,764.00	7,761,600	
日亜鋼業	8,400	309.00	2,595,600	
日本精線	800	3,275.00	2,620,000	貸付株式数 200株
エンビプロHD	1,200	505.00	606,000	
大紀アルミニウム	9,700	573.00	5,558,100	貸付株式数 4,600株
日本軽金属HD	162,200	232.00	37,630,400	
三井金属	16,000	2,347.00	37,552,000	
東邦亜鉛	3,300	3,480.00	11,484,000	
三菱マテリアル	39,300	3,115.00	122,419,500	
住友鉱山	81,400	3,159.00	257,142,600	
DOWAホールディングス	13,900	3,505.00	48,719,500	
古河機金	9,800	1,223.00	11,985,400	貸付株式数 3,900株
エス・サイエンス	26,400	59.00	1,557,600	貸付株式数 10,400株
大阪チタニウム	6,900	1,866.00	12,875,400	貸付株式数 2,500株 (1,800株)
東邦チタニウム	10,600	1,064.00	11,278,400	
UACJ	9,000	2,435.00	21,915,000	貸付株式数 3,500株 (100株)
CKサンエツ	1,100	2,453.00	2,698,300	
古河電工	17,200	2,823.00	48,555,600	

住友電工	222,400	1,499.50	333,488,800	
フジクラ	71,900	452.00	32,498,800	
昭和電線HLDGS	7,000	625.00	4,375,000	貸付株式数 3,000株
東京特殊電線	700	1,924.00	1,346,800	
タツタ電線	11,800	496.00	5,852,800	
カナレ電気	1,000	1,866.00	1,866,000	貸付株式数 400株
平河ヒューテック	2,400	1,108.00	2,659,200	
リョービ	7,300	2,736.00	19,972,800	
アーレステイ	7,200	634.00	4,564,800	
アサヒHD	11,100	2,342.00	25,996,200	
東洋製罐グループHD	37,800	2,557.00	96,654,600	
ホッカンホールディングス	3,000	1,807.00	5,421,000	
コロナ	3,200	1,113.00	3,561,600	
横河ブリッジHLDGS	11,000	1,720.00	18,920,000	貸付株式数 3,000株
OSJBHD	29,700	308.00	9,147,600	
駒井ハルテック	1,100	1,974.00	2,171,400	
高田機工	500	2,715.00	1,357,500	
三和ホールディングス	61,500	1,272.00	78,228,000	
文化シャツタ-	17,500	723.00	12,652,500	
三協立山	8,200	1,178.00	9,659,600	
アルインコ	4,700	979.00	4,601,300	貸付株式数 1,000株
東洋シャツタ-	1,400	621.00	869,400	
LIXILグループ	87,700	1,331.00	116,728,700	
日本ファイルコン	4,400	522.00	2,296,800	
ノーリツ	13,300	1,491.00	19,830,300	
長府製作所	6,100	2,238.00	13,651,800	
リンナイ	10,600	7,400.00	78,440,000	
ユニプレス	11,600	1,938.00	22,480,800	
ダイニチ工業	3,100	698.00	2,163,800	
日東精工	8,200	591.00	4,846,200	
三洋工業	700	1,985.00	1,389,500	
岡部	12,200	921.00	11,236,200	
ジーテクト	6,500	1,471.00	9,561,500	貸付株式数 2,500株
中国工業	900	538.00	484,200	
東プレ	10,900	2,286.00	24,917,400	
高周波熱錬	11,500	882.00	10,143,000	貸付株式数 1,700株
東京製綱	3,600	999.00	3,596,400	貸付株式数 1,400株
サンコール	3,200	672.00	2,150,400	
モリテックスチル	4,500	418.00	1,881,000	貸付株式数 1,800株
パイオラックス	9,500	2,282.00	21,679,000	貸付株式数 500株

エイチワン	5,800	998.00	5,788,400	
日本発条	59,300	1,011.00	59,952,300	
中央発條	700	3,370.00	2,359,000	
アドバネクス	800	1,253.00	1,002,400	
三浦工業	25,800	2,630.00	67,854,000	
タクマ	21,700	1,425.00	30,922,500	
テクノプロ・ホールディング	10,800	4,665.00	50,382,000	
アトラ	1,200	478.00	573,600	貸付株式数 400株
インターワークス	1,100	710.00	781,000	
アイ・アールジャパンHD	1,800	1,346.00	2,422,800	貸付株式数 700株
Keeper 技研	1,900	1,033.00	1,962,700	
ファーストロジック	1,100	736.00	809,600	貸付株式数 400株
三機サービス	900	1,932.00	1,738,800	
Gunosy	3,500	3,040.00	10,640,000	
デザインワン・ジャパン	1,200	330.00	396,000	貸付株式数 400株
イー・ガーディアン	2,700	2,259.00	6,099,300	貸付株式数 1,000株
リブセンス	3,100	280.00	868,000	
ジャパンマテリアル	15,600	1,058.00	16,504,800	貸付株式数 2,400株
ベクトル	6,900	1,577.00	10,881,300	貸付株式数 2,700株
ウチヤマホールディングス	3,000	449.00	1,347,000	
ライクキッズネクスト	1,200	860.00	1,032,000	
キャリアリンク	2,100	371.00	779,100	
I B J	3,800	685.00	2,603,000	貸付株式数 1,500株
アサンテ	2,200	2,107.00	4,635,400	貸付株式数 800株
N・フィールド	3,700	967.00	3,577,900	貸付株式数 1,400株 (300株)
バリューHR	1,200	1,922.00	2,306,400	貸付株式数 400株
M&Aキャピタルパートナー	1,400	3,705.00	5,187,000	貸付株式数 500株 (300株)
ライドオンエクスプレスHD	2,400	1,497.00	3,592,800	
E R Iホールディングス	1,600	814.00	1,302,400	
アビスト	900	3,170.00	2,853,000	
シグマクシス	2,700	832.00	2,246,400	
ウィルグループ	3,700	944.00	3,492,800	
エスクローAJ	7,700	367.00	2,825,900	貸付株式数 3,200株
日本ビューホテル	1,800	1,164.00	2,095,200	
リクルートホールディングス	411,500	2,787.00	1,146,850,500	

エラン	2,000	2,640.00	5,280,000	貸付株式数	700株
ツガミ	13,200	690.00	9,108,000		
オークマ	7,600	5,020.00	38,152,000	貸付株式数	2,900株
東芝機械	6,700	1,941.00	13,004,700		
アマダホールディングス	91,600	1,030.00	94,348,000		
アイダエンジニア	16,500	743.00	12,259,500		
滝澤鉄工所	1,800	1,400.00	2,520,000		
F U J I	17,800	1,294.00	23,033,200		
牧野フライス	7,000	3,970.00	27,790,000		
オーエスジー	29,300	2,138.00	62,643,400		
ダイジェット	600	1,831.00	1,098,600		
旭ダイヤモンド	15,600	622.00	9,703,200		
D M G 森精機	37,600	1,293.00	48,616,800	貸付株式数	13,800株
ソディック	12,800	724.00	9,267,200	貸付株式数	5,100株
ディスコ	8,000	13,440.00	107,520,000		
日東工器	3,300	2,223.00	7,335,900		
日進工具	1,700	2,396.00	4,073,200		
パンチ工業	4,100	507.00	2,078,700		
富士ダイス	2,500	636.00	1,590,000		
土木管理総合試験	2,500	567.00	1,417,500	貸付株式数	900株
日本郵政	467,700	1,285.00	600,994,500		
ベルシステム24HLDGS	9,600	1,313.00	12,604,800		
鎌倉新書	4,200	1,534.00	6,442,800		
一蔵	700	630.00	441,000		
L I T A L I C O	1,300	1,798.00	2,337,400	貸付株式数	500株
グローバルグループ	700	957.00	669,900		
エポラブルアジア	1,600	1,908.00	3,052,800		
アトラエ	1,100	2,342.00	2,576,200		
ストライク	1,400	2,340.00	3,276,000	貸付株式数	500株
ソラスト	13,900	1,196.00	16,624,400		
セラク	1,300	597.00	776,100		
インソース	1,900	2,018.00	3,834,200	貸付株式数	700株
豊田自動織機	48,700	5,360.00	261,032,000		
豊和工業	3,200	767.00	2,454,400	貸付株式数	900株 (900株)
O K K	2,300	812.00	1,867,600		
石川製作所	1,400	1,279.00	1,790,600	貸付株式数	400株
東洋機械金属	4,200	542.00	2,276,400		
津田駒工業	1,200	1,756.00	2,107,200		

エンシュウ	1,500	1,036.00	1,554,000	貸付株式数	600株
島精機製作所	8,200	3,215.00	26,363,000	貸付株式数	3,200株 (100株)
オプトラン	5,800	1,770.00	10,266,000	貸付株式数	2,300株 (100株)
N Cホールディングス	1,800	482.00	867,600		
フリー	4,700	1,017.00	4,779,900		
ヤマシンフィルタ	10,300	732.00	7,539,600	貸付株式数	4,100株 (1,700株)
日阪製作所	7,200	871.00	6,271,200		
やまびこ	11,400	1,074.00	12,243,600		
平田機工	2,800	5,240.00	14,672,000	貸付株式数	800株
ペガサスミシン製造	5,500	726.00	3,993,000		
タツモ	1,800	720.00	1,296,000	貸付株式数	700株
ナプテスコ	32,700	2,564.00	83,842,800		
三井海洋開発	6,300	2,345.00	14,773,500		
レオン自動機	5,800	1,481.00	8,589,800	貸付株式数	2,300株
S M C	17,600	34,630.00	609,488,000		
新川	4,400	407.00	1,790,800		
ホソカワミクロン	2,100	4,225.00	8,872,500		
ユニオンツール	2,600	3,100.00	8,060,000		
オイレス工業	8,300	1,850.00	15,355,000	貸付株式数	200株
日精エーエスピー	1,700	3,345.00	5,686,500	貸付株式数	700株
サト - ホールディングス	7,100	2,614.00	18,559,400		
技研製作所	4,100	3,545.00	14,534,500	貸付株式数	800株
日本エアーテック	1,800	650.00	1,170,000		
カワタ	1,200	1,396.00	1,675,200	貸付株式数	400株
日精樹脂工業	5,000	944.00	4,720,000		
オカダアイヨン	2,000	1,600.00	3,200,000		
ワイエイシイホールディングス	2,300	627.00	1,442,100	貸付株式数	900株
小松製作所	272,300	2,537.50	690,961,250	貸付株式数	108,000株 (102,200株)
住友重機械	34,500	3,625.00	125,062,500		
日立建機	24,100	2,613.00	62,973,300		
日工	1,600	2,447.00	3,915,200		
巴工業	2,500	2,324.00	5,810,000		
井関農機	6,000	1,615.00	9,690,000		
T O W A	5,100	630.00	3,213,000	貸付株式数	1,400株
丸山製作所	1,200	1,375.00	1,650,000		

北川鉄工所	2,700	2,251.00	6,077,700	
シンニッタン	9,100	366.00	3,330,600	
ローツェ	2,600	1,501.00	3,902,600	貸付株式数 1,300株
タカキタ	2,000	617.00	1,234,000	
クボタ	322,600	1,707.50	550,839,500	貸付株式数 37,700株
荏原実業	1,700	2,035.00	3,459,500	
東洋エンジニア	7,800	714.00	5,569,200	貸付株式数 3,300株 (1,100株)
三菱化工機	1,900	1,506.00	2,861,400	貸付株式数 100株
月島機械	11,900	1,256.00	14,946,400	
帝国電機製作所	4,200	1,354.00	5,686,800	
東京機械	2,400	409.00	981,600	
新東工業	14,200	876.00	12,439,200	
渋谷工業	5,300	3,750.00	19,875,000	
アイチ コーポレーション	10,200	595.00	6,069,000	貸付株式数 3,800株
小森コーポレーション	16,400	1,085.00	17,794,000	
鶴見製作所	4,700	1,884.00	8,854,800	貸付株式数 1,000株
住友精密	1,000	3,180.00	3,180,000	
酒井重工業	1,100	2,435.00	2,678,500	
荏原製作所	26,700	2,611.00	69,713,700	
石井鉄工所	1,100	1,830.00	2,013,000	
西島製作所	6,300	958.00	6,035,400	貸付株式数 1,000株
北越工業	6,100	1,104.00	6,734,400	貸付株式数 2,000株
千代田化工建	47,600	302.00	14,375,200	貸付株式数 19,000株
ダイキン工業	81,900	12,240.00	1,002,456,000	貸付株式数 32,100株
オルガノ	2,100	2,711.00	5,693,100	
ト - ヨ - カネツ	2,200	2,274.00	5,002,800	
栗田工業	32,500	2,794.00	90,805,000	
椿本チエイン	7,900	3,910.00	30,889,000	
大同工業	2,800	922.00	2,581,600	
日 機 装	19,400	946.00	18,352,400	
木村化工機	4,800	380.00	1,824,000	貸付株式数 1,000株
新興プランテック	12,100	1,064.00	12,874,400	
アネスト岩田	9,400	1,116.00	10,490,400	貸付株式数 1,500株
ダイフク	33,100	5,400.00	178,740,000	貸付株式数 13,000株
サムコ	1,600	892.00	1,427,200	
加藤製作所	3,000	2,722.00	8,166,000	
油研工業	1,000	1,845.00	1,845,000	
タダノ	29,000	1,067.00	30,943,000	貸付株式数 11,500株
フジテック	21,800	1,260.00	27,468,000	貸付株式数 3,800株

C K D	16,700	979.00	16,349,300	
キトー	4,500	1,545.00	6,952,500	
平和	16,700	2,367.00	39,528,900	
理想科学工業	5,200	1,727.00	8,980,400	
S A N K Y O	15,100	4,315.00	65,156,500	
日本金銭機械	6,600	994.00	6,560,400	貸付株式数 1,800株
マースグループH L D G S	3,800	2,214.00	8,413,200	貸付株式数 600株
福島工業	3,800	3,600.00	13,680,000	
オーイズミ	2,800	431.00	1,206,800	
ダイコク電機	2,800	1,541.00	4,314,800	
竹内製作所	10,000	1,826.00	18,260,000	
ア マ ノ	17,100	2,277.00	38,936,700	
J U K I	8,300	1,207.00	10,018,100	
サンデンホールディングス	7,200	788.00	5,673,600	貸付株式数 2,800株
蛇の目ミシン	5,300	507.00	2,687,100	貸付株式数 1,000株
ブラザー工業	78,300	1,680.00	131,544,000	
マックス	9,200	1,367.00	12,576,400	
モリタホールディングス	10,500	1,882.00	19,761,000	
グローリー	16,500	2,519.00	41,563,500	
新晃工業	5,700	1,597.00	9,102,900	
大和冷機工業	9,100	1,104.00	10,046,400	
セガサミーホールディングス	59,600	1,631.00	97,207,600	
日本ピストンリング	2,100	1,921.00	4,034,100	
リ ケ ン	2,800	5,110.00	14,308,000	
T P R	8,100	2,317.00	18,767,700	
ツバキ・ナカシマ	9,100	1,677.00	15,260,700	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,500	6,700.00	117,250,000	
大豊工業	4,800	984.00	4,723,200	
日本精工	123,800	974.00	120,581,200	
N T N	129,600	339.00	43,934,400	
ジェイテクト	57,700	1,303.00	75,183,100	
不 二 越	5,600	4,120.00	23,072,000	貸付株式数 2,200株
ミネベアミツミ	111,600	1,640.00	183,024,000	
日本トムソン	17,600	501.00	8,817,600	貸付株式数 7,800株
T H K	37,500	2,283.00	85,612,500	
ユーシン精機	4,700	986.00	4,634,200	
前澤給装工業	2,400	1,925.00	4,620,000	
イーグル工業	7,400	1,293.00	9,568,200	貸付株式数 2,300株

前澤工業	4,300	355.00	1,526,500	貸付株式数	1,600株
日本ピラ - 工業	6,000	1,370.00	8,220,000		
キッツ	24,300	895.00	21,748,500		
日立	270,400	3,138.00	848,515,200	貸付株式数	106,000株
三菱電機	600,300	1,282.50	769,884,750	貸付株式数	235,200株
富士電機	38,700	3,430.00	132,741,000		
東洋電機製造	2,700	1,302.00	3,515,400	貸付株式数	600株
安川電機	69,700	2,977.00	207,496,900	貸付株式数	300株
シンフォニアテクノロジー	8,300	1,372.00	11,387,600		
明電舎	12,200	1,395.00	17,019,000		
オリジン電気	1,600	1,730.00	2,768,000		
山洋電気	2,900	3,665.00	10,628,500		
デンヨー	6,000	1,475.00	8,850,000		
アイモバイル	1,300	853.00	1,108,900	貸付株式数	500株
キャリアインデックス	2,000	1,802.00	3,604,000		
MS - Japan	2,300	1,337.00	3,075,100	貸付株式数	900株
船場	900	965.00	868,500		
グレイステクノロジー	1,500	2,000.00	3,000,000	貸付株式数	600株
ジャパンエレベーターSHD	3,400	1,684.00	5,725,600		
フルテック	700	1,113.00	779,100	貸付株式数	200株
グリーンズ	1,200	1,399.00	1,678,800	貸付株式数	400株
ツナグ・ソリューションズ	500	704.00	352,000	貸付株式数	200株
日総工産	1,400	1,833.00	2,566,200	貸付株式数	500株
キュービーネットHLDGS	2,900	1,959.00	5,681,100		
三桜工業	7,500	575.00	4,312,500		
マキタ	73,200	4,140.00	303,048,000		
東芝テック	7,400	2,570.00	19,018,000	貸付株式数	2,900株
芝浦メカトロニクス	1,000	3,550.00	3,550,000		
マブチモーター	16,600	3,635.00	60,341,000		
日本電産	72,300	13,490.00	975,327,000	貸付株式数	28,400株
ユーエムシーエレクトロニクス	3,200	2,026.00	6,483,200	貸付株式数	200株
トレックス・セミコンダクター	2,000	1,418.00	2,836,000		
東光高岳	3,500	1,437.00	5,029,500	貸付株式数	1,000株
ダブル・スコープ	8,700	1,053.00	9,161,100	貸付株式数	3,600株 (900株)

宮越ホールディングス	2,500	1,065.00	2,662,500	貸付株式数	900株
ダイヘン	6,800	2,386.00	16,224,800		
ヤーマン	8,700	1,534.00	13,345,800	貸付株式数	3,400株
JVCケンウッド	43,900	256.00	11,238,400		
ミマキエンジニアリング	5,300	895.00	4,743,500		
第一精工	2,500	1,205.00	3,012,500	貸付株式数	1,000株
日新電機	14,200	882.00	12,524,400		
大崎電気	12,900	707.00	9,120,300		
オムロン	63,900	4,290.00	274,131,000		
日東工業	10,000	1,793.00	17,930,000		
I D E C	8,000	2,037.00	16,296,000		
不二電機工業	600	1,315.00	789,000		
ジーエス・ユアサ コーポ	21,600	2,436.00	52,617,600		
サクサホールディングス	1,400	1,774.00	2,483,600		
メルコホールディングス	2,500	3,505.00	8,762,500	貸付株式数	800株
テクノメディカ	1,400	2,040.00	2,856,000		
日本電気	77,800	3,490.00	271,522,000	貸付株式数	100株 (100株)
富士通	58,000	7,013.00	406,754,000		
沖電気	26,100	1,333.00	34,791,300		
岩崎通信機	2,800	728.00	2,038,400		
電気興業	3,100	2,492.00	7,725,200	貸付株式数	1,000株
サンケン電気	7,000	2,049.00	14,343,000		
ナカヨ	1,100	1,483.00	1,631,300		
アイホン	3,400	1,695.00	5,763,000	貸付株式数	1,400株
ルネサスエレクトロニクス	62,400	500.00	31,200,000		
セイコーエプソン	74,500	1,580.00	117,710,000		
ワコム	43,400	469.00	20,354,600	貸付株式数	17,000株
アルバック	13,800	3,340.00	46,092,000		
アクセル	2,500	551.00	1,377,500		
E I Z O	5,500	3,910.00	21,505,000	貸付株式数	1,500株
ジャパンディスプレイ	139,100	83.00	11,545,300	貸付株式数	55,600株
日本信号	16,100	919.00	14,795,900	貸付株式数	3,000株
京三製作所	14,000	424.00	5,936,000	貸付株式数	2,000株
能美防災	8,200	1,933.00	15,850,600		
ホーチキ	4,100	1,144.00	4,690,400	貸付株式数	1,800株
星和電機	3,000	377.00	1,131,000	貸付株式数	1,000株
エレコム	5,500	2,880.00	15,840,000	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
パナソニック	686,300	1,068.00	732,968,400		

シャープ	59,600	1,186.00	70,685,600	貸付株式数	200株
アンリツ	38,600	1,640.00	63,304,000	貸付株式数	5,600株
富士通ゼネラル	18,300	1,429.00	26,150,700	貸付株式数	7,200株
ソ ニ ー	402,900	5,582.00	2,248,987,800	貸付株式数	159,800株
T D K	31,400	7,830.00	245,862,000	貸付株式数	10,000株
帝国通信工業	2,600	1,176.00	3,057,600		
タムラ製作所	23,000	551.00	12,673,000	貸付株式数	9,000株
アルプス電気	55,500	2,374.00	131,757,000	貸付株式数	300株
池上通信機	1,800	1,240.00	2,232,000	貸付株式数	900株
パイオニア	98,800	63.00	6,224,400	貸付株式数	40,000株
日本電波工業	5,400	396.00	2,138,400	貸付株式数	2,300株
鈴木	2,900	591.00	1,713,900		
日本トリム	1,100	5,920.00	6,512,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,100	2,280.00	7,068,000	貸付株式数	1,200株
フオスタ - 電機	7,000	1,463.00	10,241,000		
クラリオン	7,000	2,487.00	17,409,000		
S M K	1,700	2,264.00	3,848,800		
ヨコオ	4,200	1,361.00	5,716,200	貸付株式数	1,200株
ティアック	4,200	218.00	915,600	貸付株式数	1,600株
ホシデン	17,700	755.00	13,363,500		
ヒロセ電機	8,600	10,840.00	93,224,000		
日本航空電子	13,800	1,317.00	18,174,600	貸付株式数	5,400株
T O A	6,900	1,030.00	7,107,000		
マクセルホールディングス	12,800	1,480.00	18,944,000	貸付株式数	3,600株
古野電気	7,700	1,134.00	8,731,800		
ユニデンホールディングス	1,700	2,125.00	3,612,500		
アルパイン	10,400	1,609.00	16,733,600		
スミダコーポレーション	5,100	1,258.00	6,415,800	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
アイコム	3,300	2,061.00	6,801,300		
リオン	2,700	1,878.00	5,070,600		
本多通信工業	5,000	497.00	2,485,000		
船井電機	6,100	591.00	3,605,100	貸付株式数	4,000株 (1,800株)
横河電機	60,200	1,996.00	120,159,200		
新電元工業	2,100	3,900.00	8,190,000		
アズビル	38,900	2,089.00	81,262,100		
東亜ディーケーケー	2,900	799.00	2,317,100		

日本光電工業	26,500	3,545.00	93,942,500	
チノー	2,000	1,271.00	2,542,000	
共和電業	6,300	400.00	2,520,000	
日本電子材料	2,300	636.00	1,462,800	
堀場製作所	11,900	4,860.00	57,834,000	貸付株式数 4,700株 (3,100株)
アドバンテスト	40,900	2,139.00	87,485,100	貸付株式数 16,200株
小野測器	2,600	633.00	1,645,800	
エスペック	5,300	1,887.00	10,001,100	
キーエンス	29,500	56,300.00	1,660,850,000	
日置電機	3,100	3,845.00	11,919,500	
シスメックス	46,800	5,601.00	262,126,800	
日本マイクロニクス	9,700	757.00	7,342,900	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
メガチップス	4,700	2,487.00	11,688,900	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,500	4,135.00	14,472,500	
IMAGICA GROUP	4,900	501.00	2,454,900	
澤藤電機	700	1,666.00	1,166,200	
デンソー	132,400	5,032.00	666,236,800	
原田工業	1,900	770.00	1,463,000	貸付株式数 600株
コーセル	8,200	948.00	7,773,600	貸付株式数 400株
イリソ電子工業	5,500	4,030.00	22,165,000	貸付株式数 1,300株
オプテックスグループ	10,500	1,896.00	19,908,000	貸付株式数 4,200株
千代田インテグレ	2,600	2,200.00	5,720,000	
アイ・オー・データ	2,400	1,096.00	2,630,400	
レーザーテック	12,300	3,100.00	38,130,000	
スタンレー電気	42,600	3,125.00	133,125,000	
岩崎電気	3,200	1,379.00	4,412,800	
ウシオ電機	36,500	1,142.00	41,683,000	
岡谷電機	4,300	367.00	1,578,100	
ヘリオステクノH	5,500	649.00	3,569,500	貸付株式数 2,100株
日本セラミック	6,100	2,477.00	15,109,700	
遠藤照明	4,100	727.00	2,980,700	
古河電池	5,000	728.00	3,640,000	貸付株式数 1,700株 (1,000株)
双信電機	2,800	356.00	996,800	
山一電機	4,300	1,220.00	5,246,000	貸付株式数 1,900株
図研	3,900	1,591.00	6,204,900	

日本電子	11,900	1,765.00	21,003,500		
カシオ	53,200	1,451.00	77,193,200	貸付株式数	21,000株
ファナック	57,100	16,850.00	962,135,000	貸付株式数	22,400株
日本シイエムケイ	15,200	551.00	8,375,200	貸付株式数	2,800株
エンプラス	2,700	2,952.00	7,970,400	貸付株式数	700株 (700株)
大真空	2,200	889.00	1,955,800		
ローム	29,100	7,100.00	206,610,000	貸付株式数	10,400株
浜松ホトニクス	43,100	3,730.00	160,763,000	貸付株式数	15,000株
三井ハイテック	6,600	870.00	5,742,000	貸付株式数	2,600株 (500株)
新光電気工業	20,200	753.00	15,210,600		
京セラ	91,700	5,692.00	521,956,400		
協栄産業	700	1,655.00	1,158,500		
太陽誘電	26,700	1,826.00	48,754,200	貸付株式数	10,600株
村田製作所	63,100	16,000.00	1,009,600,000	貸付株式数	25,000株 (4,800株)
ユーシン	9,200	980.00	9,016,000	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
双葉電子工業	9,800	1,622.00	15,895,600		
日東電工	45,400	5,680.00	257,872,000		
北陸電気工業	2,100	971.00	2,039,100	貸付株式数	600株
東海理化電機	15,800	1,855.00	29,309,000		
ニチコン	18,900	815.00	15,403,500		
日本ケミコン	4,200	1,945.00	8,169,000		
K O A	9,000	1,320.00	11,880,000		
三井E & S H D	21,300	1,149.00	24,473,700	貸付株式数	8,500株
日立造船	47,700	343.00	16,361,100	貸付株式数	18,600株
三菱重工業	100,600	4,174.00	419,904,400	貸付株式数	38,400株
川崎重工業	46,900	2,520.00	118,188,000		
I H I	46,200	3,450.00	159,390,000		
名村造船所	18,000	463.00	8,334,000	貸付株式数	7,100株
サノヤスホールディングス	7,800	183.00	1,427,400	貸付株式数	2,900株
スプリックス	1,600	1,708.00	2,732,800		
日本車輛	2,200	2,374.00	5,222,800	貸付株式数	800株
三菱ロジスネクスト	7,200	1,060.00	7,632,000		
近畿車輛	800	2,047.00	1,637,600		
F P G	18,700	1,072.00	20,046,400	貸付株式数	500株
島根銀行	1,400	618.00	865,200		
じもとホールディングス	40,000	132.00	5,280,000		

全国保証	16,700	3,630.00	60,621,000	貸付株式数	6,600株
めぶきフィナンシャルG	308,000	307.00	94,556,000	貸付株式数	7,000株
東京きらぼしFG	8,000	1,724.00	13,792,000		
九州フィナンシャルG	97,200	462.00	44,906,400		
かんぼ生命保険	22,000	2,563.00	56,386,000	貸付株式数	4,600株
ゆうちょ銀行	168,300	1,251.00	210,543,300	貸付株式数	64,000株
富山第一銀行	13,800	404.00	5,575,200	貸付株式数	4,400株
コンコルディア・フィナンシャル	377,500	452.00	170,630,000		
ジェイリース	1,200	388.00	465,600		
西日本フィナンシャルHD	37,900	1,031.00	39,074,900		
マーキュリアインベストメント	2,300	759.00	1,745,700		
イントラスト	1,700	359.00	610,300	貸付株式数	600株
日本モーゲージサービス	800	893.00	714,400		
C a s a	1,900	1,106.00	2,101,400		
アルヒ	5,300	2,295.00	12,163,500	貸付株式数	2,700株
日産自動車	708,900	927.90	657,788,310		
いすゞ自動車	190,100	1,630.50	309,958,050		
トヨタ自動車	669,900	6,775.00	4,538,572,500	貸付株式数	265,900株
日野自動車	75,300	1,129.00	85,013,700		
三菱自動車工業	222,700	657.00	146,313,900		
エフテック	4,200	931.00	3,910,200		
レシップホールディングス	4,000	696.00	2,784,000		
GMB	1,100	1,015.00	1,116,500		
ファルテック	1,000	867.00	867,000		
武蔵精密工業	14,100	1,567.00	22,094,700		
日産車体	11,800	900.00	10,620,000	貸付株式数	2,100株
新明和工業	27,900	1,439.00	40,148,100		
極東開発工業	11,900	1,457.00	17,338,300		
日信工業	11,000	1,430.00	15,730,000		
トピー工業	5,000	2,363.00	11,815,000		
ティラド	2,200	2,306.00	5,073,200		
曙ブレーキ	32,900	198.00	6,514,200	貸付株式数	13,300株 (100株)
タチエス	10,100	1,449.00	14,634,900		
N O K	32,400	1,586.00	51,386,400	貸付株式数	12,700株
フタバ産業	16,700	526.00	8,784,200	貸付株式数	7,000株
K Y B	6,200	2,626.00	16,281,200	貸付株式数	2,200株 (1,900株)

市光工業	8,900	574.00	5,108,600	貸付株式数	3,700株
大同メタル工業	9,700	832.00	8,070,400		
プレス工業	29,700	557.00	16,542,900		
ミクニ	7,500	519.00	3,892,500	貸付株式数	1,000株
太平洋工業	12,600	1,466.00	18,471,600		
ケーヒン	13,800	1,810.00	24,978,000		
河西工業	7,300	877.00	6,402,100		
アイシン精機	49,500	3,990.00	197,505,000	貸付株式数	19,000株
マ ッ ダ	188,900	1,229.50	232,252,550		
今仙電機製作所	5,600	1,003.00	5,616,800		
本田技研	507,100	3,028.00	1,535,498,800		
スズキ	110,000	5,562.00	611,820,000	貸付株式数	45,900株
S U B A R U	186,600	2,457.50	458,569,500		
安永	2,900	1,511.00	4,381,900	貸付株式数	1,300株
ヤマハ発動機	84,900	2,274.00	193,062,600	貸付株式数	22,700株
ショーワ	14,100	1,353.00	19,077,300		
小糸製作所	36,000	5,650.00	203,400,000		
T B K	7,000	413.00	2,891,000	貸付株式数	1,000株
エクセディ	8,100	2,719.00	22,023,900		
ミツバ	11,000	624.00	6,864,000		
豊田合成	19,400	2,237.00	43,397,800		
愛三工業	9,400	758.00	7,125,200		
盟和産業	1,000	1,040.00	1,040,000		
日本プラスト	4,600	762.00	3,505,200		
ヨ ロ ズ	5,500	1,417.00	7,793,500		
エフ・シー・シー	10,800	2,560.00	27,648,000		
新家工業	1,300	1,603.00	2,083,900		
シマノ	24,200	16,180.00	391,556,000		
テイ・エス テック	14,000	2,990.00	41,860,000		
関西みらいF G	27,700	780.00	21,606,000		
3 3 F G	5,100	1,742.00	8,884,200		
第四北越フィナンシャルG	10,300	3,180.00	32,754,000		
ジャムコ	3,000	2,558.00	7,674,000	貸付株式数	1,100株 (900株)
小 野 建	5,100	1,623.00	8,277,300	貸付株式数	2,000株 (1,400株)
はるやまH L D G S	2,700	809.00	2,184,300		
ノ ジ マ	10,500	2,269.00	23,824,500		
佐鳥電機	4,400	908.00	3,995,200	貸付株式数	1,000株
カップ・クリエイト	8,400	1,396.00	11,726,400		

エコートレーディング	1,500	602.00	903,000	
伯東	4,000	1,181.00	4,724,000	
コンドーテック	4,600	1,013.00	4,659,800	貸付株式数 1,000株
中山福	3,400	511.00	1,737,400	
ライトオン	5,000	892.00	4,460,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,500	2,617.00	22,244,500	
ジーンズメイト	1,800	376.00	676,800	
三菱食品	6,500	2,911.00	18,921,500	
良品計画	8,400	28,060.00	235,704,000	貸付株式数 3,200株
三城ホールディングス	7,500	438.00	3,285,000	
松田産業	4,500	1,503.00	6,763,500	
第一興商	8,800	5,120.00	45,056,000	
メディパルHD	63,800	2,466.00	157,330,800	
アドヴァン	9,000	937.00	8,433,000	貸付株式数 600株 (600株)
S P K	1,200	2,333.00	2,799,600	
萩原電気HLDGS	2,100	2,839.00	5,961,900	
アルビス	2,200	2,493.00	5,484,600	貸付株式数 900株
アズワン	4,200	7,600.00	31,920,000	
スズデン	1,900	1,251.00	2,376,900	
尾家産業	1,800	1,291.00	2,323,800	
シモジマ	3,500	1,100.00	3,850,000	
ドウシシャ	5,600	1,838.00	10,292,800	貸付株式数 2,000株
小津産業	1,300	1,890.00	2,457,000	
コナカ	7,700	462.00	3,557,400	
高速	3,500	1,023.00	3,580,500	
ハウス ローゼ	700	1,850.00	1,295,000	
G-7ホールディングス	1,700	2,345.00	3,986,500	貸付株式数 600株
たけびし	2,700	1,337.00	3,609,900	
イオン北海道	6,100	798.00	4,867,800	
コジマ	8,800	517.00	4,549,600	
ヒマラヤ	1,700	947.00	1,609,900	貸付株式数 600株
コーナン商事	7,700	2,704.00	20,820,800	
ネットワンシステムズ	20,800	2,102.00	43,721,600	貸付株式数 7,300株 (7,300株)
エコス	2,200	2,150.00	4,730,000	
ワタミ	7,700	1,320.00	10,164,000	貸付株式数 3,200株
マルシェ	1,400	784.00	1,097,600	
リックス	1,300	1,499.00	1,948,700	

システムソフト	13,500	94.00	1,269,000	貸付株式数	5,400株
ドンキホーテホールディング	38,400	7,130.00	273,792,000	貸付株式数	15,200株 (15,000株)
丸文	5,200	761.00	3,957,200		
西松屋チェーン	12,900	867.00	11,184,300		
ゼンショーホールディングス	27,900	2,739.00	76,418,100		
ハピネット	4,900	1,498.00	7,340,200		
幸楽苑ホールディングス	3,700	2,169.00	8,025,300	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,200	1,088.00	1,305,600		
橋本総業HLDGS	1,000	1,553.00	1,553,000		
日本ライフライン	18,500	1,521.00	28,138,500	貸付株式数	7,200株
サイゼリヤ	9,700	1,943.00	18,847,100	貸付株式数	2,600株
タカショー	2,800	467.00	1,307,600		
エクセル	2,200	2,002.00	4,404,400	貸付株式数	1,300株
V Tホールディングス	19,600	427.00	8,369,200		
マルカキカイ	1,900	2,053.00	3,900,700		
アルゴグラフィックス	2,500	3,880.00	9,700,000		
魚力	1,600	1,415.00	2,264,000		
IDOM	19,900	390.00	7,761,000	貸付株式数	300株
日本エム・ディ・エム	3,400	1,124.00	3,821,600		
ポプラ	1,500	595.00	892,500	貸付株式数	500株
フジ・コーポレーション	1,200	2,025.00	2,430,000		
ユナイテッドアローズ	6,800	3,935.00	26,758,000	貸付株式数	1,900株 (1,900株)
進和	3,500	2,035.00	7,122,500	貸付株式数	1,000株
エスケイジャパン	1,400	785.00	1,099,000	貸付株式数	500株
ダイトロン	2,700	1,274.00	3,439,800		
ハイデイ日高	7,800	2,259.00	17,620,200		
シークス	7,500	1,534.00	11,505,000	貸付株式数	2,900株
京都きもの友禅	4,000	384.00	1,536,000		
コロワイド	19,600	2,505.00	49,098,000		
ピーシーデポコーポ	7,900	433.00	3,420,700	貸付株式数	700株 (500株)
田中商事	2,000	585.00	1,170,000		
オーハシテクニカ	3,200	1,322.00	4,230,400		
壱番屋	4,100	4,530.00	18,573,000	貸付株式数	1,700株
白銅	1,900	1,592.00	3,024,800		
トップカルチャー	2,200	335.00	737,000	貸付株式数	800株

P L A N T	1,400	1,022.00	1,430,800	貸付株式数	500株
スギホールディングス	13,000	4,730.00	61,490,000		
島津製作所	77,400	2,321.00	179,645,400		
J M S	5,200	540.00	2,808,000	貸付株式数	1,000株
クボテック	1,200	250.00	300,000		
長野計器	4,600	822.00	3,781,200		
ブイ・テクノロジー	1,400	13,720.00	19,208,000		
スター精密	10,300	1,503.00	15,480,900		
東京計器	3,900	979.00	3,818,100	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
愛知時計	800	3,915.00	3,132,000		
インターアクション	3,200	1,962.00	6,278,400		
オーバル	5,800	235.00	1,363,000	貸付株式数	1,000株
東京精密	10,900	2,966.00	32,329,400		
マニー	7,300	4,650.00	33,945,000		
ニコン	104,800	1,685.00	176,588,000		
トプコン	32,400	1,546.00	50,090,400		
オリンパス	89,600	3,190.00	285,824,000		
理研計器	5,300	2,092.00	11,087,600		
S C R E E Nホールディングス	10,400	4,890.00	50,856,000		
キヤノン電子	5,500	1,980.00	10,890,000		
タムロン	5,300	1,656.00	8,776,800	貸付株式数	100株
HOYA	121,000	6,509.00	787,589,000	貸付株式数	47,500株
シード	2,500	1,202.00	3,005,000		
ノーリツ鋼機	4,700	1,613.00	7,581,100		
エー・アンド・デイ	5,400	761.00	4,109,400	貸付株式数	1,000株
朝日インテック	21,700	4,890.00	106,113,000		
キヤノン	323,800	3,133.00	1,014,465,400		
リコー	180,800	1,114.00	201,411,200		
シチズン時計	65,600	555.00	36,408,000		
リズム時計	2,000	1,986.00	3,972,000		
大研医器	4,800	673.00	3,230,400		
メニコン	8,200	2,803.00	22,984,600		
シンシア	900	559.00	503,100		
中本パックス	1,700	1,719.00	2,922,300		
スノーピーク	2,200	1,184.00	2,604,800		
パラマウントベッドHD	7,000	4,835.00	33,845,000		
トランザクション	3,200	676.00	2,163,200		
S H O B I	1,700	377.00	640,900		

ニホンフラッシュ	2,500	1,708.00	4,270,000		
前田工織	6,600	2,527.00	16,678,200	貸付株式数	600株
永大産業	7,600	421.00	3,199,600	貸付株式数	1,000株
アートネイチャー	6,400	655.00	4,192,000	貸付株式数	2,000株
バンダイナムコHLDGS	62,100	4,675.00	290,317,500		
アイフィスジャパン	1,300	600.00	780,000	貸付株式数	500株
共立印刷	10,200	216.00	2,203,200		
SHOEI	2,900	4,105.00	11,904,500	貸付株式数	1,200株
フランスベッドHLDGS	8,300	928.00	7,702,400		
マーベラス	9,000	825.00	7,425,000	貸付株式数	3,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,500	5,700.00	59,850,000		
萩原工業	3,200	1,690.00	5,408,000		
エイベックス	10,100	1,520.00	15,352,000	貸付株式数	3,900株
トッパン・フォームズ	13,000	898.00	11,674,000		
フジシールインターナショナル	13,500	3,540.00	47,790,000		
タカラトミー	25,100	1,212.00	30,421,200	貸付株式数	9,800株
廣済堂	5,500	360.00	1,980,000	貸付株式数	1,000株
エステールホールディングス	1,500	667.00	1,000,500		
アーク	23,500	85.00	1,997,500		
レック	6,400	1,823.00	11,667,200	貸付株式数	2,500株
タカノ	2,300	851.00	1,957,300		
三光合成	4,600	341.00	1,568,600		
プロネクサス	5,100	1,008.00	5,140,800		
ホクシン	3,700	151.00	558,700		
ウッドワン	2,000	1,067.00	2,134,000	貸付株式数	800株
大建工業	4,600	2,025.00	9,315,000		
きもと	10,000	187.00	1,870,000		
凸版印刷	85,100	1,720.00	146,372,000		
大日本印刷	84,800	2,414.00	204,707,200		
図書印刷	5,600	741.00	4,149,600		
共同印刷	1,900	2,417.00	4,592,300		
NISSHA	12,300	1,434.00	17,638,200	貸付株式数	4,800株 (2,700株)
光村印刷	500	2,172.00	1,086,000	貸付株式数	200株
藤森工業	5,400	2,945.00	15,903,000		
ヴィア・ホールディングス	7,200	698.00	5,025,600	貸付株式数	3,700株

宝印刷	3,100	1,775.00	5,502,500	
前澤化成工業	4,200	1,070.00	4,494,000	
アシックス	59,700	1,503.00	89,729,100	貸付株式数 2,000株
ツ ツ ミ	1,900	1,996.00	3,792,400	貸付株式数 700株
ウェーブロックHLDGS	1,400	729.00	1,020,600	
ジェイ エス ピー	3,500	2,178.00	7,623,000	貸付株式数 100株
ニ チ ハ	8,400	2,732.00	22,948,800	
エフピコ	4,900	6,390.00	31,311,000	貸付株式数 1,900株
小松ウオール工業	1,800	2,011.00	3,619,800	
ヤマハ	35,700	5,100.00	182,070,000	
河合楽器	1,800	3,175.00	5,715,000	貸付株式数 100株
クリナップ	5,700	648.00	3,693,600	貸付株式数 2,200株
ビジョン	36,300	4,740.00	172,062,000	貸付株式数 14,200株
天馬	4,100	1,802.00	7,388,200	貸付株式数 2,000株
兼松サステック	400	1,586.00	634,400	
キングジム	4,800	858.00	4,118,400	
象印マホービン	11,100	1,056.00	11,721,600	貸付株式数 4,400株
リンテック	14,300	2,480.00	35,464,000	
信越ポリマー	10,700	703.00	7,522,100	
東 リ	14,600	267.00	3,898,200	貸付株式数 800株
イトーキ	10,900	608.00	6,627,200	
任 天 堂	37,000	30,990.00	1,146,630,000	貸付株式数 14,600株
三菱鉛筆	9,900	2,098.00	20,770,200	
松 風	2,700	1,103.00	2,978,100	
タカラスタンダ - ド	12,400	1,737.00	21,538,800	
コ ク ヨ	28,800	1,618.00	46,598,400	
ナカバヤシ	5,700	532.00	3,032,400	
ニ フ コ	24,100	2,770.00	66,757,000	
立川ブラインド	2,600	1,134.00	2,948,400	貸付株式数 400株
グローブライド	2,900	2,465.00	7,148,500	貸付株式数 1,100株
オカムラ	20,900	1,453.00	30,367,700	貸付株式数 8,100株
バルカー	4,800	2,344.00	11,251,200	
MUTOHホールディングス	700	2,001.00	1,400,700	
伊 藤 忠	414,100	1,970.50	815,984,050	貸付株式数 169,800株
丸 紅	583,400	814.80	475,354,320	
スクロール	9,000	403.00	3,627,000	貸付株式数 3,200株
高 島	900	1,910.00	1,719,000	
ヨンドシーホールディングス	6,500	2,291.00	14,891,500	

三陽商会	3,600	1,953.00	7,030,800	貸付株式数	1,200株
長瀬産業	33,300	1,536.00	51,148,800		
ナイガイ	2,000	522.00	1,044,000		
蝶理	3,800	1,692.00	6,429,600		
豊田通商	66,000	3,435.00	226,710,000		
オンワードホールディングス	35,600	610.00	21,716,000		
三共生興	10,200	422.00	4,304,400	貸付株式数	1,000株
兼松	23,500	1,379.00	32,406,500		
美津濃	5,900	2,309.00	13,623,100		
ツカモトコーポレーション	1,000	1,156.00	1,156,000		
ユニー・ファミリーマートHD	16,500	17,250.00	284,625,000	貸付株式数	6,500株
ルックホールディングス	2,100	1,003.00	2,106,300	貸付株式数	800株
三井物産	487,500	1,725.50	841,181,250	貸付株式数	190,700株
日本紙パルプ	3,300	4,310.00	14,223,000		
東京エレクトロン	40,100	13,510.00	541,751,000		
日立ハイテクノロジーズ	18,000	3,505.00	63,090,000		
カメイ	7,700	1,197.00	9,216,900		
東都水産	800	2,037.00	1,629,600		
OUGホールディングス	900	2,508.00	2,257,200		
スターゼン	2,200	3,825.00	8,415,000	貸付株式数	1,000株
セイコーHD	9,200	2,248.00	20,681,600		
山善	23,000	1,023.00	23,529,000	貸付株式数	1,000株
椿本興業	1,300	3,205.00	4,166,500	貸付株式数	500株
住友商事	350,000	1,638.50	573,475,000		
日本ユニシス	18,400	2,696.00	49,606,400		
内田洋行	2,700	2,629.00	7,098,300	貸付株式数	1,300株
三菱商事	415,500	3,108.00	1,291,374,000	貸付株式数	162,300株
第一実業	2,700	3,575.00	9,652,500		
キャノンマーケティングJPN	16,900	1,989.00	33,614,100		
西華産業	3,300	1,531.00	5,052,300	貸付株式数	1,000株
佐藤商事	5,100	893.00	4,554,300		
菱洋エレクトロ	6,000	1,561.00	9,366,000		
東京産業	6,300	512.00	3,225,600	貸付株式数	1,000株
ユアサ商事	6,000	3,230.00	19,380,000		
神鋼商事	1,300	2,542.00	3,304,600		
小林産業	3,100	308.00	954,800		
阪和興業	10,200	2,909.00	29,671,800		

正栄食品	3,100	3,050.00	9,455,000	
カナデン	5,800	1,265.00	7,337,000	
菱電商事	4,900	1,458.00	7,144,200	
ニプロ	41,500	1,382.00	57,353,000	
フルサト工業	3,200	1,667.00	5,334,400	
岩谷産業	13,000	3,710.00	48,230,000	貸付株式数 5,200株
すてきナイスグループ	2,500	1,008.00	2,520,000	貸付株式数 600株
昭光通商	2,300	647.00	1,488,100	貸付株式数 900株
ニチモウ	1,300	1,670.00	2,171,000	
極東貿易	1,900	1,477.00	2,806,300	
イワキ	7,000	472.00	3,304,000	
兼松エレクトロニクス	3,200	3,225.00	10,320,000	貸付株式数 1,000株
三愛石油	15,900	1,097.00	17,442,300	
稲畑産業	14,200	1,507.00	21,399,400	
G S Iクレオス	1,600	1,335.00	2,136,000	
明和産業	6,200	390.00	2,418,000	貸付株式数 1,000株
ゴ-ルドウイン	5,300	12,590.00	66,727,000	貸付株式数 2,100株 (1,400株)
ユニ・チャ-ム	127,500	3,511.00	447,652,500	
デサント	14,300	1,920.00	27,456,000	貸付株式数 5,600株
キング	3,000	517.00	1,551,000	
ワキタ	12,500	1,198.00	14,975,000	
ヤマトインタ-ナショナル	3,700	428.00	1,583,600	
東邦ホールディングス	17,400	2,838.00	49,381,200	貸付株式数 6,900株
サンゲツ	17,800	2,059.00	36,650,200	
ミツウロコグループ	8,600	669.00	5,753,400	
シナネンホールディングス	2,400	2,510.00	6,024,000	
伊藤忠エネクス	13,100	1,011.00	13,244,100	
サンリオ	18,300	2,356.00	43,114,800	貸付株式数 7,200株
サンワテクノス	3,600	1,086.00	3,909,600	貸付株式数 1,000株
リョ-サン	6,500	2,957.00	19,220,500	貸付株式数 100株
新光商事	5,600	1,696.00	9,497,600	
トーヨー	2,700	2,239.00	6,045,300	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
三信電気	5,000	1,826.00	9,130,000	貸付株式数 2,000株
東陽テクニカ	6,800	829.00	5,637,200	
モスフードサービス	7,700	2,923.00	22,507,100	貸付株式数 2,800株
加賀電子	5,900	2,066.00	12,189,400	
三益半導体	4,600	1,302.00	5,989,200	
ソーダニツカ	6,600	538.00	3,550,800	貸付株式数 1,000株

立花エレテック	4,300	1,602.00	6,888,600	
木曽路	7,300	2,566.00	18,731,800	
S R S ホールディングス	6,900	1,001.00	6,906,900	貸付株式数 2,000株
千 趣 会	11,100	259.00	2,874,900	貸付株式数 4,600株
タカキユー	4,800	189.00	907,200	
ケーヨー	10,700	513.00	5,489,100	
上新電機	7,000	2,459.00	17,213,000	
日本瓦斯	10,700	4,135.00	44,244,500	
ロイヤルホールディングス	10,300	2,749.00	28,314,700	貸付株式数 4,100株
東 天 紅	500	1,370.00	685,000	貸付株式数 200株
いなげや	6,700	1,418.00	9,500,600	貸付株式数 2,500株
島 忠	13,400	2,977.00	39,891,800	
チヨダ	6,200	1,853.00	11,488,600	貸付株式数 2,000株
ライフコーポレーション	4,400	2,427.00	10,678,800	
リンガーハット	7,300	2,338.00	17,067,400	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
M r M a x H D	8,100	495.00	4,009,500	
テナアライド	5,300	400.00	2,120,000	
A O K I ホールディングス	11,700	1,309.00	15,315,300	
オークワ	8,300	1,150.00	9,545,000	貸付株式数 2,000株
コメリ	9,100	2,435.00	22,158,500	
青山商事	11,300	2,698.00	30,487,400	
しまむら	6,900	9,180.00	63,342,000	貸付株式数 2,700株
はせがわ	2,900	434.00	1,258,600	
高 島 屋	46,000	1,520.00	69,920,000	
松 屋	12,000	1,161.00	13,932,000	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	30,400	1,702.00	51,740,800	
近鉄百貨店	2,300	3,520.00	8,096,000	
パ ル コ	5,800	1,167.00	6,768,600	
丸井グループ	50,000	2,255.00	112,750,000	貸付株式数 8,600株
クレディセゾン	41,100	1,284.00	52,772,400	
アクシアル リテイリング	4,900	3,785.00	18,546,500	
井 筒 屋	3,300	214.00	706,200	貸付株式数 1,300株
イオン	228,000	2,558.00	583,224,000	貸付株式数 90,400株
イ ズ ミ	12,000	5,620.00	67,440,000	
フォーバル	2,600	923.00	2,399,800	
平 和 堂	12,000	2,915.00	34,980,000	
フ ジ	7,200	1,925.00	13,860,000	
ヤオコー	6,700	6,230.00	41,741,000	

ゼビオホールディングス	7,100	1,308.00	9,286,800	貸付株式数	1,000株
ケースホールディングス	61,500	1,098.00	67,527,000	貸付株式数	13,000株 (13,000株)
PALTA C	10,700	5,490.00	58,743,000	貸付株式数	3,200株
三谷産業	7,900	286.00	2,259,400	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
OLYMPICグループ	3,500	787.00	2,754,500	貸付株式数	1,300株
日産東京販売HD	8,500	324.00	2,754,000		
新生銀行	43,400	1,402.00	60,846,800		
あおぞら銀行	33,000	3,525.00	116,325,000		
三菱UFJフィナンシャルG	4,129,000	575.40	2,375,826,600	貸付株式数	1,638,000株
りそなホールディングス	650,300	547.70	356,169,310		
三井住友トラストHD	116,500	4,230.00	492,795,000		
三井住友フィナンシャルG	417,800	3,875.00	1,618,975,000	貸付株式数	165,700株
千葉銀行	210,100	645.00	135,514,500		
群馬銀行	118,400	485.00	57,424,000		
武蔵野銀行	8,800	2,601.00	22,888,800		
千葉興業銀行	16,300	387.00	6,308,100		
筑波銀行	24,500	206.00	5,047,000	貸付株式数	10,000株
七十七銀行	18,600	2,002.00	37,237,200		
青森銀行	4,600	2,892.00	13,303,200	貸付株式数	1,700株
秋田銀行	3,800	2,235.00	8,493,000		
山形銀行	6,600	2,157.00	14,236,200	貸付株式数	2,600株 (1,600株)
岩手銀行	4,100	3,820.00	15,662,000	貸付株式数	300株
東邦銀行	52,600	317.00	16,674,200	貸付株式数	4,900株
東北銀行	3,000	1,227.00	3,681,000	貸付株式数	1,000株
みちのく銀行	3,800	1,758.00	6,680,400		
ふくおかフィナンシャルG	48,200	2,422.00	116,740,400		
静岡銀行	149,200	918.00	136,965,600		
十六銀行	8,000	2,462.00	19,696,000		
スルガ銀行	59,500	441.00	26,239,500	貸付株式数	23,800株 (7,000株)
八十二銀行	107,500	471.00	50,632,500		
山梨中央銀行	7,300	1,445.00	10,548,500		
大垣共立銀行	9,300	2,323.00	21,603,900		
福井銀行	5,100	1,766.00	9,006,600	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
北國銀行	6,300	3,870.00	24,381,000		

清水銀行	2,500	1,682.00	4,205,000	貸付株式数 300株 (300株)
富山銀行	1,100	3,435.00	3,778,500	貸付株式数 400株
滋賀銀行	11,900	2,670.00	31,773,000	貸付株式数 4,600株
南都銀行	6,900	2,242.00	15,469,800	
百五銀行	53,400	397.00	21,199,800	
京都銀行	21,300	4,915.00	104,689,500	
紀陽銀行	20,900	1,581.00	33,042,900	貸付株式数 8,200株
ほくほくフィナンシャルG	39,600	1,299.00	51,440,400	
広島銀行	87,800	616.00	54,084,800	貸付株式数 25,000株
山陰合同銀行	35,100	800.00	28,080,000	
中国銀行	38,200	960.00	36,672,000	
鳥取銀行	2,000	1,426.00	2,852,000	
伊予銀行	78,700	608.00	47,849,600	
百十四銀行	6,300	2,626.00	16,543,800	
四国銀行	8,400	1,314.00	11,037,600	貸付株式数 2,000株
阿波銀行	9,500	2,862.00	27,189,000	貸付株式数 700株
大分銀行	3,600	3,410.00	12,276,000	貸付株式数 1,400株
宮崎銀行	3,900	3,020.00	11,778,000	
佐賀銀行	3,600	1,888.00	6,796,800	貸付株式数 1,300株
十八銀行	3,700	2,664.00	9,856,800	
沖縄銀行	5,400	3,415.00	18,441,000	貸付株式数 200株
琉球銀行	13,500	1,159.00	15,646,500	貸付株式数 4,700株
セブン銀行	200,000	336.00	67,200,000	貸付株式数 78,100株
みずほフィナンシャルG	8,052,600	178.10	1,434,168,060	貸付株式数 1,400,000株
高知銀行	2,000	786.00	1,572,000	
山口フィナンシャルG	74,100	1,129.00	83,658,900	
アクリーティブ	900	412.00	370,800	
芙蓉総合リース	6,700	5,660.00	37,922,000	
興銀リース	11,000	2,491.00	27,401,000	
東京センチュリー	11,900	4,810.00	57,239,000	
SBIホールディングス	70,600	2,286.00	161,391,600	貸付株式数 28,000株
日本証券金融	26,000	551.00	14,326,000	
アイフル	90,000	291.00	26,190,000	貸付株式数 35,500株 (300株)
日本アジア投資	5,000	220.00	1,100,000	貸付株式数 1,900株
長野銀行	2,000	1,670.00	3,340,000	
名古屋銀行	4,800	3,460.00	16,608,000	貸付株式数 1,200株
北洋銀行	89,100	300.00	26,730,000	
愛知銀行	2,200	4,090.00	8,998,000	

中京銀行	2,400	2,262.00	5,428,800	
大光銀行	2,000	1,946.00	3,892,000	
愛媛銀行	8,200	1,078.00	8,839,600	貸付株式数 3,600株
トマト銀行	2,300	1,158.00	2,663,400	
京葉銀行	26,200	713.00	18,680,600	
栃木銀行	30,100	248.00	7,464,800	
北日本銀行	1,800	2,318.00	4,172,400	
東和銀行	10,300	764.00	7,869,200	
福島銀行	5,100	455.00	2,320,500	貸付株式数 3,000株
大東銀行	2,900	650.00	1,885,000	
リコーリース	4,600	3,295.00	15,157,000	
イオンフィナンシャルサー ビス	37,800	2,065.00	78,057,000	
アコム	118,800	384.00	45,619,200	
ジャックス	6,500	1,863.00	12,109,500	貸付株式数 2,500株
オリコ	163,600	144.00	23,558,400	貸付株式数 63,600株
日立キャピタル	14,000	2,384.00	33,376,000	
アプラスフィナンシャル	31,700	83.00	2,631,100	貸付株式数 16,300株
オリックス	394,400	1,684.00	664,169,600	
三菱UFJリース	133,500	533.00	71,155,500	
ジャフコ	9,700	3,610.00	35,017,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
九州リースサービス	3,000	615.00	1,845,000	
トモニホールディングス	45,600	433.00	19,744,800	
大和証券G本社	474,900	611.60	290,448,840	
野村ホールディングス	1,086,600	459.10	498,858,060	
岡三証券グループ	49,900	519.00	25,898,100	貸付株式数 18,000株
丸三証券	17,800	827.00	14,720,600	貸付株式数 6,900株
東洋証券	21,300	181.00	3,855,300	
東海東京HD	70,100	498.00	34,909,800	
光世証券	1,400	834.00	1,167,600	
水戸証券	17,100	280.00	4,788,000	
いちよし証券	12,300	836.00	10,282,800	
松井証券	29,000	1,224.00	35,496,000	
SOMPOホールディング ス	114,500	3,945.00	451,702,500	
だいこう証券ビジ	2,400	432.00	1,036,800	
日本取引所グループ	160,200	1,875.00	300,375,000	
マネックスG	55,400	379.00	20,996,600	貸付株式数 21,900株 (5,100株)

カブドットコム証券	43,900	386.00	16,945,400		
極東証券	7,800	1,201.00	9,367,800	貸付株式数	3,200株
岩井コスモホールディング	6,000	1,224.00	7,344,000	貸付株式数	2,400株
藍澤証券	11,000	726.00	7,986,000	貸付株式数	1,000株
フィデアホール	57,900	139.00	8,048,100		
池田泉州HD	63,100	307.00	19,371,700	貸付株式数	4,100株
アニコムホールディングス	4,500	3,515.00	15,817,500	貸付株式数	500株
MS&AD	153,000	3,231.00	494,343,000		
SONY FH	48,000	2,203.00	105,744,000		
マネーパートナーズGP	6,800	295.00	2,006,000		
小林洋行	2,000	254.00	508,000	貸付株式数	800株
第一生命HLDGS	332,000	1,849.50	614,034,000		
東京海上HD	213,500	5,321.00	1,136,033,500	貸付株式数	84,400株
アドバンテッジリスクマネ	2,200	1,019.00	2,241,800	貸付株式数	800株
イー・ギャランティ	5,500	986.00	5,423,000	貸付株式数	3,300株
アサックス	2,600	577.00	1,500,200		
NECキャピタルソリューション	2,500	1,531.00	3,827,500		
T&Dホールディングス	180,800	1,420.00	256,736,000		
アドバンスクリエイト	1,300	2,019.00	2,624,700		
三井不動産	313,300	2,674.00	837,764,200		
三菱地所	414,300	1,857.50	769,562,250		
平和不動産	11,700	1,812.00	21,200,400		
東京建物	65,300	1,247.00	81,429,100	貸付株式数	100株
ダイビル	18,200	1,202.00	21,876,400		
京阪神ビルディング	11,700	858.00	10,038,600	貸付株式数	2,000株
住友不動産	133,100	4,235.00	563,678,500	貸付株式数	23,600株
太平洋興発	2,300	799.00	1,837,700		
テーオーシー	14,300	810.00	11,583,000		
東京楽天地	900	4,745.00	4,270,500		
レオパレス21	73,700	461.00	33,975,700	貸付株式数	29,000株
スターツコーポレーション	8,400	2,498.00	20,983,200	貸付株式数	3,100株
フジ住宅	8,500	858.00	7,293,000	貸付株式数	1,000株
空港施設	8,100	550.00	4,455,000		
明和地所	4,200	592.00	2,486,400		
ゴールドクレスト	4,900	1,601.00	7,844,900		
リログループ	31,500	2,764.00	87,066,000		
日本エスリード	2,400	1,564.00	3,753,600		
日神不動産	9,000	457.00	4,113,000		

日本エスコ	10,900	663.00	7,226,700	貸付株式数	4,600株
タカラレーベン	27,900	311.00	8,676,900	貸付株式数	11,200株
サンヨーハウジ 名古屋	4,000	951.00	3,804,000		
イオンモール	30,200	1,832.00	55,326,400		
ファースト住建	2,600	1,222.00	3,177,200	貸付株式数	900株
ランド	258,500	8.00	2,068,000		
カチタス	6,600	2,806.00	18,519,600	貸付株式数	3,100株
東祥	3,600	3,765.00	13,554,000	貸付株式数	1,400株
トーセイ	8,400	917.00	7,702,800		
穴吹興産	900	2,886.00	2,597,400	貸付株式数	300株
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,900	1,675.00	13,232,500		
サンフロンティア不動産	8,400	1,122.00	9,424,800		
インテリックス	2,000	695.00	1,390,000		
ランドビジネス	4,200	700.00	2,940,000		
グランディハウス	6,100	388.00	2,366,800	貸付株式数	1,000株
東武鉄道	63,300	3,090.00	195,597,000		
相鉄ホールディングス	20,700	3,320.00	68,724,000		
東京急行	162,600	1,840.00	299,184,000		
京浜急行	82,100	1,816.00	149,093,600	貸付株式数	25,500株
小田急電鉄	95,900	2,443.00	234,283,700		
京王電鉄	33,500	6,450.00	216,075,000	貸付株式数	5,000株
京成電鉄	45,100	3,515.00	158,526,500		
富士急行	8,200	3,165.00	25,953,000	貸付株式数	3,000株 (2,200株)
新京成電鉄	1,500	2,127.00	3,190,500		
東日本旅客鉄道	106,900	10,095.00	1,079,155,500	貸付株式数	41,900株
西日本旅客鉄道	53,900	7,870.00	424,193,000		
東海旅客鉄道	53,900	22,930.00	1,235,927,000	貸付株式数	21,100株
西武ホールディングス	76,100	2,029.00	154,406,900		
鴻池運輸	9,500	1,629.00	15,475,500		
西日本鉄道	16,700	2,788.00	46,559,600	貸付株式数	3,000株
ハマキョウレックス	4,600	3,720.00	17,112,000		
サカイ引越センター	3,200	5,830.00	18,656,000	貸付株式数	1,200株 (800株)
近鉄グループHLDGS	56,700	4,765.00	270,175,500		
阪急阪神HLDGS	75,500	3,760.00	283,880,000		
南海電鉄	25,300	2,930.00	74,129,000		
京阪ホールディングス	25,400	4,575.00	116,205,000		
神戸電鉄	1,400	3,935.00	5,509,000		
名古屋鉄道	45,400	2,841.00	128,981,400	貸付株式数	18,000株

山陽電鉄	4,300	2,211.00	9,507,300	
トランコム	1,600	6,320.00	10,112,000	貸付株式数 200株
日本通運	22,400	6,340.00	142,016,000	
ヤマトホールディングス	99,800	3,086.00	307,982,800	
山 九	15,800	5,270.00	83,266,000	
日 新	4,900	1,868.00	9,153,200	
丸 運	3,200	305.00	976,000	
丸全昭和運輸	4,600	2,818.00	12,962,800	
センコーグループHLDGS	31,200	837.00	26,114,400	貸付株式数 12,300株 (11,200株)
トナミホールディングス	1,400	5,610.00	7,854,000	貸付株式数 500株
ニッコンホールディングス	21,700	2,691.00	58,394,700	
日石輸送	700	2,862.00	2,003,400	
福山通運	7,300	4,365.00	31,864,500	
セイノーホールディングス	42,600	1,524.00	64,922,400	
エスライン	1,600	1,125.00	1,800,000	
神奈川中央交通	1,400	3,780.00	5,292,000	
日立物流	12,500	2,964.00	37,050,000	
丸和運輸機関	3,000	2,918.00	8,754,000	貸付株式数 800株 (800株)
C & F ロジホールディングス	5,700	1,208.00	6,885,600	
日本郵船	47,700	1,878.00	89,580,600	
商船三井	33,800	2,563.00	86,629,400	
川崎汽船	17,600	1,555.00	27,368,000	貸付株式数 6,900株
NSユナイテッド海運	3,200	3,190.00	10,208,000	
明治海運	5,900	360.00	2,124,000	貸付株式数 1,000株
飯野海運	27,500	411.00	11,302,500	
共栄タンカー	500	1,671.00	835,500	
九州旅客鉄道	47,900	3,755.00	179,864,500	
SGホールディングス	53,800	2,845.00	153,061,000	
日本航空	104,300	3,895.00	406,248,500	
ANAホールディングス	104,200	3,932.00	409,714,400	
パスコ	1,100	820.00	902,000	
西本WISMETTACHD	1,300	4,745.00	6,168,500	
ヤマシタヘルスケアHLDGS	400	1,200.00	480,000	
GENKY DRUGSTORES	2,300	3,390.00	7,797,000	貸付株式数 900株

国際紙パルプ商事	10,600	278.00	2,946,800	貸付株式数	1,000株
総合メディカルHD	5,100	2,243.00	11,439,300		
ブックオフGHD	3,000	765.00	2,295,000		
三菱倉庫	19,800	2,641.00	52,291,800	貸付株式数	6,000株
三井倉庫HOLD	6,900	1,844.00	12,723,600		
住友倉庫	21,500	1,382.00	29,713,000		
渋沢倉庫	3,100	1,568.00	4,860,800		
ヤマタネ	2,900	1,665.00	4,828,500	貸付株式数	1,200株
東陽倉庫	9,900	289.00	2,861,100	貸付株式数	1,000株
乾汽船	5,200	905.00	4,706,000		
日本トランスシティ	12,600	435.00	5,481,000	貸付株式数	6,000株
ケイヒン	1,000	1,347.00	1,347,000		
中央倉庫	3,400	1,008.00	3,427,200	貸付株式数	1,000株
川西倉庫	1,100	1,393.00	1,532,300	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,600	796.00	3,661,600		
東洋埠頭	1,700	1,445.00	2,456,500		
宇徳	4,700	500.00	2,350,000		
上組	35,200	2,361.00	83,107,200		
サンリツ	1,400	656.00	918,400		
キムラユニティー	1,500	1,028.00	1,542,000		
キューソー流通システム	1,400	2,236.00	3,130,400	貸付株式数	500株 (200株)
近鉄エクスプレス	10,700	1,735.00	18,564,500		
東海運	3,300	299.00	986,700	貸付株式数	1,000株
エーアイテイー	3,600	937.00	3,373,200	貸付株式数	1,000株
内外トランスライン	1,800	1,474.00	2,653,200	貸付株式数	600株
日本コンセプト	1,500	1,121.00	1,681,500		
東京放送HD	39,000	1,797.00	70,083,000		
日本テレビHLD S	54,200	1,706.00	92,465,200		
朝日放送グループHD	6,100	736.00	4,489,600		
テレビ朝日HD	16,200	2,109.00	34,165,800	貸付株式数	3,100株 (100株)
スカパーJ S A T H D	44,800	494.00	22,131,200		
テレビ東京HD	4,800	2,451.00	11,764,800	貸付株式数	2,000株 (1,500株)
日本BS放送	2,000	1,181.00	2,362,000	貸付株式数	700株
ビジョン	1,800	3,795.00	6,831,000		
USEN-NEXT H L D G S	2,300	957.00	2,201,100	貸付株式数	800株 (500株)

ワイヤレスゲート	2,500	456.00	1,140,000	貸付株式数 1,300株 (1,000株)
コネクシオ	4,100	1,351.00	5,539,100	
日本通信	50,500	110.00	5,555,000	貸付株式数 22,900株 (1,000株)
クロップス	1,000	662.00	662,000	
日本電信電話	403,400	4,604.00	1,857,253,600	
KDDI	519,900	2,661.00	1,383,453,900	貸付株式数 204,000株
光通信	6,900	17,700.00	122,130,000	
NTTドコモ	423,600	2,538.00	1,075,096,800	貸付株式数 166,200株
エムティーアイ	6,900	523.00	3,608,700	貸付株式数 2,800株
GMOインターネット	21,500	1,438.00	30,917,000	
アイドママーケティング コミュ	1,300	490.00	637,000	
カドカワ	17,200	1,198.00	20,605,600	貸付株式数 6,800株
学研ホールディングス	2,000	4,165.00	8,330,000	
ゼンリン	11,800	2,583.00	30,479,400	貸付株式数 4,600株
昭文社	2,700	475.00	1,282,500	
インプレスホールディング ス	4,900	142.00	695,800	
東京電力HD	479,500	733.00	351,473,500	
中部電力	183,700	1,674.50	307,605,650	貸付株式数 11,500株
関西電力	245,100	1,750.00	428,925,000	
中国電力	82,700	1,449.00	119,832,300	貸付株式数 32,800株
北陸電力	58,600	1,012.00	59,303,200	貸付株式数 400株
東北電力	140,600	1,503.00	211,321,800	
四国電力	54,000	1,407.00	75,978,000	
九州電力	123,500	1,357.00	167,589,500	
北海道電力	56,100	812.00	45,553,200	
沖縄電力	11,000	2,134.00	23,474,000	貸付株式数 100株
電源開発	47,700	2,795.00	133,321,500	
エフオン	3,600	895.00	3,222,000	
イーレックス	10,300	637.00	6,561,100	貸付株式数 4,100株
レノバ	6,200	862.00	5,344,400	貸付株式数 2,400株 (1,400株)
東京瓦斯	117,900	2,900.50	341,968,950	
大阪瓦斯	116,600	2,158.00	251,622,800	
東邦瓦斯	29,800	4,675.00	139,315,000	
北海道瓦斯	3,100	1,539.00	4,770,900	
広島ガス	11,900	347.00	4,129,300	貸付株式数 2,000株

西部瓦斯	6,700	2,508.00	16,803,600	貸付株式数	2,800株
静岡ガス	18,200	933.00	16,980,600		
メタウォーター	2,900	2,997.00	8,691,300	貸付株式数	1,300株
アイネット	3,300	1,450.00	4,785,000		
松竹	3,900	10,930.00	42,627,000	貸付株式数	1,400株
東宝	38,600	3,810.00	147,066,000		
エイチ・アイ・エス	10,200	3,715.00	37,893,000	貸付株式数	4,000株 (1,300株)
東映	2,500	13,000.00	32,500,000		
ラックランド	1,100	2,734.00	3,007,400	貸付株式数	400株
NTTデータ	157,300	1,290.00	202,917,000		
共立メンテナンス	8,700	4,995.00	43,456,500	貸付株式数	3,400株 (1,300株)
イチネンホールディングス	5,900	1,246.00	7,351,400	貸付株式数	900株
建設技術研究所	3,900	1,474.00	5,748,600		
スペース	3,700	1,174.00	4,343,800		
長大	2,200	802.00	1,764,400		
アインホールディングス	7,900	8,530.00	67,387,000	貸付株式数	3,000株
燦ホールディングス	1,200	2,393.00	2,871,600		
ピー・シー・エー	700	1,983.00	1,388,100		
スバル興業	400	5,470.00	2,188,000		
東京テアトル	2,400	1,304.00	3,129,600		
タナベ経営	1,100	1,430.00	1,573,000		
ビジネスB太田昭和	1,000	1,957.00	1,957,000	貸付株式数	400株
ナガワ	1,700	5,470.00	9,299,000		
よみうりランド	1,200	3,905.00	4,686,000		
東京都競馬	3,700	2,906.00	10,752,200	貸付株式数	1,400株
常磐興産	2,200	1,662.00	3,656,400		
カナモト	8,600	3,045.00	26,187,000		
東京ドーム	21,500	938.00	20,167,000		
DTS	6,600	3,590.00	23,694,000		
スクウェア・エニックス・HD	27,400	3,010.00	82,474,000		
シーイーシー	6,300	1,954.00	12,310,200		
カプコン	25,200	2,062.00	51,962,400		
西尾レントオール	5,800	3,485.00	20,213,000	貸付株式数	2,000株
アイ・エス・ビー	1,100	1,940.00	2,134,000		
アゴーラ・ホスピタリティーG	33,400	27.00	901,800	貸付株式数	6,500株
日本空港ビルデング	18,900	3,860.00	72,954,000		

トランス・コスモス	6,400	2,483.00	15,891,200	
乃村工藝社	13,400	2,750.00	36,850,000	
ジャステック	3,400	976.00	3,318,400	
S C S K	15,600	3,910.00	60,996,000	
藤田観光	2,300	2,992.00	6,881,600	貸付株式数 800株
KNT - CTホールディングス	3,000	1,127.00	3,381,000	
日本管財	6,200	1,983.00	12,294,600	
トーカイ	5,500	2,714.00	14,927,000	貸付株式数 300株
白 洋 舎	700	2,994.00	2,095,800	貸付株式数 200株
セコム	60,900	9,597.00	584,457,300	
日本システムウエア	1,900	1,938.00	3,682,200	
セントラル警備保障	2,800	5,450.00	15,260,000	
アイネス	7,400	1,136.00	8,406,400	貸付株式数 1,000株
丹青社	10,800	1,146.00	12,376,800	貸付株式数 3,000株
メイテック	7,300	4,670.00	34,091,000	
T K C	4,900	3,780.00	18,522,000	
富士ソフト	8,800	4,240.00	37,312,000	
応用地質	6,200	1,212.00	7,514,400	貸付株式数 1,100株
船井総研ホールディング	11,900	1,744.00	20,753,600	貸付株式数 4,600株
N S D	9,600	2,138.00	20,524,800	
進学会ホールディングス	2,800	634.00	1,775,200	
丸紅建材リース	500	1,930.00	965,000	
オ オ バ	4,400	697.00	3,066,800	
コナミホールディングス	24,100	4,785.00	115,318,500	
いであ	1,100	1,050.00	1,155,000	
学 究 社	1,900	1,569.00	2,981,100	
ベネッセホールディングス	21,100	3,000.00	63,300,000	貸付株式数 8,300株
イオンディライト	7,100	3,835.00	27,228,500	
ナック	3,800	1,039.00	3,948,200	
福井コンピュータH L D S	1,900	1,476.00	2,804,400	
ニチイ学館	8,100	1,079.00	8,739,900	
ダイセキ	9,600	2,373.00	22,780,800	
ステップ	2,100	1,256.00	2,637,600	貸付株式数 800株
日鉄住金物産	4,200	4,635.00	19,467,000	貸付株式数 1,000株
泉州電業	2,000	2,857.00	5,714,000	
元気寿司	1,600	4,395.00	7,032,000	
トラスコ中山	12,300	2,979.00	36,641,700	
ヤマダ電機	180,500	536.00	96,748,000	貸付株式数 73,400株 (400株)

オートバックスセブン	23,600	1,793.00	42,314,800	
モリト	4,100	812.00	3,329,200	
アークランドサカモト	9,900	1,405.00	13,909,500	
ニトリホールディングス	25,600	14,565.00	372,864,000	貸付株式数 5,000株
グルメ杵屋	4,100	1,174.00	4,813,400	
愛眼	4,700	293.00	1,377,100	貸付株式数 1,800株
ケーユーホールディングス	3,000	829.00	2,487,000	
吉野家ホールディングス	20,600	1,857.00	38,254,200	貸付株式数 8,100株
加藤産業	9,200	3,320.00	30,544,000	
北恵	1,000	1,151.00	1,151,000	
イノテック	4,000	972.00	3,888,000	貸付株式数 2,000株
イエローハット	5,500	2,666.00	14,663,000	
松屋フーズHLDGS	2,800	3,755.00	10,514,000	
JBCホールディングス	4,600	1,714.00	7,884,400	
JKホールディングス	5,500	558.00	3,069,000	
サガミホールディングス	7,800	1,352.00	10,545,600	貸付株式数 700株
日伝	4,800	1,558.00	7,478,400	
関西スーパーマーケット	4,400	997.00	4,386,800	
ミロク情報サービス	5,800	2,391.00	13,867,800	貸付株式数 2,300株
北沢産業	4,400	229.00	1,007,600	
杉本商事	3,100	1,685.00	5,223,500	
因幡電機産業	8,600	4,370.00	37,582,000	
王将フードサービス	4,300	7,640.00	32,852,000	
ブレナス	6,600	1,926.00	12,711,600	貸付株式数 2,600株 (2,500株)
ミニストップ	4,400	2,140.00	9,416,000	
アークス	11,100	2,564.00	28,460,400	
バローホールディングス	12,700	2,724.00	34,594,800	
バイテックホールディングス	2,700	2,035.00	5,494,500	
東テク	1,900	2,444.00	4,643,600	
ミスミグループ本社	74,100	2,401.00	177,914,100	貸付株式数 26,500株 (26,500株)
藤久	500	798.00	399,000	貸付株式数 200株
アルテック	4,400	233.00	1,025,200	
ベルク	2,900	5,500.00	15,950,000	
大庄	3,100	1,612.00	4,997,200	
タキヒヨー	1,700	1,844.00	3,134,800	
ファーストリテイリング	7,900	60,010.00	474,079,000	貸付株式数 3,100株
ソフトバンクグループ	246,500	8,259.00	2,035,843,500	

蔵王産業	900	1,300.00	1,170,000	
スズケン	27,000	5,940.00	160,380,000	
サンドラッグ	22,300	3,665.00	81,729,500	
サクスパーホールディング	5,000	1,137.00	5,685,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
ジェコス	4,000	1,076.00	4,304,000	
ヤマザワ	1,200	1,729.00	2,074,800	貸付株式数 400株
やまや	1,000	2,234.00	2,234,000	
ルネサスイーストン	5,500	400.00	2,200,000	貸付株式数 1,000株
ベルーナ	14,400	1,015.00	14,616,000	
合計			132,803,813,650	

(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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	405,471,667	328,173,314
金銭信託	-	63,196,362

コール・ローン	189,200,610	264,708,392
株式	92,687,655,335	96,598,974,693
投資証券	2,529,090,313	2,730,416,158
派生商品評価勘定	13,640,211	-
未収入金	1,128,731	461,333
未収配当金	123,218,810	136,354,519
差入委託証拠金	752,492,066	744,120,976
流動資産合計	96,701,897,743	100,866,405,747
資産合計	96,701,897,743	100,866,405,747
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	498,240	29,605,952
未払解約金	72,256,900	3,167,800
その他未払費用	-	3,729
流動負債合計	72,755,140	32,777,481
負債合計	72,755,140	32,777,481
純資産の部		
元本等		
元本	1	39,738,227,827
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		56,890,914,776
元本等合計		96,629,142,603
純資産合計		96,629,142,603
負債純資産合計		96,701,897,743

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	40,367,016,462円	39,738,227,827円
期中追加設定元本額	5,794,523,705円	7,465,582,702円
期中一部解約元本額	6,423,312,340円	3,107,549,330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	561,940,757円	499,385,747円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	18,626,936円	14,096,372円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	270,075,076円	195,204,265円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	32,623,332円	25,078,769円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	888,111,878円	623,000,121円
外国株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	846,375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)	413,513,055円	553,148,518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)	927,597,200円	1,514,122,256円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	311,112,761円	532,534,499円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,828,241円	5,540,781円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	175,432円	197,868円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	392,436,479円	737,760,888円
i F r e e 8資産バランス	294,049,882円	579,355,553円
i F r e e 年金バランス	- 円	8,552,977円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	24,119,249,594円	27,685,196,810円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	497,058,709円	571,047,005円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	709,194,443円	844,962,807円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	561,812,076円	681,438,616円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,434,214,433円	1,490,108,018円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	5,218,402円	4,180,386円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	14,136,612円	13,352,537円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,584,603円	4,236,847円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	- 円	6,232,510円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	81,383円	76,173円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	162,594円	156,042円

ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	2,143,628円	1,204,032円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	7,922,722円	2,140,945円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	485,331,409円	238,397,161円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	393,970,223円	348,671,890円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,763,739,239円	3,140,769,877円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	176,212,362円	153,782,925円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	502,490,994円	635,373,798円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	44,779,107円	88,789,723円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	464,604円	453,618円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,754,344,985円	2,748,317,297円
ダイワライフスタイル25	20,386,271円	19,476,612円
ダイワライフスタイル50	71,290,918円	70,259,055円
ダイワライフスタイル75	58,347,487円	58,811,526円
計	39,738,227,827円	44,096,261,199円
2. 期末日における受益権の総数	39,738,227,827口	44,096,261,199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29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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30年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
--	---------------	---------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	1,137,078,677	6,210,725,766
投資証券	15,405,148	87,905,261
合計	1,152,483,825	6,298,631,027

(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29年12月1日から平成29年12月18日まで、及び平成30年12月1日から平成30年12月18日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	平成29年12月18日 現在				平成30年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数 先物取引								
買 建	1,377,511,961	-	1,391,142,672	13,630,711	1,454,705,923	-	1,426,902,061	27,803,862
合計	1,377,511,961	-	1,391,142,672	13,630,711	1,454,705,923	-	1,426,902,061	27,803,862

(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。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29年12月18日 現在				平成30年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	124,227,740	-	123,739,000	488,740	271,802,090	-	270,000,000	1,802,090
アメリカ・ドル	124,227,740	-	123,739,000	488,740	271,802,090	-	270,000,000	1,802,090
合計	124,227,740	-	123,739,000	488,740	271,802,090	-	270,000,000	1,802,090

(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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.4316円	2.2867円
(1万口当たり純資産額)	(24,316円)	(22,867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	3,050	94.790	289,109.500	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,500	176.610	441,525.000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,800	59.900	287,520.000	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,600	138.490	221,584.000	
SYNCHRONY FINANCIAL	18,800	23.490	441,612.000	
ABBOTT LABORATORIES	45,666	69.750	3,185,203.500	
ARCONIC INC	11,333	19.150	217,026.950	
VERISK ANALYTICS INC	4,150	111.050	460,857.500	
LAS VEGAS SANDS CORP	10,500	52.610	552,405.000	
AMPHENOL CORP-CL A	7,800	82.540	643,812.000	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,829	102.060	901,087.740	
QORVO INC	3,400	60.340	205,156.000	
AFLAC INC	20,300	44.320	899,696.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	3,400	98.890	336,226.000	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3,900	52.360	204,204.000	
ADOBE INC	12,780	221.380	2,829,236.400	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,950	41.370	246,151.500	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,600	118.870	309,062.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,000	15.180	151,800.000	
GARMIN LTD	2,900	63.110	183,019.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,800	153.810	892,098.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	19,650	134.380	2,640,567.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,471	81.970	366,487.870	
WR BERKLEY CORP	2,550	73.080	186,354.000	
AUTOZONE INC	700	854.180	597,926.000	
DOLLAR TREE INC	6,321	85.010	537,348.210	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	25,700	17.650	453,605.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,950	88.420	260,839.000	
CELANESE CORP	3,550	84.410	299,655.500	
DR HORTON INC	9,416	35.300	332,384.800	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,450	44.740	109,613.000	
DENTSPLY SIRONA INC	5,900	37.170	219,303.000	
AUTODESK INC	5,750	127.270	731,802.500	
MOODY'S CORP	4,450	141.390	629,185.500	
DEVON ENERGY CORP	13,950	25.510	355,864.500	

ALBEMARLE CORP	2,800	80.510	225,428.000	
ATMOS ENERGY CORP	3,050	95.560	291,458.000	
ALLIANT ENERGY CORP	6,250	44.130	275,812.500	
CITIGROUP INC	66,073	54.250	3,584,460.250	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	11,500	132.470	1,523,405.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	13,000	77.330	1,005,290.000	
ALLEGHANY CORP	410	597.710	245,061.100	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	242.190	266,409.000	
HESS CORP	7,200	49.760	358,272.000	
DAVITA INC	3,500	56.700	198,450.000	
DANAHER CORP	16,850	100.370	1,691,234.500	
FORTIVE CORP	7,800	67.950	530,010.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	15,150	76.380	1,157,157.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,900	18.400	90,160.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,728	17.020	80,470.560	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,100	43.380	655,038.000	
BUNGE LTD	3,600	57.890	208,404.000	
TE CONNECTIVITY LTD	9,425	72.010	678,694.250	
APPLE INC	127,250	163.940	20,861,365.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,000	59.900	539,100.000	
BOEING CO/THE	14,310	316.130	4,523,820.300	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,215	77.260	325,650.900	
BECTON DICKINSON AND CO	7,019	225.850	1,585,241.150	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	17.550	117,585.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,850	55.510	213,713.500	
CDK GLOBAL INC	3,200	46.890	150,048.000	
NISOURCE INC	9,350	26.640	249,084.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,600	84.840	305,424.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	26,521	48.980	1,298,998.580	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	107,454	55.950	6,012,051.300	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	34,300	197.920	6,788,656.000	
ANSYS INC	2,250	146.420	329,445.000	
H&R BLOCK INC	5,100	26.230	133,773.000	
BB&T CORP	20,750	45.150	936,862.500	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	43,200	50.920	2,199,744.000	
JPMORGAN CHASE & CO	87,770	99.010	8,690,107.700	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,300	91.030	573,489.000	

CIGNA CORP	6,400	198.660	1,271,424.000	
LKQ CORP	8,500	24.550	208,675.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,000	132.350	132,350.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,862	45.890	314,897.180	
CADENCE DESIGN SYS INC	7,250	42.310	306,747.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,810	108.660	413,994.600	
DOLLAR GENERAL CORP	6,950	103.120	716,684.000	
SERVICENOW INC	4,650	171.470	797,335.500	
CATERPILLAR INC	15,550	124.470	1,935,508.500	
CMS ENERGY CORP	7,700	51.400	395,780.000	
MOSAIC CO/THE	9,750	30.060	293,085.000	
DELTA AIR LINES INC	4,750	52.390	248,852.500	
CORNING INC	21,300	30.900	658,170.000	
CISCO SYSTEMS INC	123,750	44.200	5,469,750.000	
MORGAN STANLEY	34,600	39.600	1,370,160.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,400	103.090	144,326.000	
MSCI INC	2,300	144.210	331,683.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,000	210.190	210,190.000	
MIDDLEBY CORP	1,450	107.730	156,208.500	
COTY INC-CL A	13,539	7.070	95,720.730	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	5,600	44.280	247,968.000	
BROADCOM INC	11,452	254.130	2,910,296.760	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,200	106.590	127,908.000	
ACUITY BRANDS INC	1,000	115.770	115,770.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,430	74.300	180,549.000	
ARAMARK	6,450	31.160	200,982.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5,350	21.780	116,523.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,950	114.140	564,993.000	
CENTENE CORP	5,450	121.420	661,739.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,000	100.270	300,810.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,900	30.080	388,032.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,000	72.410	362,050.000	
GARTNER INC	2,350	133.340	313,349.000	
SPLUNK INC	3,800	100.570	382,166.000	
DOMINION ENERGY INC	17,200	74.000	1,272,800.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,100	51.250	568,875.000	
SMITH (A.O.) CORP	3,650	42.380	154,687.000	
DEERE & CO	8,000	146.080	1,168,640.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	4,250	99.630	423,427.500	

VMWARE INC-CLASS A	1,950	152.930	298,213.500	
CHEMOURS CO/THE	4,550	27.020	122,941.000	
BURLINGTON STORES INC	1,900	157.790	299,801.000	
NASDAQ INC	3,150	85.250	268,537.500	
VAIL RESORTS INC	1,120	228.560	255,987.200	
EAST WEST BANCORP INC	3,650	44.230	161,439.500	
TARGA RESOURCES CORP	5,850	40.850	238,972.500	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,650	136.840	225,786.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,980	89.940	178,081.200	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,050	65.000	68,250.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	8,400	80.630	677,292.000	
COGNEX CORP	4,550	38.630	175,766.500	
TELEFLEX INC	1,230	245.750	302,272.500	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,300	93.680	215,464.000	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,400	236.950	331,730.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,150	86.020	270,963.000	
IDEX CORP	1,950	129.310	252,154.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	21,650	62.920	1,362,218.000	
ROLLINS INC	3,825	35.850	137,126.250	
AMETEK INC	6,175	69.170	427,124.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,500	65.470	425,555.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,650	26.780	97,747.000	
XPO LOGISTICS INC	3,450	53.830	185,713.500	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,550	82.190	702,724.500	
COSTCO WHOLESALE CORP	11,400	202.230	2,305,422.000	
SCANA CORP	3,500	48.930	171,255.000	
GRUBHUB INC	2,600	75.890	197,314.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,350	95.460	128,871.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	650	443.500	288,275.000	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	7,600	17.600	133,760.000	
UGI CORP	4,600	55.210	253,966.000	
CUMMINS INC	4,050	131.450	532,372.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,150	47.080	901,582.000	
SABRE CORP	6,850	22.830	156,385.500	
CDW CORP/DE	4,050	84.730	343,156.500	
SIGNATURE BANK	1,500	107.970	161,955.000	

COSTAR GROUP INC	970	345.000	334,650.000	
SVB FINANCIAL GROUP	1,390	192.760	267,936.400	
AMERCO	220	342.550	75,361.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,650	124.420	205,293.000	
MERCADOLIBRE INC	1,090	310.490	338,434.100	
HANESBRANDS INC	9,500	12.970	123,215.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,100	128.750	270,375.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7,416	70.270	521,122.320	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	5,350	16.630	88,970.500	
IPG PHOTONICS CORP	1,020	117.200	119,544.000	
DEXCOM INC	2,450	113.700	278,565.000	
COPART INC	5,400	47.190	254,826.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,250	88.540	376,295.000	
SEATTLE GENETICS INC	2,900	58.630	170,027.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,070	206.970	428,427.900	
TRANSDIGM GROUP INC	1,280	339.850	435,008.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,000	25.300	227,700.000	
KINDER MORGAN INC	53,581	15.840	848,723.040	
HCA HEALTHCARE INC	7,350	123.120	904,932.000	
CABOT OIL & GAS CORP	12,050	22.610	272,450.500	
T-MOBILE US INC	9,000	64.810	583,290.000	
ZILLOW GROUP INC - C	3,450	30.990	106,915.500	
COCA-COLA CO/THE	105,100	48.330	5,079,483.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,750	46.830	269,272.500	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,550	69.640	316,862.000	
EATON VANCE CORP	3,050	34.850	106,292.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,650	30.490	263,738.500	
CSX CORP	21,400	64.680	1,384,152.000	
FLUOR CORP	3,650	32.580	118,917.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,780	133.800	371,964.000	
EXPEDIA GROUP INC	3,225	116.930	377,099.250	
AUTOLIV INC	2,400	71.750	172,200.000	
AMAZON.COM INC	10,940	1,520.910	16,638,755.400	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	6,650	16.140	107,331.000	
FLOWSERVE CORP	3,550	40.740	144,627.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,450	155.020	844,859.000	
EXXON MOBIL CORP	111,005	74.040	8,218,810.200	

FLIR SYSTEMS INC	3,750	42.340	158,775.000	
AES CORP	17,000	14.880	252,960.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	2,050	188.190	385,789.500	
EVEREST RE GROUP LTD	1,120	217.780	243,913.600	
EOG RESOURCES INC	15,250	96.210	1,467,202.500	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,450	64.210	285,734.500	
ABIOMED INC	1,170	298.770	349,560.900	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,250	77.000	327,250.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,390	67.850	569,261.500	
FORD MOTOR CO	99,623	8.500	846,795.500	
MACY'S INC	8,098	30.280	245,207.440	
DISCOVERY INC - A	3,990	27.520	109,804.800	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	22.840	111,619.080	
DISCOVERY INC-C	7,989	25.630	204,758.070	
AERCAP HOLDINGS NV	3,400	45.740	155,516.000	
FORTINET INC	3,800	68.240	259,312.000	
MARKEL CORP	360	1,027.660	369,957.600	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,400	21.700	95,480.000	
NEXTERA ENERGY INC	12,250	175.650	2,151,712.500	
FREEMPORT-MCMORAN INC	36,408	10.590	385,560.720	
US BANCORP	40,350	47.940	1,934,379.000	
UNITED RENTALS INC	2,150	105.410	226,631.500	
F5 NETWORKS INC	1,600	163.070	260,912.000	
FASTENAL CO	7,700	52.970	407,869.000	
FISERV INC	10,700	74.430	796,401.000	
GENERAL ELECTRIC CO	226,350	7.150	1,618,402.500	
NEKTAR THERAPEUTICS	4,450	34.160	152,012.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	5,600	47.140	263,984.000	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	6,050	20.570	124,448.500	
GENERAL MOTORS CO	33,400	34.660	1,157,644.000	
TRIPADVISOR INC	2,750	57.710	158,702.500	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,600	163.450	1,078,770.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,340	168.010	1,569,213.400	
ALPHABET INC-CL A	7,850	1,025.650	8,051,352.500	
ALPHABET INC-CL C	8,267	1,016.530	8,403,653.510	
OWENS CORNING	2,750	42.940	118,085.000	
GENERAL MILLS INC	15,650	36.740	574,981.000	
FIRSTENERGY CORP	12,568	37.720	474,064.960	

GENUINE PARTS CO	4,000	96.500	386,000.000	
IHS MARKIT LTD	10,184	48.550	494,433.200	
FIFTH THIRD BANCORP	17,600	23.740	417,824.000	
HARRIS CORP	3,050	145.910	445,025.500	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	32.040	96,120.000	
HALLIBURTON CO	23,400	29.090	680,706.000	
HOME DEPOT INC	29,850	167.970	5,013,904.500	
ASSURANT INC	1,400	90.000	126,000.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	29,400	11.900	349,860.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,190	197.360	234,858.400	
HERSHEY CO/THE	3,750	105.170	394,387.500	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,450	33.940	151,033.000	
HUMANA INC	3,600	303.220	1,091,592.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,400	75.270	707,538.000	
HELMERICH & PAYNE	2,900	56.370	163,473.000	
HENRY SCHEIN INC	4,050	79.740	322,947.000	
HP INC	43,300	21.420	927,486.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	39,400	13.590	535,446.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,800	38.590	185,232.000	
HOLLYFRONTIER CORP	4,300	52.680	226,524.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	5,450	30.610	166,824.500	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,100	38.560	80,976.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,350	26.410	273,343.500	
KRAFT HEINZ CO/THE	16,153	46.820	756,283.460	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	23,850	116.100	2,768,985.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	10,000	41.350	413,500.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,600	39.630	142,668.000	
ZOETIS INC	12,650	84.940	1,074,491.000	
INGERSOLL-RAND PLC	6,579	93.700	616,452.300	
CHENIERE ENERGY INC	5,450	58.790	320,405.500	
ALLEGION PLC	2,450	83.670	204,991.500	
LEGGETT & PLATT INC	3,500	36.330	127,155.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	13,673	22.030	301,216.190	
WASTE CONNECTIONS INC	6,857	75.300	516,332.100	

JUNIPER NETWORKS INC	8,900	27.380	243,682.000	
JM SMUCKER CO/THE	2,920	99.000	289,080.000	
JOHNSON & JOHNSON	70,500	129.140	9,104,370.000	
ABBVIE INC	39,429	84.930	3,348,704.970	
HOLOGIC INC	7,100	40.260	285,846.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	9,300	114.180	1,061,874.000	
KROGER CO	21,850	28.920	631,902.000	
KLA-TENCOR CORP	4,100	88.940	364,654.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	6,670	279.230	1,862,464.100	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,320	178.270	413,586.400	
L BRANDS INC	6,500	29.510	191,815.000	
LOWE'S COS INC	21,200	90.450	1,917,540.000	
ELI LILLY & CO	25,250	108.360	2,736,090.000	
LAM RESEARCH CORP	4,230	135.680	573,926.400	
JONES LANG LASALLE INC	1,250	126.860	158,575.000	
LOEWS CORP	7,250	45.010	326,322.500	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,799	52.560	304,795.440	
MCDONALD'S CORP	20,350	180.790	3,679,076.500	
3M CO	15,350	192.820	2,959,787.000	
FACEBOOK INC-CLASS A	63,650	140.190	8,923,093.500	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	5,404	105.080	567,852.320	
MANPOWERGROUP INC	1,780	67.380	119,936.400	
S&P GLOBAL INC	6,730	166.290	1,119,131.700	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,720	175.620	302,066.400	
CONCHO RESOURCES INC	5,250	109.780	576,345.000	
FIRST DATA CORP- CLASS A	14,550	16.420	238,911.000	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,300	23.540	124,762.000	
PHILLIPS 66	11,600	85.860	995,976.000	
TECHNIPFMC PLC	11,150	19.700	219,655.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	13,400	25.610	343,174.000	
MATTEL INC	8,700	11.170	97,179.000	
DXC TECHNOLOGY CO	7,338	55.490	407,185.620	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,200	146.130	467,616.000	
MYLAN NV	13,750	28.840	396,550.000	
METLIFE INC	22,700	38.880	882,576.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	16,900	15.250	257,725.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,390	210.170	292,136.300	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,200	40.290	169,218.000	

MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,278	123.240	527,220.720	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	690	572.340	394,914.600	
BAKER HUGHES A GE CO	13,273	21.620	286,962.260	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,230	153.310	495,191.300	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,940	32.040	94,197.600	
MERCK & CO. INC.	69,621	75.230	5,237,587.830	
DOWDUPONT INC	61,055	51.680	3,155,322.400	
MASCO CORP	7,900	28.890	228,231.000	
M & T BANK CORP	3,519	146.350	515,005.650	
MARSH & MCLENNAN COS	13,250	81.460	1,079,345.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,722	107.660	831,350.520	
WORKDAY INC-CLASS A	3,950	153.760	607,352.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,650	93.450	154,192.500	
SQUARE INC - A	8,150	58.620	477,753.000	
TRANSUNION	4,700	56.640	266,208.000	
VISTRA ENERGY CORP	8,700	23.890	207,843.000	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,850	38.100	146,685.000	
WORLDPAY INC-CLASS A	7,950	76.880	611,196.000	
BEIGENE LTD-ADR	950	133.440	126,768.000	
NETAPP INC	6,850	59.610	408,328.500	
NIKE INC -CL B	33,950	69.900	2,373,105.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,400	147.580	1,092,092.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,400	71.210	455,744.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,450	73.590	253,885.500	
ALLY FINANCIAL INC	11,450	22.750	260,487.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,300	257.240	1,106,132.000	
APTIV PLC	6,850	64.440	441,414.000	
NEWMONT MINING CORP	14,000	33.610	470,540.000	
MCKESSON CORP	5,300	111.900	593,070.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,600	52.200	396,720.000	
XYLEM INC	4,800	64.300	308,640.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	40,450	81.400	3,292,630.000	
NUCOR CORP	8,200	54.820	449,524.000	
WESTERN UNION CO	11,746	17.820	209,313.720	
GODADDY INC - CLASS A	4,500	61.090	274,905.000	
NEWELL BRANDS INC	12,292	21.500	264,278.000	
EVERGY INC	6,950	58.350	405,532.500	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	20,500	64.110	1,314,255.000	
LIBERTY BROADBAND-C	2,850	77.730	221,530.500	
LINDE PLC	14,796	157.330	2,327,854.680	
WIX.COM LTD	1,300	83.180	108,134.000	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	5,200	16.830	87,516.000	
PAYCHEX INC	8,350	64.950	542,332.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,120	340.940	722,792.800	
ALTRIA GROUP INC	49,100	52.350	2,570,385.000	
P G & E CORP	13,250	24.440	323,830.000	
PFIZER INC	155,213	43.110	6,691,232.430	
ALKERMES PLC	4,000	32.950	131,800.000	
XCEL ENERGY INC	13,150	51.730	680,249.500	
STRYKER CORP	9,000	160.110	1,440,990.000	
PARKER HANNIFIN CORP	3,500	149.850	524,475.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,500	133.430	600,435.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,550	78.210	121,225.500	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	65,067	92.770	6,036,265.590	
EXELON CORP	25,472	45.610	1,161,777.920	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,750	109.530	629,797.500	
NVR INC	90	2,453.380	220,804.200	
CONOCOPHILLIPS	30,300	63.120	1,912,536.000	
PEPSICO INC	37,500	112.870	4,232,625.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,000	81.630	897,930.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,850	93.580	453,863.000	
ACCENTURE PLC-CL A	16,700	151.670	2,532,889.000	
PENTAIR PLC	4,205	38.320	161,135.600	
QUALCOMM INC	36,950	57.000	2,106,150.000	
INVESCO LTD	10,950	17.000	186,150.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,900	158.840	301,796.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,800	43.770	341,406.000	
RAYTHEON COMPANY	7,520	165.940	1,247,868.800	
RED HAT INC	4,750	176.000	836,000.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,090	375.500	784,795.000	
REPUBLIC SERVICES INC	6,000	73.780	442,680.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,250	1,739.520	2,174,400.000	
ROSS STORES INC	9,950	78.280	778,886.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,400	86.740	208,176.000	
RESMED INC	3,700	110.760	409,812.000	

QUEST DIAGNOSTICS INC	3,550	85.360	303,028.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,350	56.150	188,102.500	
RALPH LAUREN CORP	1,450	100.960	146,392.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	28,835	13.390	386,100.650	
CHEVRON CORP	50,668	112.450	5,697,616.600	
EDISON INTERNATIONAL	8,800	58.190	512,072.000	
TESLA INC	3,420	348.420	1,191,596.400	
SYMANTEC CORP	16,150	20.650	333,497.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,122	119.980	494,557.560	
SYNOPSYS INC	4,100	85.630	351,083.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,505	309.280	1,393,306.400	
CBRE GROUP INC - A	8,700	39.460	343,302.000	
TWITTER INC	17,900	33.430	598,397.000	
SOUTHERN CO/THE	26,650	46.000	1,225,900.000	
SYSCO CORP	13,300	64.210	853,993.000	
TRAVELERS COS INC/THE	7,123	119.930	854,261.390	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,550	46.890	166,459.500	
STEEL DYNAMICS INC	6,200	31.390	194,618.000	
SCHLUMBERGER LTD	35,902	39.050	1,401,973.100	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,600	41.980	193,108.000	
AT&T INC	188,791	29.860	5,637,299.260	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,650	49.390	180,273.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	11,000	17.320	190,520.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,190	376.450	824,425.500	
SEMPRA ENERGY	7,350	114.930	844,735.500	
TIFFANY & CO	2,950	80.690	238,035.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,050	37.430	263,881.500	
TEXAS INSTRUMENTS INC	25,300	91.920	2,325,576.000	
SALESFORCE.COM INC	19,050	130.830	2,492,311.500	
WESTROCK CO	6,630	40.190	266,459.700	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	23,884	31.060	741,837.040	
UNION PACIFIC CORP	20,150	139.600	2,812,940.000	
MARATHON OIL CORP	22,600	14.720	332,672.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	18,488	58.840	1,087,833.920	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	21,437	115.310	2,471,900.470	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	18,400	96.870	1,782,408.000	

UNUM GROUP	5,900	29.260	172,634.000	
SPRINT CORP	20,765	5.820	120,852.300	
ANTERO RESOURCES CORP	5,100	10.780	54,978.000	
IQVIA HOLDINGS INC	4,194	115.660	485,078.040	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	40.420	175,827.000	
AMEREN CORPORATION	6,250	67.310	420,687.500	
UNITEDHEALTH GROUP INC	25,476	258.070	6,574,591.320	
VERISIGN INC	2,900	150.100	435,290.000	
VALERO ENERGY CORP	11,292	72.580	819,573.360	
ULTA BEAUTY INC	1,510	241.950	365,344.500	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	7,488	31.110	232,951.680	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,300	118.490	272,527.000	
ANTHEM INC	6,910	266.690	1,842,827.900	
WALT DISNEY CO/THE	38,700	110.620	4,280,994.000	
WELLS FARGO & CO	119,622	46.610	5,575,581.420	
WASTE MANAGEMENT INC	11,500	89.050	1,024,075.000	
WILLIAMS COS INC	31,900	22.980	733,062.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,200	87.020	278,464.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	111.470	189,499.000	
WALMART INC	39,000	90.770	3,540,030.000	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	72.800	211,120.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,300	107.250	568,425.000	
WYNN RESORTS LTD	2,600	104.480	271,648.000	
XEROX CORP	5,911	21.290	125,845.190	
WABTEC CORP	2,250	72.010	162,022.500	
TJX COMPANIES INC	32,800	44.340	1,454,352.000	
WATERS CORP	2,050	184.580	378,389.000	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,800	86.210	155,178.000	
ALLERGAN PLC	8,857	148.330	1,313,758.810	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	22,000	76.220	1,676,840.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,523	151.280	532,959.440	
WESTERN DIGITAL CORP	7,800	38.250	298,350.000	
WEC ENERGY GROUP INC	8,280	72.050	596,574.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	13,400	53.410	715,694.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	47,050	131.400	6,182,370.000	
PPL CORP	18,600	29.960	557,256.000	

PULTEGROUP INC	6,900	25.640	176,916.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,450	97.130	626,488.500	
NORTHERN TRUST CORP	5,650	85.620	483,753.000	
NVIDIA CORP	15,000	143.580	2,153,700.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,050	175.420	359,611.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12,243	118.320	1,448,591.760	
QURATE RETAIL INC	11,450	19.540	223,733.000	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4,700	36.490	171,503.000	
TYSON FOODS INC-CL A	7,900	53.470	422,413.000	
NETFLIX INC	11,340	262.800	2,980,152.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10,500	228.870	2,403,135.000	
NRG ENERGY INC	8,500	41.020	348,670.000	
TORCHMARK CORP	2,925	75.890	221,978.250	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,250	87.340	371,195.000	
TEXTRON INC	6,850	48.800	334,280.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	27,500	48.950	1,346,125.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	11,600	48.770	565,732.000	
NEWS CORP - CLASS A	10,237	12.070	123,560.590	
OGE ENERGY CORP	5,300	40.140	212,742.000	
OMNICOM GROUP	6,050	74.970	453,568.500	
ORACLE CORP	79,283	45.730	3,625,611.590	
MASTERCARD INC - A	24,050	190.450	4,580,322.500	
ONEOK INC	10,750	58.600	629,950.000	
CENTURYLINK INC	25,352	16.340	414,251.680	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,720	266.560	725,043.200	
YUM! BRANDS INC	8,300	89.710	744,593.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,050	102.190	311,679.500	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,330	161.180	214,369.400	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,050	60.570	305,878.500	
NOBLE ENERGY INC	12,400	21.160	262,384.000	
BANK OF AMERICA CORP	249,101	24.470	6,095,501.470	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,600	92.450	425,270.000	
NORDSTROM INC	3,000	47.660	142,980.000	
AMERICAN EXPRESS CO	19,050	101.180	1,927,479.000	
ANALOG DEVICES INC	9,999	87.310	873,012.690	

ADVANCED MICRO DEVICES	23,800	18.830	448,154.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	7,700	47.930	369,061.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	23,022	37.460	862,404.120	
ANADARKO PETROLEUM CORP	13,500	49.580	669,330.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,800	68.430	328,464.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,450	106.350	473,257.500	
AVERY DENNISON CORP	2,300	89.170	205,091.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	15,350	64.670	992,684.500	
EMERSON ELECTRIC CO	16,550	58.720	971,816.000	
AON PLC	6,300	150.370	947,331.000	
AMGEN INC	17,250	190.080	3,278,880.000	
TAPESTRY INC	7,650	34.730	265,684.500	
EATON CORP PLC	11,536	69.180	798,060.480	
CELGENE CORP	19,200	68.130	1,308,096.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,530	176.050	797,506.500	
APPLIED MATERIALS INC	26,300	32.670	859,221.000	
CIT GROUP INC	3,300	39.970	131,901.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,500	66.420	166,050.000	
CME GROUP INC	9,350	185.590	1,735,266.500	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	9,894	26.350	260,706.900	
ECOLAB INC	6,850	149.640	1,025,034.000	
EQUIFAX INC	3,150	97.240	306,306.000	
GAP INC/THE	5,950	25.460	151,487.000	
GILEAD SCIENCES INC	34,400	65.120	2,240,128.000	
HORMEL FOODS CORP	7,750	43.170	334,567.500	
STATE STREET CORP	10,243	63.890	654,425.270	
SUNTRUST BANKS INC	12,048	51.790	623,965.920	
SCHWAB (CHARLES) CORP	31,800	40.700	1,294,260.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,700	64.190	879,403.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,850	38.830	188,325.500	
CROWN HOLDINGS INC	3,450	45.210	155,974.500	
CARDINAL HEALTH INC	8,300	47.930	397,819.000	
FEDEX CORP	6,600	182.190	1,202,454.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	12,654	76.910	973,219.140	
FMC CORP	3,600	76.270	274,572.000	
FLEX LTD	14,750	7.630	112,542.500	
CERNER CORP	7,750	54.300	420,825.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,624	132.060	346,525.440	

CITRIX SYSTEMS INC	3,700	106.630	394,531.000	
INTEL CORP	120,500	47.080	5,673,140.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	10,200	21.760	221,952.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,750	41.790	407,452.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	7,950	128.100	1,018,395.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	41,700	6.120	255,204.000	
ILLUMINA INC	3,870	310.890	1,203,144.300	
SEALED AIR CORP	4,400	33.780	148,632.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,970	481.750	1,430,797.500	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,450	104.140	359,283.000	
SNAP-ON INC	1,550	145.620	225,711.000	
CARMAX INC	4,600	60.260	277,196.000	
COMERICA INC	4,500	69.520	312,840.000	
INGREDION INC	1,900	93.680	177,992.000	
DUKE ENERGY CORP	19,078	88.090	1,680,581.020	
TARGET CORP	13,250	64.320	852,240.000	
DOVER CORP	3,900	74.330	289,887.000	
VW GRAINGER INC	1,300	284.510	369,863.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,400	57.860	196,724.000	
CINTAS CORP	2,350	166.220	390,617.000	
CONAGRA BRANDS INC	12,700	29.010	368,427.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,100	75.440	309,304.000	
CLOROX COMPANY	3,300	156.740	517,242.000	
ENTERGY CORP	4,750	86.780	412,205.000	
MICROSOFT CORP	192,200	102.890	19,775,458.000	
INCYTE CORP	4,600	64.820	298,172.000	
CVS HEALTH CORP	33,569	70.690	2,372,992.610	
MEDTRONIC PLC	35,788	91.850	3,287,127.800	
MICRON TECHNOLOGY INC	30,550	33.880	1,035,034.000	
BLACKROCK INC	3,130	378.250	1,183,922.500	
CENTERPOINT ENERGY INC	12,900	28.910	372,939.000	
HASBRO INC	3,100	83.590	259,129.000	
KELLOGG CO	6,850	59.230	405,725.500	
KEYCORP	28,200	14.980	422,436.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,750	95.850	263,587.500	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	38,461	42.810	1,646,515.410	

KOHL'S CORP	4,450	60.920	271,094.000	
COOPER COS INC/THE	1,300	244.460	317,798.000	
APACHE CORP	9,860	30.170	297,476.200	
CHUBB LTD	12,049	127.630	1,537,813.870	
ARROW ELECTRONICS INC	2,400	69.890	167,736.000	
ALLSTATE CORP	9,200	80.160	737,472.000	
EBAY INC	24,900	28.480	709,152.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	29,300	84.100	2,464,130.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	3,750	70.480	264,300.000	
XILINX INC	6,550	87.180	571,029.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	14,710	96.640	1,421,574.400	
DISH NETWORK CORP-A	5,750	29.940	172,155.000	
ZIONS BANCORP NA	5,200	41.190	214,188.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,050	130.300	788,315.000	
TRIMBLE INC	6,400	33.550	214,720.000	
LENNAR CORP-A	7,600	40.020	304,152.000	
LEAR CORP	1,800	120.900	217,620.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,000	43.230	302,610.000	
PROGRESSIVE CORP	15,400	61.070	940,478.000	
PACCAR INC	9,137	56.090	512,494.330	
PVH CORP	2,000	91.340	182,680.000	
BIOGEN INC	5,460	313.100	1,709,526.000	
IDEXX LABORATORIES INC	2,220	183.790	408,013.800	
STARBUCKS CORP	35,450	64.470	2,285,461.500	
PTC INC	3,150	82.340	259,371.000	
PERRIGO CO PLC	3,400	56.380	191,692.000	
EVERSOURCE ENERGY	8,530	67.250	573,642.500	
INTUIT INC	6,520	197.490	1,287,634.800	
BORGWARNER INC	5,600	34.010	190,456.000	
BEST BUY CO INC	6,500	52.230	339,495.000	
BALL CORP	8,734	46.650	407,441.100	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	36,047	34.050	1,227,400.350	
ELECTRONIC ARTS INC	7,850	79.230	621,955.500	
VULCAN MATERIALS CO	3,450	98.380	339,411.000	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,850	166.170	1,138,264.500	
VF CORP	8,700	73.050	635,535.000	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	8,871	46.820	415,340.220	
VIACOM INC-CLASS B	9,271	28.080	260,329.680	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,720	115.750	199,090.000	

	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,400	115.640	277,536.000	
	CARNIVAL CORP	11,200	56.340	631,008.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	118,890	36.210	4,305,006.900	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,100	37.030	225,883.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,900	67.400	397,660.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	9.100	81,900.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	31,300	6.700	209,710.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 576,656,979.380 (65,041,140,704)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	MERLIN ENTERTAINMENT	19,300	3.265	63,014.500	
	TUI AG-DI	11,897	11.380	135,387.860	
	BP PLC	530,000	5.086	2,695,580.000	
	UNILEVER PLC	32,310	42.300	1,366,713.000	
	BARCLAYS PLC	465,000	1.528	710,706.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	44,000	8.078	355,432.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	42,100	2.513	105,797.300	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,480	66.740	165,515.200	
	PRUDENTIAL PLC	69,000	13.940	961,860.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	126,791	2.082	263,978.860	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,964	26.880	133,432.320	
	BAE SYSTEMS PLC	85,600	4.549	389,394.400	
	AVIVA PLC	107,566	3.685	396,380.710	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	133,402	14.676	1,957,807.750	
	INFORMA PLC	34,200	6.374	217,990.800	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	11,500	14.080	161,920.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	126,300	1.551	195,891.300	
	AUTO TRADER GROUP PLC	25,300	4.395	111,193.500	
	DCC PLC	2,600	59.200	153,920.000	
	GVC HOLDINGS PLC	14,000	6.860	96,040.000	
	CONVATEC GROUP PLC	33,000	1.411	46,563.000	
	ROYAL MAIL PLC	22,300	2.849	63,532.700	
	NMC HEALTH PLC	2,700	29.100	78,570.000	
	RELX PLC	52,846	16.390	866,145.940	
	DIAGEO PLC	65,300	28.090	1,834,277.000	
	RIO TINTO PLC	31,450	37.625	1,183,306.250	

STANDARD CHARTERED PLC	81,300	5.900	479,670.000	
TESCO PLC	264,800	1.902	503,782.000	
FRESNILLO PLC	5,600	8.190	45,864.000	
SMITH & NEPHEW PLC	23,550	14.670	345,478.500	
GLENCORE PLC	306,625	2.929	898,257.930	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	18,000	5.340	96,120.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	7,400	18.140	134,236.000	
SMITHS GROUP PLC	10,233	13.840	141,624.720	
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	5.198	31,707.800	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	36,883	3.049	112,456.260	
PEARSON PLC	20,163	9.400	189,532.200	
SAINSBURY (J) PLC	45,225	2.643	119,529.670	
NEXT PLC	3,850	41.370	159,274.500	
TAYLOR WIMPEY PLC	84,200	1.310	110,302.000	
WHITBREAD PLC	4,961	44.510	220,814.110	
BUNZL PLC	8,855	23.880	211,457.400	
VODAFONE GROUP PLC	719,183	1.607	1,155,727.080	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,443	46.000	158,378.000	
KINGFISHER PLC	55,411	2.160	119,687.760	
WPP PLC	33,100	8.708	288,234.800	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,727	7.560	141,576.120	
SEVERN TRENT PLC	6,333	18.705	118,458.760	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	17,850	61.760	1,102,416.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	13,600	9.262	125,963.200	
SCHRODERS PLC	3,450	23.660	81,627.000	
SSE PLC	28,000	10.550	295,400.000	
WEIR GROUP PLC/THE	6,850	13.305	91,139.250	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	25,900	4.340	112,406.000	
ASTRAZENECA PLC	34,100	60.430	2,060,663.000	
FERGUSON PLC	6,237	48.850	304,677.450	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	163,100	2.241	365,507.100	
3I GROUP PLC	25,391	7.640	193,987.240	
ASHTED GROUP PLC	12,700	16.535	209,994.500	
SAGE GROUP PLC/THE	29,714	5.896	175,193.740	
NATIONAL GRID PLC	90,034	8.353	752,054.000	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,919,965	0.519	996,461.830	
RSA INSURANCE GROUP PLC	26,260	4.966	130,407.160	
IMPERIAL BRANDS PLC	25,400	23.350	593,090.000	
CENTRICA PLC	152,660	1.355	206,930.630	

	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,200	33.190	106,208.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	61,910	26.280	1,626,994.800	
	BHP GROUP PLC	56,577	16.598	939,065.040	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	9,800	21.100	206,780.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	530,250	6.488	3,440,262.000	
	SHIRE PLC	24,324	45.325	1,102,485.300	
	ANGLO AMERICAN PLC	32,883	17.076	561,510.100	
	MONDI PLC	10,150	15.840	160,776.000	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	59,300	2.210	131,053.000	
	CARNIVAL PLC	4,861	43.700	212,425.700	
	EASYJET PLC	4,000	10.515	42,060.000	
	COMPASS GROUP PLC	42,239	16.635	702,645.760	
	PERSIMMON PLC	8,500	18.595	158,057.500	
	BT GROUP PLC	222,400	2.500	556,111.200	
	COCA-COLA HBC AG-DI	5,200	24.180	125,736.000	
	BURBERRY GROUP PLC	11,339	17.105	193,953.590	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,986	41.780	208,315.080	
	INTERTEK GROUP PLC	4,400	46.020	202,488.000	
	ITV PLC	93,100	1.300	121,030.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	8,349	40.200	335,629.800	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	121,700	23.220	2,825,874.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	99,568	23.390	2,328,895.520	
	MEGGITT PLC	21,500	4.736	101,824.000	
	G4S PLC	43,500	1.904	82,824.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,550	19.595	108,752.250	
	INVESTEC PLC	18,300	4.291	78,525.300	
	ANTOFAGASTA PLC	9,800	7.960	78,008.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	64,762	2.409	156,011.650	
	EXPERIAN PLC	24,054	18.745	450,892.230	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 45,635,631.920 (6,493,037,710)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	186.100	186,100.000	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,300	3.877	187,259.100	

	ISRAEL CHEMICALS LTD	17,600	20.230	356,048.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	464.500	278,700.000	
	BANK HAPOALIM BM	26,600	24.720	657,552.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	41,000	23.530	964,730.000	
	NICE LTD	1,650	419.900	692,835.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,000	65.600	196,800.000	
	イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 3,520,024.100 (105,459,922)	
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	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	72,800	2.350	171,080.000	
	BHP BILLITON LIMITED	86,550	33.530	2,902,021.500	
	SOUTH32 LTD	134,100	3.360	450,576.000	
	ALUMINA LTD	62,300	2.250	140,175.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	24,500	31.140	762,930.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	42,500	4.180	177,650.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	13,300	10.370	137,921.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	74,050	23.550	1,743,877.500	
	WESTPAC BANKING CORP	92,748	24.650	2,286,238.200	
	SANTOS LTD	45,200	5.550	250,860.000	
	AUSNET SERVICES	50,000	1.620	81,000.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	77,000	24.410	1,879,570.000	
	RIO TINTO LTD	10,950	76.170	834,061.500	
	ORIGIN ENERGY LTD	46,200	7.030	324,786.000	
	AMCOR LIMITED	31,400	13.360	419,504.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	54,300	4.460	242,178.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	27.100	92,140.000	
	COLES GROUP LTD	29,745	11.930	354,857.850	
	OIL SEARCH LTD	35,300	7.230	255,219.000	
	SEEK LTD	8,300	17.600	146,080.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	19,100	14.910	284,781.000	
	NEWCREST MINING LTD	20,950	20.850	436,807.500	
	INCITEC PIVOT LTD	42,300	3.470	146,781.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	47,400	69.260	3,282,924.000	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	7,150	27.050	193,407.500	
	ORICA LTD	10,100	17.250	174,225.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	36,050	10.270	370,233.500	

CIMIC GROUP LTD	2,400	43.260	103,824.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	35,100	28.640	1,005,264.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	8.480	116,176.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	48,400	4.370	211,508.000	
CROWN RESORTS LTD	9,600	12.100	116,160.000	
TELSTRA CORP LTD	110,500	2.900	320,450.000	
AMP LTD	75,000	2.360	177,000.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	12,050	15.210	183,280.500	
MACQUARIE GROUP LTD	8,584	113.260	972,223.840	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	15,250	22.590	344,497.500	
BANK OF QUEENSLAND LTD	10,800	9.630	104,004.000	
CSL LTD	12,050	183.740	2,214,067.000	
WESFARMERS LTD	30,945	31.940	988,383.300	
COCHLEAR LTD	1,500	175.220	262,830.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	14,400	11.980	172,512.000	
SUNCORP GROUP LTD	34,300	13.170	451,731.000	
BORAL LTD	30,500	4.980	151,890.000	
ASX LTD	5,000	60.110	300,550.000	
COMPUTERSHARE LTD	12,250	17.630	215,967.500	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	3.190	44,660.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	63,036	7.050	444,403.800	
SONIC HEALTHCARE LTD	10,400	22.630	235,352.000	
CHALLENGER LTD	13,900	9.870	137,193.000	
WORLEYPARSONS LTD	9,400	12.530	117,782.000	
AGL ENERGY LTD	17,400	19.800	344,520.000	
BRAMBLES LTD	41,500	10.110	419,565.000	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	43.790	61,306.000	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,850	54.820	211,057.000	
TPG TELECOM LTD	8,700	6.500	56,550.000	
REA GROUP LTD	1,350	74.110	100,048.500	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,650	41.150	67,897.500	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 29,194,538.490 (2,365,049,564)	
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
IMPERIAL OIL LTD	7,600	35.100	266,760.000	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	500	865.590	432,795.000	

PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,096	16.600	84,593.600	
RESTAURANT BRANDS INTERN	6,387	70.120	447,856.440	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	12,000	25.540	306,480.000	
INTACT FINANCIAL CORP	3,850	97.820	376,607.000	
BCE INC	4,130	55.780	230,371.400	
FRANCO-NEVADA CORP	5,100	95.930	489,243.000	
SUNCOR ENERGY INC	43,930	39.090	1,717,223.700	
METRO INC	6,200	46.530	288,486.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	9,000	57.570	518,130.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	33,100	71.640	2,371,284.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,850	105.520	1,250,412.000	
TORONTO-DOMINION BANK	49,100	68.800	3,378,080.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	7,600	27.270	207,252.000	
ROYAL BANK OF CANADA	38,350	93.500	3,585,725.000	
TOURMALINE OIL CORP	6,600	16.220	107,052.000	
VERMILION ENERGY INC	3,700	28.000	103,600.000	
TRANSCANADA CORP	24,650	52.320	1,289,688.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	13,229	42.930	567,920.970	
BOMBARDIER INC-B	53,000	2.020	107,060.000	
BARRICK GOLD CORP	30,400	18.300	556,320.000	
CAE INC	7,200	24.850	178,920.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,812	67.620	460,627.440	
EMPIRE CO LTD 'A'	4,600	28.540	131,284.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	63.370	101,392.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,850	50.330	193,770.500	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	6,400	9.960	63,744.000	
HYDRO ONE LTD	8,400	20.570	172,788.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	60.940	332,732.400	
WSP GLOBAL INC	2,700	59.460	160,542.000	
EMERA INC	1,300	43.900	57,070.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,300	31.240	103,092.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,500	70.180	666,710.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	6,400	52.880	338,432.000	
STARS GROUP INC/THE	5,000	21.910	109,550.000	
KINROSS GOLD CORP	34,100	4.020	137,082.000	
BANK OF MONTREAL	17,100	89.010	1,522,071.000	
POWER CORP OF CANADA	9,400	24.000	225,600.000	

METHANEX CORP	2,200	65.970	145,134.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	2,300	173.800	399,740.000	
NUTRIEN LTD	16,519	61.220	1,011,293.180	
AURORA CANNABIS INC	17,500	7.410	129,675.000	
CANOPY GROWTH CORP	5,500	39.290	216,095.000	
CAMECO CORP	10,600	15.300	162,180.000	
TELUS CORP	5,400	45.970	248,238.000	
POWER FINANCIAL CORP	6,200	25.560	158,472.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	14,000	29.040	406,560.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,600	142.290	227,664.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	24,800	2.160	53,568.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	32,800	33.150	1,087,320.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	800	574.870	459,896.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,700	59.420	516,954.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,037	92.770	188,972.490	
BLACKBERRY LTD	13,500	10.000	135,000.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	16,550	43.830	725,386.500	
ENBRIDGE INC	48,800	41.920	2,045,696.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	22,850	54.120	1,236,642.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	52,900	19.180	1,014,622.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	8,700	28.920	251,604.000	
GOLDCORP INC	23,359	12.610	294,556.990	
ENCANA CORP	25,800	7.690	198,402.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,800	242.160	920,208.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,900	42.640	123,656.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,600	42.180	236,208.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	19,750	101.000	1,994,750.000	
CGI GROUP INC - CLASS A	6,900	82.980	572,562.000	
HUSKY ENERGY INC	9,358	14.750	138,030.500	
ONEX CORPORATION	2,200	74.700	164,340.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	12,500	24.590	307,375.000	
FINNING INTERNATIONAL INC	4,400	24.070	105,908.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	47.050	211,725.000	
IGM FINANCIAL INC	1,900	31.220	59,318.000	
OPEN TEXT CORP	7,000	42.930	300,510.000	

	CI FINANCIAL CORP	7,000	17.360	121,520.000	
	SAPUTO INC	6,300	40.430	254,709.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,700	10.970	194,169.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	11,600	66.350	769,660.000	
	FORTIS INC	11,700	46.450	543,465.000	
	LUNDIN MINING CORP	16,100	5.790	93,219.000	
	CENOVUS ENERGY INC	27,200	9.850	267,920.000	
	DOLLARAMA INC	8,300	31.730	263,359.000	
	ATCO LTD -CLASS I	1,700	39.050	66,385.000	
	ALTAGAS LTD	6,900	14.130	97,497.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,800	19.480	93,504.000	
	KEYERA CORP	5,300	27.760	147,128.000	
	INTER PIPELINE LTD	10,400	19.800	205,920.000	
	ARC RESOURCES LTD	9,700	8.290	80,413.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 43,285,477.110 (3,638,577,205)	
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	35,900	24.920	894,628.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	48,900	23.940	1,170,666.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	13,670	9.450	129,181.500	
	KEPPEL CORP LTD	39,500	6.100	240,950.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	6.160	86,240.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,400	8.290	86,216.000	
	CAPITALAND LTD	68,900	3.150	217,035.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	56,800	1.210	68,728.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	2.430	99,630.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	35.790	96,633.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	86,100	11.340	976,374.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	153,000	1.000	153,000.000	
	VENTURE CORP LTD	7,200	14.530	104,616.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	220,950	3.060	676,107.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	39,500	3.520	139,040.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	28,800	2.620	75,456.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.260	42,744.000	

	SATS LTD	16,000	4.630	74,080.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,800	7.240	150,592.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	55,300	2.140	118,342.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	49,200	3.170	155,964.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 5,756,222.500 (473,103,928)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFY AG-REG	850	93.240	79,254.000	
	UBS GROUP AG-REG	102,250	12.325	1,260,231.250	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	230	460.800	105,984.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,250	44.800	190,400.000	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	18,870	248.200	4,683,534.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	950	69.000	65,550.000	
	SIKA AG-REG	3,590	122.400	439,416.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	77,500.000	232,500.000	
	ABB LTD-REG	48,700	19.245	937,231.500	
	SWISS RE AG	8,400	88.660	744,744.000	
	NESTLE SA-REG	82,000	82.880	6,796,160.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	480	618.000	296,640.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,050	196.500	206,325.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	69,770	11.080	773,051.600	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,900	36.440	214,996.000	
	SGS SA-REG	140	2,296.000	321,440.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	580	190.000	110,200.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,200	113.150	135,780.000	
	TEMENOS AG - REG	1,700	120.300	204,510.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	850	282.800	240,380.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,022	291.400	1,172,010.800	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,300	138.300	179,790.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	17.875	101,887.500	
	NOVARTIS AG-REG	57,400	85.780	4,923,772.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	60	1,586.000	95,160.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT- REG	13,960	62.580	873,616.800	
	SWISSCOM AG-REG	710	477.700	339,167.000	
	GEBERIT AG-REG	990	374.400	370,656.000	
	GIVAUDAN-REG	250	2,338.000	584,500.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	270	628.500	169,695.000	

	SONOVA HOLDING AG-REG	1,540	160.150	246,631.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,010	293.300	589,533.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	55.750	84,740.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	12,790	41.460	530,273.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	900	377.900	340,110.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,490	129.050	192,284.500	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,030	81.250	164,937.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	29	6,520.000	189,080.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 29,186,171.850 (3,315,549,122)	
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	321.100	610,090.000	
	ERICSSON LM-B SHS	81,130	81.260	6,592,623.800	
	VOLVO AB-B SHS	42,100	116.600	4,908,860.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,800	564.500	1,016,100.000	
	SKF AB-B SHARES	9,750	132.900	1,295,775.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,650	190.000	1,263,500.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,600	360.800	1,659,680.000	
	TELE2 AB-B SHS	13,700	111.900	1,533,030.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	43,050	88.020	3,789,261.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	41,050	102.550	4,209,677.500	
	SWEDBANK AB - A SHARES	24,800	203.000	5,034,400.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	23,550	142.800	3,362,940.000	
	SKANSKA AB-B SHS	9,150	143.150	1,309,822.500	
	SANDVIK AB	29,850	127.300	3,799,905.000	
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	383.200	4,713,360.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	18,550	209.750	3,890,862.500	
	SECURITAS AB-B SHS	8,450	143.950	1,216,377.500	
	TELIA CO AB	77,000	43.470	3,347,190.000	
	ALFA LAVAL AB	7,700	193.650	1,491,105.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	10,300	195.480	2,013,444.000	
	ASSA ABLOY AB-B	26,850	160.250	4,302,712.500	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,800	266.000	478,800.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	4,650	227.400	1,057,410.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	15,700	224.200	3,519,940.000	
	BOLIDEN AB	7,000	199.700	1,397,900.000	

	EPIROC AB-A	17,950	76.670	1,376,226.500	
	EPIROC AB-B	9,700	74.600	723,620.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,450	68.340	782,493.000	
	NORDEA BANK ABP	82,800	78.490	6,498,972.000	
	KINNEVIK AB - B	6,500	212.500	1,381,250.000	
	HEXAGON AB-B SHS	6,900	413.700	2,854,530.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,600	181.150	833,290.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クロー ナ 82,265,147.800 (1,024,201,090)	
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	49,000	305.000	14,945,000.000	
	DANSKE BANK A/S	18,800	135.400	2,545,520.000	
	ISS A/S	4,400	192.700	847,880.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	8,165.000	775,675.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	289.400	491,980.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,250	521.400	2,737,350.000	
	CARLSBERG AS-B	2,950	711.800	2,099,810.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,800	295.100	1,711,580.000	
	COLOPLAST-B	3,100	628.000	1,946,800.000	
	DSV A/S	5,010	482.400	2,416,824.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,675	196.000	524,300.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	170	8,700.000	1,479,000.000	
	TRYG A/S	3,300	165.300	545,490.000	
	PANDORA A/S	2,750	286.500	787,875.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,700	595.200	1,607,040.000	
	GENMAB A/S	1,700	1,067.000	1,813,900.000	
	ORSTED A/S	5,050	450.000	2,272,500.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 39,548,524.000 (677,861,702)	
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	34,500	3.425	118,162.500	
	A2 MILK CO LTD	19,000	10.950	208,050.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	4.200	221,293.800	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	6.945	162,513.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	4.830	97,083.000	

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	15,100	12.400	187,240.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,800	11.000	96,800.000	
ニュージーランド・ドル 小計					ニュージーランド・ドル 1,091,142.300 (84,017,957)
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	35,200	39.810	1,401,312.000	
	DNB ASA	26,150	143.550	3,753,832.500	
	ORKLA ASA	20,850	70.460	1,469,091.000	
	TELENOR ASA	19,900	170.400	3,390,960.000	
	EQUINOR ASA	31,223	190.350	5,943,298.050	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,560	337.400	1,538,544.000	
	MARINE HARVEST	11,050	187.350	2,070,217.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,850	133.000	645,050.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,400	266.500	639,600.000	
	AKER BP ASA	2,900	228.600	662,940.000	
ノルウェー・クローネ 小計					ノルウェー・クローネ 21,514,845.050 (280,553,580)
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	24,670	64.000	1,578,880.000	
	EVONIK INDUSTRIES AG	4,250	21.700	92,225.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	53,150	7.660	407,129.000	
	COMMERZBANK AG	26,335	6.359	167,464.260	
	VOLKSWAGEN AG	890	146.000	129,940.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	4,970	146.480	728,005.600	
	SIEMENS AG-REG	20,650	99.580	2,056,327.000	
	E.ON SE	59,100	8.970	530,127.000	
	UNIPER SE	5,350	22.300	119,305.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,050	74.000	669,700.000	
	GEA GROUP AG	4,500	21.370	96,165.000	
	OSRAM LICHT AG	2,560	38.020	97,331.200	
	CONTINENTAL AG	2,970	122.800	364,716.000	
	BASF SE	24,420	59.240	1,446,640.800	
	ALLIANZ SE-REG	11,630	175.280	2,038,506.400	
	THYSSENKRUPP AG	11,450	15.615	178,791.750	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,900	96.720	473,928.000	

RWE AG	14,150	19.350	273,802.500	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,100	18.905	115,320.500	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	63.280	74,670.400	
BRENNTAG AG	4,300	37.460	161,078.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	11,250	42.000	472,500.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	37.520	124,566.400	
HOCHTIEF AG	530	116.000	61,480.000	
SAP SE	26,142	88.660	2,317,749.720	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,980	187.200	745,056.000	
ZALANDO SE	2,900	22.560	65,424.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,900	53.920	210,288.000	
KION GROUP AG	1,850	43.410	80,308.500	
WIRECARD AG	3,070	134.600	413,222.000	
COVESTRO AG	5,200	42.910	223,132.000	
INNOGY SE	3,730	40.600	151,438.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	950	116.300	110,485.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	4,000	55.960	223,840.000	
DELIVERY HERO SE	2,500	29.900	74,750.000	
METRO AG	5,000	11.945	59,725.000	
1&1 DRILLISCH AG	1,300	44.420	57,746.000	
AROUNDTOWN SA	22,200	7.420	164,724.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,000	36.865	147,460.000	
BEIERSDORF AG	2,690	92.480	248,771.200	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,950	34.060	66,417.000	
MERCK KGAA	3,450	96.200	331,890.000	
ADIDAS AG	5,110	186.850	954,803.500	
PUMA SE	236	424.500	100,182.000	
HENKEL AG & CO KGAA	2,850	86.050	245,242.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	90,300	15.215	1,373,914.500	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,870	59.500	349,265.000	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	24,650	47.420	1,168,903.000	
QIAGEN N.V.	5,998	30.290	181,679.420	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	30,050	17.595	528,729.750	
HANNOVER RUECK SE	1,610	117.000	188,370.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	26,350	24.840	654,534.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,100	104.700	533,970.000	

PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	5,950	15.715	93,504.250	
LANXESS AG	2,200	40.980	90,156.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,430	167.600	239,668.000	
AXEL SPRINGER SE	1,200	49.560	59,472.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	9,400	41.210	387,374.000	
SYMRISE AG	3,200	65.860	210,752.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	18,800	3.550	66,740.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,550	64.950	100,672.500	
HUGO BOSS AG -ORD	1,760	54.880	96,588.800	
RTL GROUP	1,000	47.260	47,260.000	
VONOVIA SE	13,200	41.150	543,180.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	25,826	31.685	818,296.810	
NN GROUP NV	8,050	34.540	278,047.000	
ARCELORMITTAL	17,700	19.424	343,804.800	
UNILEVER NV-CVA	41,100	48.495	1,993,144.500	
HEINEKEN NV	7,100	79.000	560,900.000	
AEGON NV	48,644	4.192	203,915.640	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	33,483	22.390	749,684.370	
AKZO NOBEL	6,600	68.820	454,212.000	
KONINKLIJKE DSM NV	4,750	73.160	347,510.000	
WOLTERS KLUWER	7,800	52.720	411,216.000	
ING GROEP NV	103,450	9.912	1,025,396.400	
KONINKLIJKE KPN NV	91,950	2.620	240,909.000	
ASML HOLDING NV	10,900	144.480	1,574,832.000	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	11,050	21.170	233,928.500	
VOPAK	1,900	41.440	78,736.000	
RANDSTAD NV	3,200	39.120	125,184.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,150	75.150	236,722.500	
JCDECAUX SA	1,900	26.340	50,046.000	
TOTAL SA	63,650	48.615	3,094,344.750	
MICHELIN (CGDE)	4,500	85.860	386,370.000	
AIR LIQUIDE SA	11,592	106.350	1,232,809.200	
KERING	2,060	403.100	830,386.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	14,950	60.360	902,382.000	
BOUYGUES SA	6,050	32.500	196,625.000	
BNP PARIBAS	29,900	40.580	1,213,342.000	

PEUGEOT SA	15,450	18.100	279,645.000	
NATIXIS	25,350	4.433	112,376.550	
THALES SA	2,850	102.800	292,980.000	
DANONE	16,700	63.230	1,055,941.000	
CARREFOUR SA	15,800	14.610	230,838.000	
SUEZ	9,925	12.015	119,248.870	
VIVENDI	27,991	21.030	588,650.730	
L'OREAL	6,730	203.300	1,368,209.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	13,700	29.000	397,300.000	
LEGRAND SA	7,217	49.330	356,014.610	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	36.060	55,893.000	
PERNOD RICARD SA	5,617	146.650	823,733.050	
SOCIETE BIC SA	700	90.050	63,035.000	
EURAZEO SE	1,195	62.000	74,090.000	
REXEL SA	7,850	9.746	76,506.100	
SOCIETE GENERALE SA	20,900	29.025	606,622.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,350	250.100	1,838,235.000	
ACCOR SA	4,950	37.920	187,704.000	
CAPGEMINI SE	4,220	92.020	388,324.400	
VALEO SA	6,400	24.070	154,048.000	
PUBLICIS GROUPE	5,600	50.100	280,560.000	
BUREAU VERITAS SA	7,100	18.275	129,752.500	
EIFFAGE	2,140	72.260	154,636.400	
SODEXO SA	2,500	90.260	225,650.000	
IPSEN	1,000	119.200	119,200.000	
INGENICO GROUP	1,600	53.140	85,024.000	
AMUNDI SA	1,500	46.520	69,780.000	
TELEPERFORMANCE	1,500	140.700	211,050.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,200	68.880	151,536.000	
FAURECIA	1,900	30.610	58,159.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	320	324.000	103,680.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	800	89.400	71,520.000	
SEB SA	560	113.200	63,392.000	
ESSILORLUXOTTICA	7,800	109.500	854,100.000	
DASSAULT AVIATION SA	70	1,248.000	87,360.000	
AXA SA	51,800	19.020	985,236.000	
EDENRED	6,400	31.860	203,904.000	
RENAULT SA	5,350	54.660	292,431.000	

HERMES INTERNATIONAL	860	476.800	410,048.000	
STMICROELECTRONICS NV	18,550	12.095	224,362.250	
REMY COINTREAU	550	101.700	55,935.000	
ATOS SE	2,500	67.980	169,950.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,580	102.700	367,666.000	
WENDEL	780	101.300	79,014.000	
ORANGE	53,650	14.435	774,437.750	
ALSTOM	4,050	38.300	155,115.000	
CNP ASSURANCES	4,300	19.210	82,603.000	
SANOFI	30,375	77.420	2,351,632.500	
VINCI SA	13,450	72.360	973,242.000	
AIRBUS SE	15,450	87.650	1,354,192.500	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	14,450	18.560	268,192.000	
CREDIT AGRICOLE SA	30,100	9.911	298,321.100	
BIOMERIEUX	1,150	59.400	68,310.000	
ENGIE	49,973	12.865	642,902.640	
IMERYS SA	900	41.500	37,350.000	
EDF	15,950	14.200	226,490.000	
SES	9,700	17.320	168,004.000	
SAFRAN SA	9,050	107.600	973,780.000	
ILIAD SA	740	126.650	93,721.000	
ARKEMA	1,770	75.160	133,033.200	
ADP	810	165.900	134,379.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,700	18.515	87,020.500	
SCOR SE	4,500	38.780	174,510.000	
GETLINK SE	12,400	11.380	141,112.000	
BOLLORE	24,100	3.610	87,001.000	
UCB SA	3,250	74.240	241,280.000	
KBC GROUP NV	6,900	58.940	406,686.000	
COLRUYT SA	1,600	62.080	99,328.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,200	75.540	166,188.000	
SOLVAY SA	1,950	87.280	170,196.000	
UMICORE	5,400	34.860	188,244.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	20,350	61.070	1,242,774.500	
AGEAS	4,940	39.340	194,339.600	
PROXIMUS	4,100	23.310	95,571.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	42.100	61,045.000	
PRYSMIAN SPA	6,150	16.550	101,782.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	31,343	14.315	448,675.040	

MEDIOBANCA SPA	15,265	7.504	114,548.560	
TENARIS SA	12,000	9.868	118,416.000	
UNICREDIT SPA	54,956	10.548	579,675.880	
TELECOM ITALIA SPA	313,982	0.558	175,264.750	
TELECOM ITALIA-RSP	146,950	0.477	70,153.930	
INTESA SANPAOLO	396,237	1.973	781,775.600	
ATLANTIA SPA	13,457	17.985	242,024.140	
POSTE ITALIANE SPA	13,500	6.896	93,096.000	
MONCLER SPA	4,700	27.020	126,994.000	
RECORDATI SPA	2,600	28.700	74,620.000	
ENI SPA	68,200	13.960	952,072.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	14,300	7.580	108,394.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	5.726	62,986.000	
LEONARDO SPA	10,975	8.020	88,019.500	
ENEL SPA	220,934	5.014	1,107,763.070	
SNAM SPA	61,600	4.015	247,324.000	
TERNA SPA	38,900	5.148	200,257.200	
EXOR NV	2,880	48.970	141,033.600	
CNH INDUSTRIAL NV	27,200	8.312	226,086.400	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	28,550	13.770	393,133.500	
FERRARI NV	3,345	89.300	298,708.500	
TELEFONICA SA	125,027	7.827	978,586.320	
ENDESA SA	8,250	21.110	174,157.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	181,612	4.706	854,666.070	
IBERDROLA SA	162,134	7.098	1,150,827.130	
BANCO DE SABADELL SA	144,909	1.068	154,835.260	
BANKINTER SA	18,300	7.300	133,590.000	
REPSOL SA	36,650	14.710	539,121.500	
GRIFOLS SA	7,750	23.480	181,970.000	
BANCO SANTANDER SA	439,650	4.027	1,770,470.550	
AMADEUS IT GROUP SA	11,700	61.680	721,656.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,050	23.290	210,774.500	
MAPFRE SA	25,450	2.393	60,901.850	
CAIXABANK SA	94,100	3.357	315,893.700	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE- DI	15,200	6.662	101,262.400	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,726	33.050	222,294.300	

AENA SME SA	1,850	138.450	256,132.500	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	29,750	23.600	702,100.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	5,600	12.800	71,680.000	
ENAGAS SA	5,900	25.020	147,618.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	11,500	20.260	232,990.000	
FERROVIAL SA	13,400	18.045	241,803.000	
BANKIA SA	30,105	2.750	82,788.750	
UPM-KYMMENE OYJ	14,850	22.530	334,570.500	
NOKIA OYJ	154,000	5.216	803,264.000	
WARTSILA OYJ ABP	12,000	14.035	168,420.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	13,800	10.375	143,175.000	
METSO OYJ	2,800	22.970	64,316.000	
ELISA OYJ	3,650	37.350	136,327.500	
SAMPO OYJ-A SHS	11,650	38.870	452,835.500	
FORTUM OYJ	12,250	20.130	246,592.500	
KONE OYJ-B	8,800	41.930	368,984.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,050	27.000	82,350.000	
NESTE OYJ	3,450	70.600	243,570.000	
ORION OYJ-CLASS B	2,750	30.330	83,407.500	
VERBUND AG	2,000	39.640	79,280.000	
OMV AG	3,550	40.980	145,479.000	
ERSTE GROUP BANK AG	8,300	31.890	264,687.000	
VOESTALPINE AG	2,850	26.320	75,012.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	23.880	81,192.000	
ANDRITZ AG	2,100	38.880	81,648.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,000	22.280	133,680.000	
AIB GROUP PLC	23,000	3.516	80,868.000	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	27,460	4.952	135,981.920	
KINGSPAN GROUP PLC	4,400	36.420	160,248.000	
JERONIMO MARTINS	6,000	10.135	60,810.000	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	66,000	3.027	199,782.000	
GALP ENERGIA SGPS SA	11,650	14.070	163,915.500	
KERRY GROUP PLC-A	4,220	91.500	386,130.000	
CRH PLC	22,700	22.500	510,750.000	
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,200	72.100	158,620.000	
ユーロ 小計			ユーロ	

				92,467,893.590 (11,833,116,342)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	37,500	54.900	2,058,750.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	50.200	3,263,000.000	
	MTR CORP	40,000	41.200	1,648,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	44,000	113.900	5,011,600.000	
	SINO LAND CO	90,000	14.000	1,260,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	73,669	79.650	5,867,735.850	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	20.000	640,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	13,500	84.400	1,139,400.000	
	CLP HOLDINGS LTD	43,500	89.550	3,895,425.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	35,916	39.700	1,425,865.200	
	HANG LUNG GROUP LTD	21,000	21.350	448,350.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	248,181	16.160	4,010,604.960	
	HANG SENG BANK LTD	20,400	177.800	3,627,120.000	
	WHEELOCK & CO LTD	22,000	45.150	993,300.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	159,000	10.820	1,720,380.000	
	WH GROUP LTD	241,500	6.020	1,453,830.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	31,300	231.200	7,236,560.000	
	MINTH GROUP LTD	18,000	26.200	471,600.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	50,000	15.640	782,000.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	7,600	77.000	585,200.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	19,000	23.300	442,700.000	
	NWS HOLDINGS LTD	42,500	17.080	725,900.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	17,500	28.450	497,875.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	32,640	25.300	825,792.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	17,000	38.250	650,250.000	
	SJM HOLDINGS LTD	47,000	7.310	343,570.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	32,600	28.150	917,690.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	69,669	57.500	4,005,967.500	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	18,000	59.650	1,073,700.000	
	PCCW LTD	117,000	4.650	544,050.000	
	AIA GROUP LTD	321,200	63.750	20,476,500.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	33,000	48.600	1,603,800.000	
	SANDS CHINA LTD	64,400	34.800	2,241,120.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	10.940	328,200.000	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	35,500	41.550	1,475,025.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	23,600	13.640	321,904.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	102,000	29.850	3,044,700.000	
	WYNN MACAU LTD	42,000	18.260	766,920.000	
香港・ドル	小計			香港・ドル 87,824,384.510 (1,267,305,867)	
合計				96,598,974,693 [96,598,974,693]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,617	650,589.790	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	8,137	1,423,812.260	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,000	480,200.000	
		VORNADO REALTY TRUST	4,647	305,772.600	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,050	502,060.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	9,800	663,852.000	
		EQUINIX INC	2,088	770,597.280	
		AMERICAN TOWER CORP	11,450	1,842,763.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	20,043	347,144.760	
		KIMCO REALTY CORP	11,100	171,939.000	
		INVITATION HOMES INC	8,300	172,225.000	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,279	98,894.250	
		VENTAS INC	9,600	584,352.000	
		WEYERHAEUSER CO	20,064	473,510.400	
		AGNC INVESTMENT CORP	14,100	249,006.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	10,900	1,208,919.000	
		IRON MOUNTAIN INC	7,410	247,271.700	
		VEREIT INC	24,400	183,976.000	
		PROLOGIS INC	16,412	1,009,666.240	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,720	323,000.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,350	208,374.500	
		DUKE REALTY CORP	9,400	252,296.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,700	432,259.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,000	252,980.000	

	WELLTOWER INC	9,700	685,984.000	
	HCP INC	12,400	346,952.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,950	176,288.500	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,000	291,300.000	
	MACERICH CO/THE	2,900	129,920.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	33,600	334,656.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,150	202,644.500	
	REALTY INCOME CORP	7,550	484,030.500	
	PUBLIC STORAGE	4,150	828,215.500	
	REGENCY CENTERS CORP	4,050	235,872.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,400	206,784.000	
	UDR INC	6,800	276,896.000	
	WP CAREY INC	4,300	294,550.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	5,500	591,305.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,250	302,900.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 18,243,759.280 (2,057,713,609)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	19,662	162,722.710	
	SEGRO PLC	27,650	164,517.500	
	HAMMERSON PLC	22,200	75,924.000	
	BRITISH LAND CO PLC	25,550	139,043.100	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 542,207.310 (77,145,256)	
オーストラリア・ドル	LENDLEASE GROUP	14,900	173,585.000	
	TRANSURBAN GROUP	71,500	855,140.000	
	SYDNEY AIRPORT	30,300	213,009.000	
	APA GROUP	31,200	274,872.000	
	SCENTRE GROUP	143,322	573,288.000	
	DEXUS	28,050	315,843.000	
	GPT GROUP	47,560	268,238.400	
	MIRVAC GROUP	98,800	229,216.000	
	STOCKLAND	66,000	244,200.000	
	GOODMAN GROUP	43,900	486,851.000	
	VICINITY CENTRES	89,273	239,251.640	

オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 3,873,494.040 (313,791,752)
カナダ・ドル	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,500	カナダ・ドル 46,860.000
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,700	77,182.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,900	93,912.000
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 217,954.000 (18,321,214)
シンガポール・ドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	70,100	シンガポール・ドル 125,479.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	69,500	182,090.000
	CAPITALAND MALL TRUST	63,200	145,360.000
	SUNTEC REIT	63,000	114,660.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 567,589.000 (46,650,139)
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,780	ユーロ 538,876.800
	ICADE	950	62,320.000
	GECINA SA	1,250	151,125.000
	KLEPIERRE	5,650	160,064.500
	COVIVIO	970	82,741.000
ユーロ 小計			ユーロ 995,127.300 (127,346,441)
香港・ドル	LINK REIT	57,000	香港・ドル 4,511,550.000
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	64,500	501,165.000
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	99,000	1,186,020.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 6,198,735.000 (89,447,747)
投資証券 合計			2,730,416,158 [2,730,416,158]
合計			2,730,416,158 [2,730,416,158]

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 596銘柄 投資証券 39銘柄	96.9%	3.1%	67.6%
イギリス・ポンド	株式 94銘柄 投資証券 4銘柄	98.8%	1.2%	6.6%
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄 投資証券 11銘柄	88.3%	11.7%	2.7%
カナダ・ドル	株式 88銘柄 投資証券 3銘柄	99.5%	0.5%	3.7%
シンガポール・ドル	株式 21銘柄 投資証券 4銘柄	91.0%	9.0%	0.5%
スイス・フラン	株式 38銘柄	100%	-%	3.3%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	100%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	100%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式 7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 237銘柄 投資証券 5銘柄	98.9%	1.1%	12.0%
香港・ドル	株式 38銘柄 投資証券 3銘柄	93.4%	6.6%	1.4%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
--	---------------	---------------

	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	586,413,834
コール・ローン	1,059,519,229	2,456,291,131
投資証券	217,100,972,800	218,552,442,750
派生商品評価勘定	25,700,200	13,305,600
未収入金	1,607,086,927	-
未収配当金	1,163,416,707	1,086,606,834
流動資産合計	220,956,695,863	222,695,060,149
資産合計	220,956,695,863	222,695,060,149
負債の部		
流動負債		
前受金	33,300,000	39,600,000
未払金	189,094,400	-
未払解約金	23,048,500	28,367,900
その他未払費用	-	12,811
流動負債合計	245,442,900	67,980,711
負債合計	245,442,900	67,980,711
純資産の部		
元本等		
元本	93,103,935,587	83,618,179,092
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	127,607,317,376	139,008,900,346
元本等合計	220,711,252,963	222,627,079,438
純資産合計	220,711,252,963	222,627,079,438
負債純資産合計	220,956,695,863	222,695,060,149

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

	<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。</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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	105,872,694,601円	93,103,935,587円
期中追加設定元本額	15,004,810,266円	7,997,501,780円
期中一部解約元本額	27,773,569,280円	17,483,258,275円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	9,847,773,031円	7,302,744,511円
ダイワJ-REITオープン （毎月分配型）	76,300,634,662円	68,216,833,743円
ダイワJ-REITオープン （年1回決算型）	394,808,043円	373,979,635円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	27,123円	28,858円
iFree J-REITイ ンデックス	124,681,806円	126,035,282円
iFree 8資産バランス	302,411,577円	515,506,552円
DC・ダイワJ-REIT オープン	3,533,542,169円	3,890,262,175円

	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,354,287円	2,733,692円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,785,265円	5,348,275円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,256,105円	1,385,927円
	ダイワ・ノーロード J - R EITファンド	55,539,603円	46,340,607円
	ダイワファンドラップ J - REITインデックス	777,631,926円	1,007,319,809円
	ダイワ J - REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	1,417,548円	389,109,116円
	ダイワファンドラップオンラ イン J - REITインデッ クス	245,822,040円	382,869,897円
	ダイワ・インデックスセレク ト J - REIT	1,509,250,402円	1,357,681,013円
	計	93,103,935,587円	83,618,179,092円
2.	期末日における受益権の総数	93,103,935,587口	83,618,179,092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 332,400,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 414,600,000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29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、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30年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

投資証券	452,415,989	5,723,692,910
合計	452,415,989	5,723,692,910

(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29年9月16日から平成29年12月18日まで、及び平成30年9月19日から平成30年12月18日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	平成29年12月18日 現在				平成30年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	3,028,450,000	-	3,054,350,000	25,900,000	3,189,600,000	-	3,203,100,000	13,500,000
合計	3,028,450,000	-	3,054,350,000	25,900,000	3,189,600,000	-	3,203,100,000	13,500,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.3706円	2.6624円
(1万口当たり純資産額)	(23,706円)	(26,624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	8,253	4,464,873,000	
	MCUBS MidCity投資法人	27,988	2,586,091,200	
	森ヒルズリート	28,484	3,945,034,000	
	産業ファンド	28,936	3,252,406,400	
	アドバンス・レジデンス	24,205	7,479,345,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	14,734	2,482,679,000	
	API投資法人	11,901	5,498,262,000	
	GLP投資法人	61,543	6,972,821,900	
	コンフォリア・レジデンシャル	9,472	2,749,721,600	
	日本プロロジスリート	33,314	7,852,109,800	
	星野リゾート・リート	3,779	1,987,754,000	
	ONEリート投資法人	3,620	953,508,000	
	イオンリート投資	25,494	3,235,188,600	
	ヒューリックリート投資法	20,077	3,431,159,300	
	日本リート投資法人	8,017	3,066,502,500	
	インベスコ・オフィス・Jリート	147,224	2,385,028,800	
	日本ヘルスケア投資法	1,137	188,855,700	
	積水ハウス・リート投資	64,080	4,479,192,000	
	トーセイ・リート投資法人	4,781	524,953,800	
	ケネディクス商業リート	9,103	2,268,467,600	
	ヘルスケア&メディカル投資	3,289	373,630,400	
	サムティ・レジデンシャル	4,971	440,927,700	
	野村不動産マスターF	73,614	10,688,752,800	
	いちごホテルリート投資	4,343	585,002,100	
	ラサールロジポート投資	18,737	2,001,111,600	
	スターアジア不動産投	7,710	824,970,000	
	マリモ地方創生リート	2,136	233,678,400	
	三井不ロジパーク	4,240	1,358,920,000	
	大江戸温泉リート	4,009	329,940,700	
	さくら総合リート	5,374	465,925,800	
	投資法人みらい	6,689	1,265,558,800	
	森トラスト・ホテルリート投	5,827	751,683,000	
三菱地所物流REIT	2,628	643,334,400		
CREロジスティクスファンド	2,487	260,886,300		
ザイマックス・リート	2,290	259,915,000		

タカラレーベン不動産投	3,717	328,211,100	
伊藤忠アドバンスロジ	3,842	326,954,200	
日本ビルファンド	24,051	16,619,241,000	
ジャパンリアルエステイト	24,836	15,497,664,000	
日本リテールファンド	46,940	10,458,232,000	
オリックス不動産投資	49,486	9,115,321,200	
日本プライムリアルティ	15,722	6,854,792,000	
プレミアム投資法人	23,613	2,937,457,200	
東急リアル・エステート	16,652	2,757,571,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	15,880	1,919,892,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	54,777	9,580,497,300	
森トラスト総合リート	17,750	2,880,825,000	
インヴィンシブル投資法人	86,913	4,210,934,850	
フロンティア不動産投資	8,448	3,772,032,000	
平和不動産リート	15,467	1,860,680,100	
日本ロジスティクスファンド投資法人	16,388	3,728,270,000	
福岡リート投資法人	12,845	2,192,641,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	7,683	5,508,711,000	
いちごオフィスリート投資法人	20,605	1,967,777,500	
大和証券オフィス投資法人	5,732	4,012,400,000	
阪急阪神リート投資法人	11,175	1,630,432,500	
スタートアップリート投資法人	3,913	655,818,800	
大和ハウスリート投資法人	31,095	7,671,136,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	71,913	6,019,118,100	
日本賃貸住宅投資法人	27,935	2,354,920,500	
ジャパンエクセレント投資法人	22,240	3,402,720,000	
投資証券 合計		218,552,442,750	
合計		218,552,442,750	

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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	50,262,799	113,722,457
金銭信託	-	18,580,949
コール・ローン	91,529,565	77,829,373
投資信託受益証券	46,049,379	168,584,393
投資証券	13,832,110,951	18,608,705,787
派生商品評価勘定	471,338	26,626
未収入金	59,471	8,046
未収配当金	33,086,895	38,184,704
差入委託証拠金	13,517,642	51,308,493
流動資産合計	14,067,088,040	19,076,950,828
資産合計	14,067,088,040	19,076,950,828
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,995	6,625,585
未払金	50,712,789	63,681,085
未払解約金	1,061,000	4,748,300
その他未払費用	-	522
流動負債合計	51,782,784	75,055,492
負債合計	51,782,784	75,055,492
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,102,884,330
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,912,420,926
元本等合計		14,015,305,256
純資産合計		14,015,305,256
負債純資産合計		14,067,088,040
		19,076,950,828

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)出資証券</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)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)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。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
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、出資証券、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	2,861,359,942円	6,102,884,330円
期中追加設定元本額	3,616,858,632円	3,189,233,518円
期中一部解約元本額	375,334,244円	686,558,741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)	3,150,065,335円	4,250,708,821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)	405,524,115円	607,517,253円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	204,326,703円	332,616,245円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	142,134,165円	243,780,173円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,191,277円	1,218,823円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	28,535円	33,252円
iFree 外国REITイ ンデックス	62,916,833円	76,699,942円
iFree 8資産バランス	313,141,173円	595,418,401円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	1,502,563,697円	1,752,831,763円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,481,750円	3,180,473円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,017,065円	6,164,552円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,160,118円	1,416,414円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	279,188,081円	258,789,793円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	22,068,351円	26,738,838円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)(ダ イワSMA専用)	4,515,104円	227,933,210円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)(ダ イワSMA専用)	4,562,028円	220,511,154円
計	6,102,884,330円	8,605,559,107円
2. 期末日における受益権の総数	6,102,884,330口	8,605,559,107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29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	443,823	10,094,705
投資証券	170,662,826	696,492,363
合計	171,106,649	706,587,068

（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29年12月1日から平成29年12月18日まで、及び平成30年12月1日から平成30年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	平成29年12月18日 現在				平成30年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	58,109,738	-	58,581,076	471,338	130,736,956	-	124,243,076	6,493,880
合計	58,109,738	-	58,581,076	471,338	130,736,956	-	124,243,076	6,493,880

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	平成29年12月18日 現在				平成30年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	32,401,000	-	32,400,000	1,000
オーストラリア ・ドル	-	-	-	-	32,401,000	-	32,400,000	1,000
買 建	68,504,245	-	68,495,250	8,995	95,441,079	-	95,335,000	106,079
アメリカ・ドル	50,738,625	-	50,733,000	5,625	73,289,079	-	73,179,000	110,079
オーストラリア ・ドル	7,323,812	-	7,323,600	212	8,080,600	-	8,082,000	1,400
カナダ・ドル	-	-	-	-	5,871,600	-	5,873,000	1,400
シンガポール ・ドル	10,441,808	-	10,438,650	3,158	8,199,800	-	8,201,000	1,200
合計	68,504,245	-	68,495,250	8,995	127,842,079	-	127,735,000	105,079

(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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2965円 (22,965円)	2.2081円 (22,081円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	19,500.000	1,494,675.000	
		アメリカ・ドル 小計		1,494,675.000 (168,584,393)	
投資信託受益証券 合計				168,584,393 [168,584,393]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21,000	677,880.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	10,100	46,359.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	16,782	296,537.940	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,500	313,335.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,300	3,831,231.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	47,747	8,354,770.060	
		BOSTON PROPERTIES INC	23,800	2,857,190.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,055	1,085,602.150	
		VORNADO REALTY TRUST	26,664	1,754,491.200	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	8,600	145,340.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,300	227,586.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,100	104,005.000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	7,800	293,670.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	56,900	3,854,406.000	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	33,300	503,496.000			

EPR PROPERTIES	11,300	768,061.000	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	34,020.000	
CITY OFFICE REIT INC	5,300	57,558.000	
GLOBAL NET LEASE INC	11,533	213,014.510	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	9,829	260,861.660	
CHATHAM LODGING TRUST	6,300	115,920.000	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	9,200	243,984.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,100	143,869.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,900	536,963.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	17,200	288,960.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,300	66,746.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	39,608.190	
HOST HOTELS & RESORTS INC	114,000	1,974,480.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	39,108	786,070.800	
CORESITE REALTY CORP	5,600	511,112.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	23,900	693,578.000	
RLJ LODGING TRUST	26,671	479,544.580	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	14,848.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	27,200	449,344.000	
CYRUSONE INC	15,900	894,693.000	
KIMCO REALTY CORP	64,400	997,556.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,800	16,128.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	31,550	831,027.000	
WHITESTONE REIT	5,800	75,574.000	
TIER REIT INC	8,100	170,181.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,000	20,310.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30,600	1,028,160.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,700	341,401.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	30,700	848,241.000	
COLONY CAPITAL INC	75,311	382,579.880	
INVITATION HOMES INC	45,397	941,987.750	
JBG SMITH PROPERTIES	16,532	601,434.160	
CLIPPER REALTY INC	1,400	17,430.000	
GLADSTONE LAND CORP	900	10,872.000	
INFRAREIT INC	5,600	118,328.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	8,500	223,975.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2,500	48,150.000	
VICI PROPERTIES INC	54,800	1,081,752.000	
SPIRIT MTA REIT	5,870	51,186.400	

RETAIL VALUE INC	1,957	51,684.370	
BRT APARTMENTS CORP	1,300	14,664.000	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7,300	67,598.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,400	70,042.000	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	1,300	24,817.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	26,560	153,251.200	
CORECIVIC INC	18,024	359,038.080	
STORE CAPITAL CORP	27,800	826,494.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15,700	163,437.000	
LIFE STORAGE INC	7,200	706,248.000	
SELECT INCOME REIT	13,300	223,972.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,900	239,658.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	11,882	117,869.440	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	5,300	77,062.000	
PARAMOUNT GROUP INC	31,800	422,940.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	20,200	298,556.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	13,900	424,645.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18,200	353,444.000	
STAG INDUSTRIAL INC	15,900	401,952.000	
VENTAS INC	54,779	3,334,397.730	
CARETRUST REIT INC	12,103	238,671.160	
GEO GROUP INC/THE	18,500	401,450.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	46,100	705,330.000	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	14,400	103,968.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	27,187	489,637.870	
UMH PROPERTIES INC	4,200	51,870.000	
IRON MOUNTAIN INC	44,200	1,474,954.000	
TERRENO REALTY CORP	8,800	323,488.000	
VEREIT INC	147,308	1,110,702.320	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	12,720	475,473.600	
SUN COMMUNITIES INC	13,300	1,380,939.000	
ACADIA REALTY TRUST	12,611	331,038.750	
ALEXANDER'S INC	600	183,468.000	
PROLOGIS INC	97,202	5,979,867.040	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,300	1,935,625.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	26,800	346,792.000	
SAUL CENTERS INC	1,700	85,017.000	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	52,773.500	
MACK-CALI REALTY CORP	13,500	278,370.000	

CAMDEN PROPERTY TRUST	14,300	1,267,981.000	
COUSINS PROPERTIES INC	64,607	523,962.770	
SITE CENTERS CORP	22,278	261,766.500	
DUKE REALTY CORP	55,200	1,481,568.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,500	534,050.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,167	2,585,163.090	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,500	590,070.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,400	1,441,986.000	
GETTY REALTY CORP	4,903	151,943.970	
WELLTOWER INC	57,500	4,066,400.000	
HCP INC	72,200	2,020,156.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,700	626,587.000	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	25,000	628,000.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	19,300	567,613.000	
EQUITY COMMONWEALTH	18,675	564,732.000	
KILROY REALTY CORP	15,400	978,516.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	22,600	1,008,638.000	
LTC PROPERTIES INC	6,000	258,060.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	32,000	267,520.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,528	1,701,968.800	
MACERICH CO/THE	16,300	730,240.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,600	1,330,216.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,500	499,850.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	24,200	1,181,686.000	
REALTY INCOME CORP	44,617	2,860,395.870	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,400	354,732.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	60,114.000	
PUBLIC STORAGE	23,100	4,610,067.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,100	418,717.000	
REGENCY CENTERS CORP	26,120	1,521,228.800	
RPT REALTY	11,700	154,440.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14,300	317,174.000	
SL GREEN REALTY CORP	13,200	1,137,312.000	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	36,200	449,242.000	
TAUBMAN CENTERS INC	9,100	435,253.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,400	87,472.000	
UDR INC	41,200	1,677,664.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,900	121,011.000	
WP CAREY INC	24,900	1,705,650.000	

WASHINGTON REIT	12,000	301,800.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	18,400	497,352.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,300	46,104.000	
AGREE REALTY CORP	5,200	301,600.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	30,950	1,084,178.500	
CUBESMART	28,300	853,811.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	34,126	480,152.820	
DIGITAL REALTY TRUST INC	31,878	3,427,203.780	
CEDAR REALTY TRUST INC	10,800	32,508.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	19,500	1,817,400.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,275	93,262.000	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	16,600	85,158.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	11,950	184,986.000	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	13,400	181,838.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	56,254.000	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	21,000	882,000.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,600	64,008.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31,042	297,382.360	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	6,849	106,844.400	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	55,700	897,327.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,300	110,351.000	
DOUGLAS EMMETT INC	24,600	837,876.000	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	32,900	385,917.000	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	189,527	144,040.520	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 119,355,114.520 (13,462,063,366)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
ASSURA PLC	354,050	189,062.700	
CAPITAL & REGIONAL PLC	59,270	18,818.220	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	86,570	81,375.800	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	97,170	81,234.120	
REGIONAL REIT LTD	46,310	42,558.890	
NEWRIVER REIT PLC	46,330	100,304.450	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	22,490	21,905.260	
LXI REIT PLC	54,038	64,845.600	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54,330	54,221.340	
RDI REIT PLC	205,180	60,938.460	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	116,581	964,824.350	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	60,790	55,926.800	
	SEGRO PLC	156,630	931,948.500	
	HAMMERSON PLC	122,640	419,428.800	
	UNITE GROUP PLC	40,160	328,910.400	
	BRITISH LAND CO PLC	154,220	839,265.240	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	43,551	295,188.670	
	INTU PROPERTIES PLC	130,670	156,934.670	
	DERWENT LONDON PLC	17,130	498,825.600	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	107,560	116,595.040	
	WORKSPACE GROUP PLC	19,360	160,784.800	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	30,810	162,522.750	
	SHAFTESBURY PLC	35,630	304,458.350	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,730	205,383.150	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	107,440	193,284.560	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	76,600	42,359.800	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	224,960	292,448.000	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 6,684,354.320 (951,049,932)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	9,340	イスラエル・シュケル 132,254.400	
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 132,254.400 (3,962,342)	
オーストラリ ア・ドル	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	29,900	オーストラリア・ドル 88,504.000	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	278,284	283,849.680	
	RURAL FUNDS GROUP	50,595	113,332.800	
	VIVA ENERGY REIT	65,550	144,865.500	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	31,254	135,954.900	
	PROPERTYLINK GROUP	65,670	77,818.950	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	136,260	366,539.400	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	39,307	147,794.320	
	NATIONAL STORAGE REIT	91,935	162,724.950	
	INDUSTRIA REIT	11,760	31,516.800	
	GDI PROPERTY GROUP	69,120	91,929.600	
	SCENTRE GROUP	835,070	3,340,280.000	

	ARENA REIT	35,380	86,327.200	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,300	67,308.000	
	BWP TRUST	71,560	263,340.800	
	DEXUS	158,280	1,782,232.800	
	GPT GROUP	279,900	1,578,636.000	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	48,780	226,339.200	
	MIRVAC GROUP	577,800	1,340,496.000	
	STOCKLAND	378,330	1,399,821.000	
	ABACUS PROPERTY GROUP	45,880	152,780.400	
	GOODMAN GROUP	251,370	2,787,693.300	
	VICINITY CENTRES	501,130	1,343,028.400	
	CHARTER HALL GROUP	71,370	538,843.500	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	28,460	83,957.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 16,635,914.500 (1,347,675,434)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,400	96,200.000	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	13,900	167,356.000	
	SLATE RETAIL REIT - U	3,100	35,805.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6,400	102,656.000	
	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2,700	38,232.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	31,875.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	7,200	70,128.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	4,500	42,345.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,200	23,772.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,400	181,050.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	7,000	66,570.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,600	99,408.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	20,500	245,385.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,700	29,427.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,000	95,920.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,300	321,772.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,200	504,560.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,790	161,894.600	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21,866	456,124.760	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,800	573,104.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	123,390.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,200	123,616.000	

	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3,800	93,138.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,500	81,445.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,700	341,033.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 4,106,206.360 (345,167,706)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	139,728	192,824.640	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	81,200	82,824.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	316,700	364,205.000	
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	89,000	120,150.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	242,250	254,362.500	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	434,475	777,710.250	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	396,100	1,037,782.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	419,200	964,160.000	
	SUNTEC REIT	343,800	625,716.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	352,700	462,037.000	
	KEPPEL REIT	283,400	328,744.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	104,960	144,844.800	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	188,600	205,574.000	
	ESR-REIT	294,337	147,168.500	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	112,300	171,819.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	89,300	194,674.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	203,800	138,584.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	87,600	121,764.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	57,300	157,575.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	267,200	52,371.200	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	191,080	368,784.400	
	CACHE LOGISTICS TRUST	145,200	102,366.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	294,300	494,424.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	127,100	77,531.000	
	SPH REIT	89,600	90,496.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	95,000	57,000.000	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	124,400	50,382.000		
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	108,900	86,575.500		
QUE HOSPITALITY TRUST	166,873	112,639.270		
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 7,985,088.060 (656,294,387)	

ニュージーランド ド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	51,480	97,812.000	
	ARGOSY PROPERTY LTD	128,520	151,011.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	225,200	311,902.000	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	44,560	92,462.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	152,500	239,425.000	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	147,000	210,210.000	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 1,102,822.000 (84,917,294)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	24,320	308,864.000	
	HAMBORNER REIT AG	11,980	105,184.400	
	WERELDHAVE NV	5,960	171,052.000	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,430	3,055,060.800	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	6,020	169,764.000	
	NSI NV	2,731	95,038.800	
	VASTNED RETAIL NV	2,450	81,830.000	
	ICADE	6,950	455,920.000	
	ALTAREA	540	93,420.000	
	GECINA SA	8,501	1,027,770.900	
	KLEPIERRE	32,160	911,092.800	
	COVIVIO	8,360	713,108.000	
	MERCIALYS	8,070	104,345.100	
	AEDIFICA	2,798	219,083.400	
	COFINIMMO	3,210	350,853.000	
	BEFIMMO	3,460	177,152.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,310	69,510.000	
	RETAIL ESTATES	1,140	83,334.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,560	300,544.000	
	BENI STABILI SPA	143,400	101,097.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	34,320.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	85,082.400	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	45,393	396,053.920		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	56,800	623,664.000		
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	49,010	68,712.020		
GREEN REIT PLC	100,940	138,287.800		
HIBERNIA REIT PLC	103,100	137,741.600		
ユーロ 小計			ユーロ	

			10,077,885.940 (1,289,667,064)
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	199,000	香港・ドル 1,008,930.000
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	153,000	765,000.000
	FORTUNE REIT	218,000	1,992,520.000
	PROSPERITY REIT	158,000	474,000.000
	LINK REIT	335,500	26,554,825.000
	CHAMPION REIT	302,000	1,630,800.000
	香港・ドル 小計		香港・ドル 32,426,075.000 (467,908,262)
投資証券 合計		18,608,705,787 [18,608,705,787]	
合計		18,777,290,180 [18,777,290,180]	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 1銘柄 投資証券 156銘柄	1.2%	98.8%	72.5%
イギリス・ポンド	投資証券 27銘柄	-%	100%	5.1%
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 25銘柄	-%	100%	7.2%
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券 29銘柄	-%	100%	3.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	100%	6.9%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	2.5%

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。

「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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	16,117,091
コール・ローン	163,546,995	67,509,097
国債証券	12,069,320,560	14,078,326,560
地方債証券	1,129,848,000	1,039,704,300
特殊債券	920,279,300	919,529,500
社債券	1,124,225,300	1,045,422,100
未収利息	49,739,724	51,890,376
前払費用	925,410	1,086,624
流動資産合計	15,457,885,289	17,219,585,648
資産合計	15,457,885,289	17,219,585,648
負債の部		
流動負債		
未払金	82,295,170	-
未払解約金	3,237,000	356,000
その他未払費用	-	519
流動負債合計	85,532,170	356,519
負債合計	85,532,170	356,519
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,102,682,064	13,470,544,219
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,269,671,055	3,748,684,910
元本等合計	15,372,353,119	17,219,229,129
純資産合計	15,372,353,119	17,219,229,129
負債純資産合計	15,457,885,289	17,219,585,648

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年12月19日 至 平成30年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	11,776,318,682円	12,102,682,064円
期中追加設定元本額	2,838,779,099円	2,604,701,757円
期中一部解約元本額	2,512,415,717円	1,236,839,602円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	- 円	12,700,496円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	50,696円	59,366円
iFree 日本債券イン デックス	96,637,058円	115,879,263円
iFree 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	565,941,197円	1,073,449,867円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	5,146,920,747円	5,864,740,765円
	2,677,084,156円	3,186,852,570円

ダイワ・ライフ・バランス70	858,932,360円	1,030,403,541円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	614,116,560円	712,638,846円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	496,813,535円	571,642,583円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	154,223,264円	179,007,932円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	62,710,608円	56,559,291円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	46,788,441円	51,345,213円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,511,254円	5,092,545円
ダイワつみたてインデックス日本債券	-円	5,135,055円
ダイワ世界バランスファンド40VA	759,134,105円	382,555,859円
ダイワ世界バランスファンド60VA	221,878,439円	201,393,773円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	195,536,040円	9,240,428円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	202,403,604円	11,846,826円
計	12,102,682,064円	13,470,544,219円
2. 期末日における受益権の総数	12,102,682,064口	13,470,544,219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29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	11,838,220	68,012,350
地方債証券	75,300	3,303,800
特殊債券	63,000	1,652,700
社債券	203,800	3,572,800
合計	11,496,120	76,541,650

（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29年12月1日から平成29年12月18日まで、及び平成30年12月1日から平成30年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2702円 (12,702円)	1.2783円 (12,783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 8 6 2年国債	170,000,000	170,578,000	
	3 8 9 2年国債	50,000,000	50,199,500	
	1 2 3 5年国債	100,000,000	100,344,000	
	1 2 4 5年国債	120,000,000	120,487,200	
	1 2 5 5年国債	370,000,000	371,753,800	
	1 2 6 5年国債	233,000,000	234,262,860	
	1 2 7 5年国債	30,000,000	30,182,700	
	1 2 8 5年国債	167,000,000	168,132,260	
	1 2 9 5年国債	132,000,000	132,966,240	
	1 3 0 5年国債	197,000,000	198,544,480	
	1 3 1 5年国債	90,000,000	90,764,100	
	1 3 2 5年国債	90,000,000	90,807,300	
	1 3 3 5年国債	150,000,000	151,443,000	
	1 3 4 5年国債	60,000,000	60,616,200	
	1 3 5 5年国債	170,000,000	171,890,400	
	1 3 6 5年国債	65,000,000	65,765,700	
	1 3 7 5年国債	130,000,000	131,554,800	
	1 4 0年国債	30,000,000	42,902,700	
	2 4 0年国債	28,000,000	38,774,960	
	3 4 0年国債	19,000,000	26,443,060	
	4 4 0年国債	30,000,000	41,949,600	
	5 4 0年国債	35,000,000	47,081,650	
	6 4 0年国債	28,000,000	36,975,680	
	7 4 0年国債	31,000,000	39,155,480	
	8 4 0年国債	23,000,000	26,915,520	
	9 4 0年国債	40,000,000	34,087,600	

1 0	4 0 年国債	91,000,000	91,651,560	
1 1	4 0 年国債	40,000,000	38,839,600	
3 0 6	1 0 年国債	10,000,000	10,196,500	
3 0 8	1 0 年国債	100,000,000	102,204,000	
3 0 9	1 0 年国債	103,000,000	104,960,090	
3 1 0	1 0 年国債	30,000,000	30,614,400	
3 1 1	1 0 年国債	42,000,000	42,712,320	
3 1 2	1 0 年国債	94,000,000	96,577,480	
3 1 3	1 0 年国債	34,000,000	35,124,380	
3 1 4	1 0 年国債	77,000,000	79,198,350	
3 1 5	1 0 年国債	90,000,000	93,085,200	
3 1 6	1 0 年国債	56,000,000	57,779,120	
3 1 7	1 0 年国債	40,000,000	41,393,600	
3 1 8	1 0 年国債	33,000,000	34,058,640	
3 1 9	1 0 年国債	140,000,000	145,300,400	
3 2 0	1 0 年国債	35,000,000	36,219,400	
3 2 1	1 0 年国債	65,000,000	67,451,150	
3 2 2	1 0 年国債	140,000,000	144,823,000	
3 2 3	1 0 年国債	70,000,000	72,586,500	
3 2 4	1 0 年国債	80,000,000	82,674,400	
3 2 5	1 0 年国債	160,000,000	165,736,000	
3 2 6	1 0 年国債	20,000,000	20,684,400	
3 2 7	1 0 年国債	90,000,000	93,442,500	
3 2 8	1 0 年国債	60,000,000	61,937,400	
3 2 9	1 0 年国債	160,000,000	166,926,400	
3 3 0	1 0 年国債	81,000,000	84,683,880	
3 3 1	1 0 年国債	130,000,000	134,667,000	
3 3 2	1 0 年国債	65,000,000	67,457,000	
3 3 3	1 0 年国債	63,000,000	65,499,840	
3 3 4	1 0 年国債	181,000,000	188,529,600	
3 3 5	1 0 年国債	160,000,000	166,035,200	
3 3 7	1 0 年国債	50,000,000	51,347,000	
3 3 8	1 0 年国債	52,000,000	53,787,240	
3 3 9	1 0 年国債	25,000,000	25,885,500	
3 4 0	1 0 年国債	133,000,000	137,849,180	
3 4 1	1 0 年国債	15,000,000	15,461,250	
3 4 2	1 0 年国債	75,000,000	76,317,750	
3 4 3	1 0 年国債	192,000,000	195,269,760	
3 4 4	1 0 年国債	38,000,000	38,623,960	

345	10年国債	150,000,000	152,419,500
346	10年国債	43,000,000	43,660,480
347	10年国債	155,000,000	157,252,150
348	10年国債	150,000,000	152,044,500
349	10年国債	170,000,000	172,072,300
350	10年国債	185,000,000	186,970,250
351	10年国債	100,000,000	100,902,000
352	10年国債	110,000,000	110,801,900
2	30年国債	9,000,000	11,299,590
3	30年国債	4,000,000	4,990,480
4	30年国債	8,000,000	10,607,440
5	30年国債	8,000,000	9,992,960
6	30年国債	9,000,000	11,530,080
7	30年国債	12,000,000	15,292,560
10	30年国債	15,000,000	16,742,700
11	30年国債	9,000,000	10,811,070
12	30年国債	11,000,000	13,865,830
13	30年国債	11,000,000	13,724,040
14	30年国債	22,000,000	28,799,760
15	30年国債	21,000,000	27,863,850
16	30年国債	26,000,000	34,578,180
17	30年国債	17,000,000	22,382,880
18	30年国債	20,000,000	26,056,200
19	30年国債	15,000,000	19,578,300
20	30年国債	16,000,000	21,426,880
21	30年国債	16,000,000	20,956,320
22	30年国債	17,000,000	22,852,590
23	30年国債	16,000,000	21,548,480
24	30年国債	15,000,000	20,221,500
25	30年国債	17,000,000	22,367,920
26	30年国債	32,000,000	42,739,520
27	30年国債	32,000,000	43,457,280
28	30年国債	34,000,000	46,305,960
29	30年国債	43,000,000	57,948,090
30	30年国債	56,000,000	74,671,520
31	30年国債	38,000,000	50,099,200
32	30年国債	49,000,000	65,752,120
33	30年国債	65,000,000	83,554,900
34	30年国債	50,000,000	66,486,000

3 5	3 0 年国債	68,000,000	87,850,560	
3 6	3 0 年国債	59,000,000	76,398,510	
3 7	3 0 年国債	67,000,000	85,463,190	
3 8	3 0 年国債	39,000,000	49,010,910	
3 9	3 0 年国債	37,000,000	47,375,540	
4 0	3 0 年国債	44,000,000	55,379,280	
4 1	3 0 年国債	34,000,000	42,039,640	
4 2	3 0 年国債	33,000,000	40,825,290	
4 3	3 0 年国債	37,000,000	45,798,970	
4 4	3 0 年国債	42,000,000	52,015,320	
4 5	3 0 年国債	43,000,000	51,243,530	
4 6	3 0 年国債	55,000,000	65,556,150	
4 7	3 0 年国債	44,000,000	53,510,160	
4 8	3 0 年国債	45,000,000	52,571,700	
4 9	3 0 年国債	45,000,000	52,571,250	
5 0	3 0 年国債	44,000,000	44,852,720	
5 1	3 0 年国債	45,000,000	40,199,850	
5 2	3 0 年国債	47,000,000	44,249,560	
5 3	3 0 年国債	55,000,000	53,090,400	
5 4	3 0 年国債	45,000,000	45,684,000	
5 5	3 0 年国債	46,000,000	46,649,520	
5 6	3 0 年国債	50,000,000	50,651,000	
5 7	3 0 年国債	50,000,000	50,595,500	
5 8	3 0 年国債	55,000,000	55,592,900	
5 9	3 0 年国債	45,000,000	44,295,750	
6 0	3 0 年国債	21,000,000	21,739,620	
4 4	2 0 年国債	32,000,000	33,069,440	
4 5	2 0 年国債	20,000,000	20,643,400	
4 6	2 0 年国債	19,000,000	19,678,680	
4 7	2 0 年国債	23,000,000	23,957,950	
4 8	2 0 年国債	9,000,000	9,482,580	
4 9	2 0 年国債	4,000,000	4,205,040	
5 0	2 0 年国債	30,000,000	31,401,900	
5 1	2 0 年国債	25,000,000	26,360,750	
5 2	2 0 年国債	19,000,000	20,188,640	
5 3	2 0 年国債	13,000,000	13,884,260	
5 4	2 0 年国債	14,000,000	14,994,560	
5 5	2 0 年国債	41,000,000	43,887,630	
5 6	2 0 年国債	12,000,000	12,908,040	

57	20年国債	24,000,000	25,731,600
58	20年国債	35,000,000	37,708,300
59	20年国債	3,000,000	3,223,470
61	20年国債	40,000,000	41,967,200
62	20年国債	16,000,000	16,688,800
63	20年国債	30,000,000	32,651,100
64	20年国債	35,000,000	38,425,800
65	20年国債	42,000,000	46,328,100
66	20年国債	30,000,000	32,940,300
67	20年国債	19,000,000	21,055,230
68	20年国債	25,000,000	28,101,000
69	20年国債	12,000,000	13,425,000
70	20年国債	18,000,000	20,540,340
71	20年国債	17,000,000	19,210,680
72	20年国債	53,000,000	59,903,250
75	20年国債	14,000,000	15,977,080
76	20年国債	25,000,000	28,215,250
78	20年国債	17,000,000	19,268,990
79	20年国債	14,000,000	15,960,420
81	20年国債	65,000,000	74,432,800
82	20年国債	28,000,000	32,254,040
85	20年国債	31,000,000	36,045,870
86	20年国債	6,000,000	7,064,400
87	20年国債	20,000,000	23,401,600
88	20年国債	33,000,000	39,030,090
89	20年国債	15,000,000	17,627,400
92	20年国債	45,000,000	52,965,000
93	20年国債	18,000,000	21,108,960
94	20年国債	45,000,000	53,145,900
95	20年国債	30,000,000	36,065,100
96	20年国債	23,000,000	27,256,610
97	20年国債	25,000,000	29,945,250
98	20年国債	34,000,000	40,426,680
99	20年国債	53,000,000	63,218,930
100	20年国債	35,000,000	42,180,250
101	20年国債	18,000,000	22,026,240
102	20年国債	10,000,000	12,274,400
103	20年国債	21,000,000	25,576,950
104	20年国債	64,000,000	76,732,800

105	20年国債	38,000,000	45,693,860	
106	20年国債	16,000,000	19,395,360	
107	20年国債	20,000,000	24,116,600	
108	20年国債	48,000,000	56,923,200	
109	20年国債	35,000,000	41,623,750	
110	20年国債	27,000,000	32,660,550	
111	20年国債	35,000,000	42,816,200	
112	20年国債	34,000,000	41,237,920	
113	20年国債	70,000,000	85,166,200	
114	20年国債	45,000,000	54,884,250	
115	20年国債	42,000,000	51,683,100	
116	20年国債	27,000,000	33,325,830	
117	20年国債	37,000,000	45,256,920	
118	20年国債	13,000,000	15,790,580	
119	20年国債	23,000,000	27,414,620	
120	20年国債	40,000,000	46,768,800	
121	20年国債	16,000,000	19,289,600	
123	20年国債	42,000,000	51,747,780	
124	20年国債	45,000,000	54,912,600	
125	20年国債	25,000,000	31,183,250	
126	20年国債	21,000,000	25,688,250	
127	20年国債	43,000,000	52,082,460	
128	20年国債	32,000,000	38,824,000	
129	20年国債	45,000,000	54,045,000	
130	20年国債	28,000,000	33,675,880	
131	20年国債	47,000,000	55,941,280	
132	20年国債	25,000,000	29,809,000	
133	20年国債	47,000,000	56,637,820	
134	20年国債	15,000,000	18,097,650	
135	20年国債	20,000,000	23,872,000	
136	20年国債	40,000,000	47,228,000	
137	20年国債	18,000,000	21,521,160	
139	20年国債	62,000,000	73,314,380	
141	20年国債	48,000,000	57,532,800	
142	20年国債	45,000,000	54,547,200	
143	20年国債	48,000,000	56,915,520	
144	20年国債	24,000,000	28,127,520	
145	20年国債	75,000,000	90,092,250	
146	20年国債	71,000,000	85,405,190	

	1 4 7	2 0 年国債	89,000,000	105,837,910	
	1 4 8	2 0 年国債	59,000,000	69,323,820	
	1 4 9	2 0 年国債	97,000,000	114,072,000	
	1 5 0	2 0 年国債	75,000,000	87,082,500	
	1 5 1	2 0 年国債	74,000,000	83,658,480	
	1 5 2	2 0 年国債	69,000,000	77,956,890	
	1 5 3	2 0 年国債	72,000,000	82,477,440	
	1 5 4	2 0 年国債	87,000,000	98,236,050	
	1 5 5	2 0 年国債	68,000,000	74,554,520	
	1 5 6	2 0 年国債	63,000,000	62,696,340	
	1 5 7	2 0 年国債	93,000,000	89,227,920	
	1 5 8	2 0 年国債	63,000,000	63,465,570	
	1 5 9	2 0 年国債	82,000,000	83,908,140	
	1 6 0	2 0 年国債	66,000,000	68,550,900	
	1 6 1	2 0 年国債	69,000,000	70,346,880	
	1 6 2	2 0 年国債	60,000,000	61,080,600	
	1 6 3	2 0 年国債	72,000,000	73,122,480	
	1 6 4	2 0 年国債	90,000,000	89,605,800	
	1 6 5	2 0 年国債	60,000,000	59,628,600	
	1 6 6	2 0 年国債	50,000,000	51,473,500	
国債証券 合計				14,078,326,560	
地方債証券	7 5 1	東京都公債	100,000,000	102,569,400	
	2 1 - 3 5	兵庫県公債	100,000,000	101,615,500	
	3	兵庫県公債 1 2 年	100,000,000	103,388,200	
	1 1	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	117,547,200	
	2 8 - 1	静岡県公債	100,000,000	100,499,800	
	2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	103,226,800	
	2 9 - 6	千葉県公債	100,000,000	101,107,500	
	1 1 6	共同発行地方	100,000,000	103,226,800	
	1 1 7	共同発行地方	100,000,000	102,975,000	
	2 5 - 6	大阪市公債	100,000,000	103,548,100	
地方債証券 合計				1,039,704,300	
特殊債券	9 8	政保道路機構	100,000,000	101,585,300	
	1 2 2	政保道路機構	100,000,000	101,946,500	
	1 9 0	政保道路機構	100,000,000	103,050,300	
	2 4 1	政保道路機構	100,000,000	103,271,300	
	2 6 1	政保道路機構	100,000,000	103,111,600	
	3 6	地方公共団体	100,000,000	103,043,200	
	1 4	政保地方公共 6	100,000,000	100,456,000	

	6 5 地方公共団体	100,000,000	103,062,700	
	い1789 利付商工債	100,000,000	100,002,600	
特殊債券 合計			919,529,500	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	100,149,400	
	3 3 中日本高速道	100,000,000	102,952,700	
	2 5 西日本高速道	100,000,000	102,912,000	
	1 7 パナソニック	100,000,000	101,750,800	
	5 NTTファイナンス	100,000,000	100,594,700	
	4 4 野村ホールディング	100,000,000	101,341,300	
	8 0 三菱地所	100,000,000	117,130,400	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	111,523,900	
	7 0 東日本旅客鉄道	100,000,000	102,106,300	
	4 9 7 関西電力	100,000,000	104,960,600	
社債券 合計			1,045,422,100	
合計			17,082,982,460	

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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	123,036,300	147,401,950
金銭信託	-	164,535,577
コール・ローン	793,027,061	689,184,423
国債証券	165,664,776,804	167,455,873,047
派生商品評価勘定	1,926,259	26,908
未収入金	-	12,417
未収利息	1,252,417,864	1,232,206,917
前払費用	26,076,341	35,796,651

流動資産合計		167,861,260,629	169,725,037,890
資産合計		167,861,260,629	169,725,037,890
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,432,087	6,343,318
未払金		-	175,727
未払解約金		54,270,025	33,250,979
その他未払費用		-	5,620
流動負債合計		55,702,112	39,775,644
負債合計		55,702,112	39,775,644
純資産の部			
元本等			
元本	1	59,323,594,737	61,406,010,061
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		108,481,963,780	108,279,252,185
元本等合計		167,805,558,517	169,685,262,246
純資産合計		167,805,558,517	169,685,262,246
負債純資産合計		167,861,260,629	169,725,037,890

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	58,881,648,354円	59,323,594,737円
期中追加設定元本額	6,379,737,514円	6,439,352,239円
期中一部解約元本額	5,937,791,131円	4,356,936,915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	937,476,924円	690,377,947円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	31,459,334円	26,063,629円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	232,118,354円	171,491,829円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	64,271,557円	52,710,212円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	758,526,259円	542,916,644円

外国債券インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	2,206,505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)	257,923,135円	358,202,378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)	551,455,042円	1,129,646,948円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	406,568,796円	707,663,901円
D-I's 外国債券インデッ クス	880,097円	731,384円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	22,820円	27,109円
iFree 外国債券イン デックス	592,031,307円	503,496,973円
iFree 8資産バランス	253,214,157円	492,941,040円
iFree 年金バランス	- 円	4,389,691円
DCダイワ外国債券インデッ クス	39,940,525,208円	42,429,483,894円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	632,009,821円	739,788,743円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	300,452,088円	368,136,096円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	192,336,290円	237,768,692円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	273,754,216円	329,260,143円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	221,997,497円	263,486,369円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	68,923,747円	82,547,093円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	11,218,839円	10,485,123円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	17,808,259円	18,657,551円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,323,903円	1,851,074円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	- 円	1,402,439円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	480,519,859円	246,851,720円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	167,029,144円	154,707,266円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,370,904,816円	5,641,456,746円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	349,081,593円	17,076,090円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	135,747,380円	8,179,618円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	349,320,791円	325,032,492円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	127,522,458円	142,904,084円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	20,761,833円	28,395,905円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	374,472円	27,703,290円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,465,139,568円	5,533,310,797円
ダイワライフスタイル25	34,460,276円	35,190,841円
ダイワライフスタイル50	59,917,401円	62,125,559円
ダイワライフスタイル75	16,517,496円	17,342,246円
計	59,323,594,737円	61,406,010,061円
2. 期末日における受益権の総数	59,323,594,737口	61,406,010,061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29年12月19日 至 平成30年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	656,591,608	1,551,789,987

合計	656,591,608	1,551,789,987
----	-------------	---------------

(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29年12月1日から平成29年12月18日まで、及び平成30年12月1日から平成30年12月18日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	平成29年12月18日 現在				平成30年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	785,504,328	-	785,998,500	494,172	786,889,450	-	780,573,040	6,316,410
アメリカ・ドル	315,000,980	-	316,293,600	1,292,620	228,409,947	-	227,443,340	966,607
イギリス・ポンド	87,408,770	-	87,156,600	252,170	42,976,998	-	42,212,610	764,388
オーストラリア・ドル	11,529,794	-	11,697,360	167,566	14,552,556	-	14,227,840	324,716
カナダ・ドル	16,170,933	-	16,278,720	107,787	48,774,121	-	48,421,840	352,281
シンガポール・ドル	8,296,250	-	8,343,000	46,750	12,623,052	-	12,550,590	72,462
デンマーク・クローネ	8,895,027	-	8,869,380	25,647	28,784,040	-	28,487,190	296,850
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	7,193,659	-	7,108,920	84,739
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	10,785,429	-	10,701,790	83,639
ユーロ	338,202,574	-	337,359,840	842,734	392,789,648	-	389,418,920	3,370,728
合計	785,504,328	-	785,998,500	494,172	786,889,450	-	780,573,040	6,316,410

(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29年12月18日現在	平成30年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,8286円 (28,286円)	2,7633円 (27,633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	3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	アメリカ・ドル 4,280,000.000	アメリカ・ドル 4,323,442.000	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,105,143.580	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,849,405.060	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,501,424.880	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,155,278.200	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,577,402.850	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,497,561.080	
2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,112,954.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,157,488.880	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,384,074.270	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,448,222.390	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,042,388.800	
1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,331,690.250	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,863,961.160	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,346,083.720	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,229,331.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,934,091.360	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,136,834.800	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,500,129.900	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,420,166.250	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,414,265.610	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,104,021.540	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,795,196.250	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,526,202.800	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	1,973,528.390	

2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,862,172.650	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,304,501.850	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,030,389.270	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,467,961.790	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	1,993,923.880	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,236,738.920	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,627,565.400	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,708,250.100	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,794,313.340	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	3,912,000.000	3,867,364.080	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,383,868.730	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,687,796.240	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,437,882.800	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	704,363.880	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,416,698.180	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	754,807.560	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,033,541.100	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	795,274.200	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	890,730.880	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	854,735.000	

5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	888,419.160	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	571,331.970	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,277,820.560	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	991,000.000	1,241,762.640	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,626,000.000	1,968,728.280	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	705,072.060	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	659,265.920	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	634,394.460	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,341,401.020	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,329,696.570	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,298,415.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,458,993.800	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,130,540.300	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,784,212.040	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,796,207.180	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,746,729.140	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,228,667.480	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,652,919.450	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,516,399.430	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,459,062.500	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,633,646.880	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,332,163.800	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,629,978.840	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,473,620.200	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,326,000.000	2,334,885.320	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,798,000.000	3,648,434.760	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,339,974.480	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	3,983,003.060	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	3,944,772.540	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	3,831,256.050	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,802,315.880	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,162,000.000	5,063,973.620	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,329,000.000	3,341,716.780	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,277,764.140	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,571,168.750	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,122,443.750	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,759,534.330	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,627,845.760	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,820,949.560	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,276,992.500	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,116,236.150	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,180,064.560	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,900,146.820	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,341,278.360	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,495,304.410	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,349,333.410	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,744,312.040	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,757,696.760	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,744,871.040	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,805,599.860	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,572,281.240	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	3,762,480.150	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,560,751.820	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,533,431.040	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,750,263.200	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,960,844.970	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,951,993.670	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,767,880.570	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,080,858.550	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,126,224.620	

2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,472,849.280	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,419,468.190	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,373,923.850	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,803,900.200	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,387,210.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,809,248.040	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,646,520.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,040,997.880	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,636,526.140	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,480,646.080	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,033,089.280	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,123,412.260	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	2,987,830.410	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	3,492,000.000	3,415,036.320	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,041,004.060	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	4,963,550.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,466,140.560	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,039,916.120	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,198,347.040	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,058,191.160	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,907,947.340	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,019,822.200	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	5,029,000.000	4,640,006.850	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,376,867.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	1,977,657.300	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,031,203.420	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,616,462.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,387,100.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,406,050.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,830,050.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,101,208.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	2,921,286.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,550,261.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,554,590.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,604,943.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,259,000.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,355,075.750	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,916,274.140	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,188,425.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,881,620.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,376,550.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,201,059.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,421,699.300	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,336,616.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20191215	1,440,000.000	1,421,712.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	1,960,780.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,445,100.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200115	1,500,000.000	1,479,135.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,123,463.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	2,936,857.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,424,373.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	3,471,299.450	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,130,000.000	2,097,453.600	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	2,935,201.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,232,955.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315	1,900,000.000	1,875,129.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	2,550,000.000	2,475,081.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,826,572.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200415	850,000.000	836,544.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,515,605.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	3,423,980.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	2,921,700.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,891,010.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	4,000,000.000	3,932,640.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	2,907,180.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	2,000,000.000	1,925,780.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615	2,700,000.000	2,652,210.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	2,905,530.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,310,000.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715	2,000,000.000	1,962,420.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,637,686.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815	1,300,000.000	1,274,650.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,818,423.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,905,530.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	3,534,570.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,080,224.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,910,000.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915	2,500,000.000	2,444,225.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,426,750.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,400,000.000	3,288,956.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015	1,000,000.000	980,890.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,436,325.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,245,625.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,100,000.000	2,882,504.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,406,480.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201115	3,600,000.000	3,535,992.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20191130	2,800,000.000	2,776,256.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	1,968,660.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,090,720.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,000,000.000	991,830.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	1,300,000.000	1,263,834.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,267,731.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20200131	2,300,000.000	2,282,290.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,455,970.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,250,230.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,800,000.000	1,790,010.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,476,650.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,290,430.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,563,028.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,698,920.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	3,519,000.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,178,848.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,500,000.000	1,490,910.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,876,655.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,878,018.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,482,125.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,900,000.000	3,904,563.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	5,500,000.000	5,509,405.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	2,995,170.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,200,000.000	1,194,420.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,505,075.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,912,901.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	1,400,000.000	1,395,450.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	1,900,000.000	1,912,464.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,506,250.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	4,993,150.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,492,375.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,300,000.000	3,289,275.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,997,630.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,294,687.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,300,000.000	3,295,215.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,500,000.000	2,505,250.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,000,000.000	6,009,840.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,200,000.000	4,104,828.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,503,400.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,516,600.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,500,000.000	2,496,375.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,609,000.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,596,040.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,505,320.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20200930	3,300,000.000	3,302,442.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,536,500.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,022,500.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,014,880.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,536,500.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,300,000.000	3,309,900.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,030,920.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,020,440.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	2,500,000.000	2,557,225.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,800,000.000	1,891,116.000	

	2.75% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,500,000.000	2,502,425.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 685,911,272.390 (77,363,932,412)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20200722	2,280,000.000	2,325,508.800	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,941,222.420	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,516,012.750	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,582,000.000	2,002,337.400	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,512,524.600	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	1,300,000.000	1,286,545.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,210,000.000	1,129,535.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,100,000.000	1,106,710.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,330,000.000	1,349,418.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,110,000.000	2,124,706.700	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	1,987,320.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,200,000.000	1,239,900.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	930,000.000	912,888.000	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	200,000.000	200,452.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	70,000.000	69,230.000	
	8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,298,850.260	
	6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,372,434.310	

4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,796,136.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,829,121.920	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,826,105.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,209,831.900	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,807,372.640	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,893,522.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,204,513.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,558,788.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,596,000.000	2,444,752.800	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,480,000.000	2,030,264.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,416,696.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,791,748.000	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,523,116.020	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,620,000.000	2,278,530.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,244,000.000	2,095,766.800	
3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,886,868.100	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,295,481.200	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	867,818.160	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,352,000.000	2,043,142.400	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,318,407.360	

	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,966,000.000	2,535,353.600	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,064,112.960	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,602,353.400	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,531,534.080	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	2,867,612.400	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 78,094,544.980 (11,111,291,860)	
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	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,420,000.000	2,634,000.600	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,409,000.000	2,487,822.480	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,442,800.560	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,362,669.320	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,052,741.680	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,546,472.830	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,074,000.000	2,225,754.580	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,538,642.700	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,358,000.000	1,666,510.440	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,216,958.400	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,271,146.170	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	560,509.100	

	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,185,759.050	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	712,000.000	758,344.080	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,522,000.000	2,588,933.880	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,078,000.000	2,044,855.900	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,132,000.000	1,142,674.760	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,802,106.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	2,875,348.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	750,000.000	756,727.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,500,000.000	1,541,070.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	600,000.000	600,918.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	290,000.000	283,544.600	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 43,586,310.630 (3,530,927,024)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	425,000.000	492,702.500	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	563,513.680	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,318,743.650	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,626,914.660	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,578,005.840	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,781,372.850	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,876,000.000	1,917,665.960	

3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	984,708.680	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,794,214.680	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	1,955,620.800	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,226,661.940	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,440,167.150	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,197,000.000	1,332,141.300	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,171,906.560	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,719,000.000	1,710,198.720	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,831,000.000	1,793,977.180	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,087,249.580	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,237,000.000	1,204,268.980	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,432,018.400	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,139,646.800	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840,000.000	800,906.400	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,400,000.000	1,349,936.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,193,820.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,583,920.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,600,000.000	1,588,176.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200501	700,000.000	698,229.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	600,000.000	600,120.000	

	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	300,000.000	284,022.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200801	300,000.000	298,974.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	600,000.000	609,732.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20201101	2,200,000.000	2,200,880.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	600,000.000	607,644.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210201	300,000.000	301,650.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 39,669,709.310 (3,334,635,765)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	711,117.120	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	850,744.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	455,782.800	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	653,838.500	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	379,175.800	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	498,712.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	410,600.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	506,466.500	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	468,000.000	520,701.480	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	132,162.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	532,646.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	224,118.720	

	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	568,000.000	583,131.520	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	249,875.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	451,306.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	198,640.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	150,000.000	144,523.500	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	200,000.000	198,020.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	300,000.000	310,932.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 8,012,493.940 (658,546,877)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,095,000.000	10,072,166.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,901,678.900	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,559,778.450	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,554,966.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,857,059.150	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	5,987,969.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,668,345.500	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 49,601,964.400 (617,544,457)	
デンマーク・ク ローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	20,025,239.120	

	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	8,327,725.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,264,839.780	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	8,363,000.000	9,383,202.370	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	6,900,000.000	7,065,462.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	1,500,000.000	1,524,780.000	
	デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 51,591,248.770 (884,274,004)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,428,377.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,334,100.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,401,183.150	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,423,212.450	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,299,018.200	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,445,791.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,400,000.000	2,436,024.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 29,767,705.800 (388,170,884)	
ポーランド・ズ ロチ	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,309,000.000	2,620,853.540	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,478,000.000	2,488,407.600	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,322,461.450	

	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,148,270.000	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,060,763.200	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,370,000.000	2,309,612.400	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,347,608.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,150,000.000	2,186,550.000	
	Poland Government Bond 20200725	300,000.000	293,775.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	1,000,000.000	1,006,600.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,033,204.180	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,414,822.400	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,204,269.800	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,406,226.250	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	2,400,000.000	2,364,360.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,696,065.050	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 33,903,848.870 (1,012,707,966)	
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	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	545,295.450	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	794,493.900	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,189,685.760	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,939,279.400	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,540,903.780	

4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,270,737.000	
3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	864,316.250	
3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	716,803.980	
4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	596,258.760	
3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,044,000.000	1,043,853.840	
3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	986,195.210	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	927,000.000	863,630.280	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	569,222.820	
3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	659,411.200	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	602,310.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,066,967.510	
4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	865,672.840	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	732,231.610	
3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	701,918.000	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,161,719.820	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	783,026.200	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	698,869.080	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	901,932.600	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	639,112.500	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	351,454.400	

	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500,000.000	502,685.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	749,775.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	590,000.000	577,108.500	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,056,321.000	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,191,528.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	500,000.000	498,335.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	710,283.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	400,000.000	408,228.000	
	マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 27,779,565.690 (749,770,477)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5% Mexican Bonos 20191211	21,447,000.000	20,741,608.170	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	13,290,000.000	11,116,287.600	
	8% Mexican Bonos 20471107	7,000,000.000	6,117,930.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	9,620,800.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	15,633,000.000	15,176,516.400	
	10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	23,357,000.430	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	24,168,000.000	22,211,842.080	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,495,446.220	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	8,580,891.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	9,050,124.520	
	8% Mexican Bonos 20200611	18,928,000.000	18,796,828.960	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	27,826,000.000	26,514,838.880	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	11,748,640.500	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	22,964,642.440	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	15,976,031.760	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	6,126,413.440	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 237,595,842.400 (1,335,288,635)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	

0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	438,924.960	
0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	413,855.100	
0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	292,394.790	
0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	418,373.340	
Finland Government Bond 20230915	200,000.000	201,264.000	
1.375% Finland Government Bond 20470415	200,000.000	210,244.000	
Finland Government Bond 20220415	770,000.000	778,893.500	
0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	301,575.000	
1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	380,707.800	
0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	497,065.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	934,302.060	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,162,842.720	
1.5% Austria Government Bond 20470220	734,000.000	758,177.960	
1.5% Austria Government Bond 20861102	150,000.000	140,584.500	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	906,840.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	584,170.200	
2.1% Austria Government Bond 21170920	340,000.000	390,697.400	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	404,520.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,021,590.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,446,482.060	

1% Belgium Government Bond 20310622	924,000.000	919,028.880	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	596,658.240	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,334,101.890	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	944,000.000	912,753.600	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	440,000.000	449,429.200	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	495,679.100	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,420,846.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	650,000.000	662,213.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	491,464.000	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	299,538.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,140,000.000	1,144,890.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	554,889.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,296,910.220	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,115,377.820	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,034,623.700	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,788,175.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,567,875.660	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,327,602.080	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,891,155.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,259,609.030	

4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,057,644.750	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,528,678.510	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,162,751.750	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,037,780.320	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	2,263,371.220	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,516,228.880	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,484,575.010	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,838,604.420	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,524,167.250	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	3,025,637.230	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,398,937.860	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,038,000.000	2,821,611.000	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,764,521.640	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,522,546.200	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,968,664.990	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,775,017.920	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,724,936.220	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,409,000.000	3,383,970.480	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,744,585.180	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,647,997.080	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,281,672.240	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,290,358.180	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,251,489.680	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,845,981.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,622,624.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,372,979.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,000,000.000	1,094,930.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,500,000.000	1,541,460.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,200,000.000	1,199,184.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20191213	1,000,000.000	1,006,540.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200313	700,000.000	705,845.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200612	800,000.000	807,824.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200911	350,000.000	353,993.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20201211	700,000.000	708,561.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,745,921.220	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,472,109.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,600,423.380	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,422,204.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	360,000.000	366,026.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,134,965.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	500,000.000	508,110.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	900,000.000	912,888.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,357,389.100	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,209,045.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,467,601.010	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,533,669.910	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,209,000.000	3,402,169.260	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,364,000.000	2,189,820.160	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,550,609.800	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	3,865,991.680	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,961,016.330	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	4,916,667.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,380,000.000	3,565,933.800	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	1,919,248.200	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,878,703.400	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,288,293.030	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,583,716.500	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	4,036,124.400	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,199,000.000	3,808,153.580	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,952,246.840	

3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,238,000.000	3,064,493.400	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,627,277.780	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,458,449.340	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,282,612.210	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,727,955.220	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,355,305.160	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3,070,000.000	3,094,989.800	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,601,000.000	2,729,749.500	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,224,995.870	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	3,920,000.000	4,164,568.800	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,737,000.000	2,765,191.100	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,269,000.000	2,259,969.380	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	887,000.000	854,518.060	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,798,863.400	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,758,000.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	2,000,000.000	2,019,960.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,120,000.000	1,195,432.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200225	700,000.000	704,851.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,597,375.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,250,000.000	2,432,587.500	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,413,104.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,129,725.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	2,400,000.000	2,423,400.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	950,000.000	963,214.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,100,000.000	2,103,969.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	1,100,000.000	1,098,097.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	724,582.040	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,817,761.680	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,095,168.750	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	924,679.000	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,221,613.080	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,549,000.000	2,493,177.460	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,607,866.260	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,576,191.800	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,456,764.640	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,513,514.150	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,249,000.000	1,804,842.470	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,690,078.200	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,388,124.720	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,307,757.180	

0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,370,914.800	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,217,280.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,245,000.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	800,000.000	805,456.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,186,144.500	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,464,963.360	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,474,257.600	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,085,321.200	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,837,146.640	
1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,454,739.300	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,371,768.550	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,623,461.400	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,599,039.820	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,499,314.550	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,516,273.390	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,591,000.000	1,546,977.030	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,495,472.320	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	774,797.220	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,262,462.400	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,279,619.650	

1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,211,129.080	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,657,109.340	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	806,097.600	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,427,679.680	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	660,205.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,329,427.680	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	648,000.000	549,212.400	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,200,000.000	1,097,280.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,010,000.000	1,934,444.100	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,278,836.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,240,912.500	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	970,000.000	968,321.900	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,419,840.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,300,000.000	1,232,179.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,660,322.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,200,000.000	1,145,160.000	
0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015	1,900,000.000	1,887,821.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	800,000.000	746,568.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,412,955.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	869,445.000	

1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,227,512.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	500,000.000	490,750.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,050,000.000	1,038,450.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	400,000.000	408,264.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	600,000.000	600,156.000	
2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	200,000.000	205,792.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,454,000.000	2,957,315.400	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,671,192.910	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,655,000.000	2,111,217.300	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,009,269.950	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	2,999,973.100	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,038,756.400	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,917,451.400	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	2,461,119.660	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,534,175.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,437,606.200	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,468,597.760	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,677,913.600	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,341,305.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,337,154.200	

3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,279,372.160	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,496,075.490	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,236,237.400	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,888,035.510	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,177,762.900	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,799,769.300	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,104,404.460	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,413,000.000	1,680,127.650	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,444,116.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,840,814.430	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,371,335.390	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,017,690.560	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,635,278.220	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,442,787.280	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,629,612.800	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	1,003,077.520	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	1,869,672.000	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,518,599.960	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,634,890.980	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,295,123.830	

4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,542,681.000	
4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	926,336.800	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,483,828.620	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	753,000.000	1,087,354.590	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,712,915.750	
3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	741,987.420	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,476,090.720	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	842,287.950	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	587,890.800	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	708,332.580	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	858,917.870	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	532,063.080	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	814,130.020	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,100,876.540	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	350,000.000	354,399.500	
IRISH TREASURY 20221018	50,000.000	50,086.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	497,495.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	686,574.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	201,652.000	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	735,000.000	784,112.700	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,233,482.250	
3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,336,682.880	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,484,939.050	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	1,926,036.270	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,166,497.500	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	904,802.220	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	1,000,088.080	

3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	553,367.700	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	881,040.370	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,048,215.770	
2.4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	746,870.490	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,021,891.400	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	836,097.840	
3.375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	665,281.120	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	501,847.650	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	470,328.230	
1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	656,345.520	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	479,035.220	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	542,502.510	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	586,708.610	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,365,359.200	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,838,566.900	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,122,404.120	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,944,266.240	
1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,650,000.000	1,688,775.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,851,034.630	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,786,849.070	

2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,452,000.000	1,559,956.200	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	850,000.000	974,822.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,730,000.000	1,759,185.100	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	1,380,000.000	1,398,464.400	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	1,843,488.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,450,000.000	1,528,720.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,800,000.000	1,828,134.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	1,300,000.000	1,305,187.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,000,000.000	1,012,810.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,100,000.000	2,112,726.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	850,000.000	868,530.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	700,000.000	700,399.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	700,000.000	700,126.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	200,000.000	200,496.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	2,935,233.010	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,184,123.540	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,308,000.000	1,893,003.000	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,047,885.460	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	2,655,202.260	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,226,849.900	

	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,729,223.310	
	4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,839,904.930	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,850,677.050	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,664,382.800	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,340,132.240	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,164,025.600	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,601,000.000	1,907,671.550	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,380,048.200	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,499,000.000	2,271,809.450	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,306,476.000	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,350,632.150	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,938,323.000	
	ユーロ 小計		ユーロ 512,093,907.030 (65,532,657,283)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,819,681.280	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	17,934,000.000	19,191,173.400	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,612,000.000	8,054,779.920	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,569,632.740	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,019,549.200	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,224,847.150	

	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	5,539,000.000	5,410,772.150	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	17,652,000.000	15,223,084.800	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,520,821.480	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	11,862,000.000	10,474,857.720	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	11,944,000.000	10,315,077.280	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	8,243,000.000	7,237,766.150	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	6,166,000.000	5,566,048.200	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	5,179,000.000	4,623,552.250	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 119,251,643.720 (936,125,403)	
国債証券	合計		167,455,873,047 [167,455,873,047]	
合計			167,455,873,047 [167,455,873,047]	

- (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 246銘柄	100%	46.3%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	100%	6.6%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	100%	2.1%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	100%	0.4%
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 6銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リンギット	国債証券 33銘柄	100%	0.4%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	100%	0.8%

ユーロ	国債証券	299銘柄	100%	39.1%
南アフリカ・ランド	国債証券	14銘柄	100%	0.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月19日から2019年6月18日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2019年6月18日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	194,792
親投資信託受益証券	50,432,716
流動資産合計	50,627,508
資産合計	50,627,508
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	7,784
未払委託者報酬	86,322
その他未払費用	1,878
流動負債合計	95,984
負債合計	95,984
純資産の部	
元本等	
元本	1 32,791,601
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	17,739,923
（分配準備積立金）	6,540,314
元本等合計	50,531,524
純資産合計	50,531,524
負債純資産合計	50,627,508

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,828,662
営業収益合計	1,828,662
営業費用	
受託者報酬	7,784
委託者報酬	86,322
その他費用	1,878
営業費用合計	95,984
営業利益又は営業損失（ ）	1,732,678
経常利益又は経常損失（ ）	1,732,678
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,732,678
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	209,279
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	14,754,314
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,298,618
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,298,618
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,836,408
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,836,408
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	17,739,923

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年6月18日現在
1. 1 期首元本額	30,264,603円
期中追加設定元本額	6,268,149円
期中一部解約元本額	3,741,151円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	32,791,601口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年6月18日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2019年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5410円 (15,410円)

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年6月18日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	20,518,019,920
株式	133,196,924,740
	3 4

未収入金		24,540,100
未収配当金		1,081,966,113
未収利息		780,557
その他未収収益	5	37,525,116
流動資産合計		154,859,756,546
資産合計		154,859,756,546
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		11,036,280
前受金		2,135,000
未払解約金		56,423,500
受入担保金		19,577,434,830
流動負債合計		19,647,029,610
負債合計		19,647,029,610
純資産の部		
元本等		
元本	1	137,609,256,631
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2	2,396,529,695
元本等合計		135,212,726,936
純資産合計		135,212,726,936
負債純資産合計		154,859,756,546

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	株式

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日
期首元本額	134,974,559,390円
期中追加設定元本額	9,965,797,638円
期中一部解約元本額	7,331,100,397円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス	4,064,718,502円
ファンド	
ダイワ・トピックス・イン	7,809,558,561円
デックスファンドVA	
適格機関投資家専用・ダイ	28,922,843円
ワ・トピックスインデックス	
ファンドVA2	
ダイワ国内重視バランスファ	60,746,661円
ンド30VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国内重視バランスファ	970,087,745円
ンド50VA(一般投資家私	
募)	

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	49,591,649円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	1,345,886,376円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	18,427,623円
D-I's TOPIXイン デックス	40,206,774円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	20,284,281円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,813,332円
iFree TOPIXイン デックス	1,098,419,689円
iFree 8資産バランス	1,722,463,213円
iFree 年金バランス	45,552,958円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,604,106,366円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,830,723,893円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,175,206,497円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,924,490,418円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,894,631,904円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	15,661,912円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	51,777,925円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	18,725,917円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	125,977,111円
ダイワつみたてインデックス バランス30	198,705円
ダイワつみたてインデックス バランス50	298,057円

ダイワつみたてインデックス バランス70	447,086円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	370,487円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	380,895円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	748,462円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	4,378,927円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	4,332,378円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	8,522,639円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	171,234,737円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	171,314,178円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,583,310,698円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	2,950,347円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	830,881,612円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	127,351,633円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	223,926,223円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	164,335,677円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	8,975,916,690円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	1,902,082,431円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,518,241,712円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,424,824,797円

	ダイワライフスタイル25	192,967,338円
	ダイワライフスタイル50	678,951,850円
	ダイワライフスタイル75	559,987,603円
	DC・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	13,143,319,319円
計		137,609,256,631円
2.	期末日における受益権の総数	137,609,256,631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2,396,529,695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 18,392,021,000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 481,500,000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35,890,363円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	2019年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 株価指数 先物取引 買 建	2,023,965,000	-	2,013,000,000	10,965,000
合計	2,023,965,000	-	2,013,000,000	10,965,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額	0.9826円
(1万口当たり純資産額)	(9,826円)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年6月18日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	530,947,365

コール・ローン		310,012,779
株式		107,809,021,772
投資証券		3,235,341,313
派生商品評価勘定		861,495
未収入金		3,673,530
未収配当金		176,539,075
差入委託証拠金		536,458,376
流動資産合計		112,602,855,705
資産合計		112,602,855,705
負債の部		
流動負債		
未払金		11,606,889
未払解約金		20,495,900
その他未払費用		764,215
流動負債合計		32,867,004
負債合計		32,867,004
純資産の部		
元本等		
元本	1	44,946,577,592
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		67,623,411,109
元本等合計		112,569,988,701
純資産合計		112,569,988,701
負債純資産合計		112,602,855,705

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日
期首元本額	44,096,261,199円
期中追加設定元本額	3,105,384,525円
期中一部解約元本額	2,255,068,132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)	554,018,213円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘッ ジなし)	1,807,001,571円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	537,665,428円
D-I's 外国株式インデッ クス	6,557,780円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	493,277円
iFree 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	907,222,731円
iFree 8資産バランス	683,828,509円
iFree 年金バランス	18,051,051円
DCダイワ外国株式インデッ クス	28,414,228,575円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	566,725,995円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	846,970,888円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	648,485,560円
大和DC海外株式インデック スファンド	1,489,890,251円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,399,663円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	13,174,854円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	4,250,389円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	64,244,189円
ダイワつみたてインデックス バランス30	39,782円
ダイワつみたてインデックス バランス50	79,563円

ダイワつみたてインデックス バランス70	99,454円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	73,565円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	151,649円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	1,162,691円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	1,725,194円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	205,401,310円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	345,545,113円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	2,865,699,348円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	147,509,273円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	664,013,511円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	108,061,389円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	6,602,114円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,695,756,099円
ダイワライフスタイル25	19,225,455円
ダイワライフスタイル50	67,892,598円
ダイワライフスタイル75	55,808,334円
計	44,946,577,592円
2. 期末日における受益権の総数	44,946,577,592口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

	<p>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>
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（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	2019年6月18日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	1,587,325,591	-	1,588,097,866	772,275
合計	1,587,325,591	-	1,588,097,866	772,275

（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。

- 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。
- 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。
- 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	2019年6月18日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				

為替予約取引				
買 建	357,696,780	-	357,786,000	89,220
アメリカ・ドル	357,696,780	-	357,786,000	89,220
合計	357,696,780	-	357,786,000	89,220

(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)

	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5045円 (25,045円)

「ダイワ」- REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年6月18日現在
	金 額 (円)

資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,691,865,150
投資証券	2	275,565,460,950
派生商品評価勘定		29,184,000
未収配当金		1,409,944,053
流動資産合計		281,696,454,153
資産合計		281,696,454,153
負債の部		
流動負債		
前受金		27,400,000
未払金		1,260,716,666
未払解約金		50,222,400
流動負債合計		1,338,339,066
負債合計		1,338,339,066
純資産の部		
元本等		
元本	1	95,956,371,908
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		184,401,743,179
元本等合計		280,358,115,087
純資産合計		280,358,115,087
負債純資産合計		281,696,454,153

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

	<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	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日
期首元本額	83,618,179,092円
期中追加設定元本額	14,411,838,425円
期中一部解約元本額	2,073,645,609円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ - REITオープン	6,814,159,423円
ダイワJ - REITオープン (毎月分配型)	80,466,287,689円
ダイワJ - REITオープン (年1回決算型)	339,767,050円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	79,957円
iFree J - REITイ ンデックス	96,949,729円
iFree 8資産バランス	590,869,858円
DC・ダイワJ - REIT オープン	4,404,226,207円

	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,455,461円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,838,857円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,399,634円
	ダイワ・ノーロード J - R EITファンド	50,411,216円
	ダイワファンドラップ J - REITインデックス	1,118,256,297円
	ダイワ J - REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	426,314,579円
	ダイワファンドラップオンラ イン J - REITインデッ クス	374,359,443円
	ダイワ・インデックスセレク ト J - REIT	1,265,996,508円
	計	95,956,371,908円
2.	期末日における受益権の総数	95,956,371,908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 453,600,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	2019年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	3,803,600,000	-	3,833,000,000	29,400,000
合計	3,803,600,000	-	3,833,000,000	29,400,000

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.9217円
（1万口当たり純資産額）	（29,217円）

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年6月18日現在
	金 額 (円)

資産の部	
流動資産	
預金	60,577,909
コール・ローン	154,182,740
投資信託受益証券	140,767,238
投資証券	22,435,369,195
派生商品評価勘定	2,431,570
未収入金	527,305
未収配当金	38,672,619
差入委託証拠金	59,738,202
流動資産合計	22,892,266,778
資産合計	22,892,266,778
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	113,223
未払金	69,023,980
未払解約金	13,660,000
流動負債合計	82,797,203
負債合計	82,797,203
純資産の部	
元本等	
元本	1 9,336,470,536
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,472,999,039
元本等合計	22,809,469,575
純資産合計	22,809,469,575
負債純資産合計	22,892,266,778

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

	<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、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日
期首元本額	8,605,559,107円
期中追加設定元本額	1,284,529,005円
期中一部解約元本額	553,617,576円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジあり）	4,507,886,136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）	686,971,736円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス（為替ヘッジあり）	334,540,901円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス（為替ヘッジなし）	229,567,663円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,216,249円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	79,996円
iFree 外国REITイ ンデックス	83,936,413円
iFree 8資産バランス	710,450,097円

DCダイワ・グローバルREIT ITインデックスファンド	1,995,608,217円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,943,144円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,830,872円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,473,077円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	247,516,568円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	29,835,439円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)(ダ イワSMA専用)	285,004,866円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)(ダ イワSMA専用)	213,609,162円
計	9,336,470,536円
2. 期末日における受益権の総数	9,336,470,536口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	2019年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	217,020,290	-	219,033,679	2,013,389
合計	217,020,290	-	219,033,679	2,013,389

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2019年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	112,316,642	-	112,621,600	304,958
アメリカ・ドル	87,471,085	-	87,851,700	380,615
イギリス・ポンド	8,257,836	-	8,164,800	93,036
カナダ・ドル	7,247,561	-	7,280,100	32,539
シンガポール ・ドル	7,920,800	-	7,915,000	5,800

ニュージーランド・ドル	1,419,360	-	1,410,000	9,360
合計	112,316,642	-	112,621,600	304,958

(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)

	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4431円 (24,431円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年6月18日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	

コール・ローン		125,588,588
国債証券		15,204,412,260
地方債証券		1,143,668,500
特殊債券		716,437,900
社債券		1,044,542,200
未収利息		50,333,045
前払費用		1,395,128
流動資産合計		18,286,377,621
資産合計		18,286,377,621
負債の部		
流動負債		
未払金		56,853,300
未払解約金		3,124,036
流動負債合計		59,977,336
負債合計		59,977,336
純資産の部		
元本等		
元本	1	13,927,914,501
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		4,298,485,784
元本等合計		18,226,400,285
純資産合計		18,226,400,285
負債純資産合計		18,286,377,621

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
有価証券の評価基準及び評価 方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

	<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。</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日
期首元本額	13,470,544,219円
期中追加設定元本額	1,264,642,846円
期中一部解約元本額	807,272,564円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
日本債券インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	43,512,468円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	147,207円
iFree 日本債券イン デックス	128,280,974円
iFree 8資産バランス	1,313,349,704円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	5,940,595,403円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,227,857,027円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	991,881,217円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 安定コース）	778,776,381円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 6分散コー ス）	612,247,192円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 成長コース）	199,852,802円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	54,575,749円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	53,937,496円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,820,519円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	63,117,645円
ダイワつみたてインデックス バランス30	419,453円
ダイワつみたてインデックス バランス50	305,057円
ダイワつみたてインデックス バランス70	152,529円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	320,567,682円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	190,225,395円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	2,292,601円
計	13,927,914,501円
2. 期末日における受益権の総数	13,927,914,501口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年6月18日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3086円 (13,086円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年6月18日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	301,610,418
コール・ローン	1,020,627,338
国債証券	172,577,005,055
派生商品評価勘定	714,238
未収入金	210,828
未収利息	1,191,581,928
前払費用	35,712,024
流動資産合計	175,127,461,829
資産合計	175,127,461,829
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,116,459
未払金	1,168,600
未払解約金	31,953,251
流動負債合計	36,238,310
負債合計	36,238,310
純資産の部	
元本等	
元本	1 62,754,354,808
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	112,336,868,711
元本等合計	175,091,223,519
純資産合計	175,091,223,519

負債純資産合計	175,127,461,829
---------	-----------------

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<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> <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	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日
期首元本額	61,406,010,061円
期中追加設定元本額	3,130,082,272円
期中一部解約元本額	1,781,737,525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	652,620,225円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	22,454,828円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	147,272,269円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	41,724,252円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	478,956,132円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	12,135,645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)	383,469,892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)	1,318,407,779円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	773,960,847円
D-I's 外国債券インデッ クス	2,268,798円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	69,170円

i F r e e 外国債券イン デックス	559,596,492円
i F r e e 8資産バランス	613,844,744円
i F r e e 年金バランス	9,717,259円
D Cダイワ外国債券インデッ クス	43,741,677,210円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	758,422,044円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	377,628,316円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	231,907,260円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	364,164,600円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	286,366,993円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	93,532,652円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	10,210,959円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	18,516,474円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	2,180,071円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	31,345,881円
ダイワつみたてインデックス バランス30	53,558円
ダイワつみたてインデックス バランス50	35,706円
ダイワつみたてインデックス バランス70	35,706円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	211,467,656円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	149,389,183円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	5,222,112,367円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	1,603,962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)	308,506,848円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	148,248,943円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	30,713,189円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ S M A専用)	3,934,856円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,634,026,324円
ダイワライフスタイル 2 5	34,452,178円
ダイワライフスタイル 5 0	60,559,548円
ダイワライフスタイル 7 5	16,763,992円
計	62,754,354,808円
2. 期末日における受益権の総数	62,754,354,808口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2019年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)

		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	984,911,981	-	982,509,760	2,402,221
アメリカ・ドル	451,698,265	-	450,242,880	1,455,385
イギリス・ポンド	65,906,553	-	65,459,290	447,263
オーストラリア・ドル	3,850,994	-	3,793,890	57,104
カナダ・ドル	51,595,479	-	51,695,100	99,621
シンガポール・ドル	23,732,703	-	23,748,000	15,297
スウェーデン・クローナ	2,156,276	-	2,152,600	3,676
デンマーク・クローネ	7,784,257	-	7,784,640	383
ノルウェー・クローネ	12,093,167	-	12,081,960	11,207
ポーランド・ズロチ	23,728,799	-	23,904,720	175,921
メキシコ・ペソ	20,124,048	-	20,366,040	241,992
ユーロ	314,162,787	-	313,250,640	912,147
南アフリカ・ランド	8,078,653	-	8,030,000	48,653
合計	984,911,981	-	982,509,760	2,402,221

(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)

	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.7901円
(1万口当たり純資産額)	(27,901円)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2019年6月28日

資産総額	51,006,800円
負債総額	5,524円
純資産総額（ - ）	51,001,276円
発行済数量	32,871,676口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.5515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

2019年6月28日

資産総額	155,598,886,758円
負債総額	18,082,616,590円
純資産総額（ - ）	137,516,270,168円
発行済数量	137,726,173,770口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9985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

2019年6月28日

資産総額	114,139,929,196円
負債総額	53,087,710円
純資産総額（ - ）	114,086,841,486円
発行済数量	45,109,732,813口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.5291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

2019年6月28日

資産総額	291,116,277,094円
負債総額	3,837,598,069円
純資産総額(-)	287,278,679,025円
発行済数量	98,093,263,391口
1単位当たり純資産額(/)	2.9286円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2019年6月28日

資産総額	22,332,804,119円
負債総額	50,196,769円
純資産総額(-)	22,282,607,350円
発行済数量	9,396,786,374口
1単位当たり純資産額(/)	2.3713円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

純資産額計算書

2019年6月28日

資産総額	18,348,364,851円
負債総額	3,508,736円
純資産総額(-)	18,344,856,115円
発行済数量	14,003,785,708口
1単位当たり純資産額(/)	1.3100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

2019年6月28日

資産総額	177,245,825,755円
負債総額	437,987,039円
純資産総額(-)	176,807,838,716円

発行済数量	62,994,327,197口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.8067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

2019年6月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に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。

2019年6月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	75	145,253
追加型株式投資信託	721	15,318,969
株式投資信託 合計	796	15,464,222
単位型公社債投資信託	30	111,005
追加型公社債投資信託	14	1,392,102
公社債投資信託 合計	44	1,503,108
総合計	840	16,967,330

3 【委託会社等の経理状況】

- 1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
- 3．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	1	206
建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
固定負債		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374

役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31 日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	210	215
有価証券償還益	17	133
その他	130	172
営業外収益計	359	521
営業外費用		
投資有価証券売却損	0	40
有価証券償還損	3	32
その他	25	60
営業外費用計	29	132
経常利益	18,741	16,961
特別損失		
関係会社整理損失	333	29
特別損失計	333	29
税引前当期純利益	18,407	16,931
法人税、住民税及び事業税	5,843	5,076
法人税等調整額	106	15
法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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		利益剰余金 合計		
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金			繰越利益 剰余金
				繰越利益 剰余金			

当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	41,112

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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		利益剰余金合計		
		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	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

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。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の前事業年度期首残高が480百万円増加しております。

（未適用の会計基準等）

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）等を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めておりました「有価証券償還損」は、営業外費用の総額の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、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円

器具備品

235百万円

264百万円

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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金	4,406百万円	3,788百万円

3 保証債務

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2017年4月1日至2018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
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017年 6月27日

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

2018年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	4,857円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018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

2019年6月21日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019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。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,709	28,709	-
(2) 未収委託者報酬		12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券		7,631	7,631	-
資産計		48,709	48,709	-
(1) 未払手数料		(5,202)	(5,202)	-
(2) その他未払金		(4,476)	(4,476)	-
(3) 未払費用(*2)		(3,286)	(3,286)	-
負債計		(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,489	28,489	-

(2) 未収委託者報酬	11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	8,380	8,380	-
資産計	48,338	48,338	-
(1) 未払手数料	(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金	(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)	(2,805)	(2,805)	-
負債計	(11,298)	(11,298)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	1,836
(3) 長期差入保証金	1,072	1,070

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(2018年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-

有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
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	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

(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(2018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(2019年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,836百万円)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(2018年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(2019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	87	55	32
(2)その他 証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
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	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1)株式	-	-	-
(2)その他 証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	389	86	-
(2)その他 証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,318百万円	2,350百万円
勤務費用	159	158
退職給付の支払額	166	171
その他	38	52
退職給付債務の期末残高	2,350	2,389

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,350百万円	2,389百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389
退職給付引当金	2,350	2,389
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	159百万円	158百万円
その他	24	41
確定給付制度に係る退職給付費用	184	199

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171百万円、当事業年度174百万円であります。

（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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		731
	719	
賞与引当金	244	182
システム関連費用	16	170
未払事業税	162	141
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	68	32
その他	297	240
繰延税金資産小計	1,602	1,592
評価性引当額	200	164
繰延税金資産合計	1,402	1,428
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
その他有価証券評価差額金	164	85
繰延税金負債合計	323	244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引（譲渡益）は480百万円減少しております。

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（2018年3月31日）

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,701	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	有償減資(注2)	3,293	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

(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 2017年4月1日 至 2018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)(注1)
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)	23,216	未払手数料	3,913
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)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(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)	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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 2018年4月1日 至 2019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) (注1)
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)	19,975	未払手数料	3,400
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)	1,052	未払費用	173
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)	1,063	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額	15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益	4,550.81円

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

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

(注3)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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,670	11,870

普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525
-----------------	-----------	-----------

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2019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 (2019年3月 末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	(注1)
東海東京証券株式会社	6,000	
第一生命保険株式会社	60,000	(注2)
株式会社みずほ銀行	1,404,065	(注3)

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

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

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

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

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

委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2019年5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	小倉 加奈子	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治	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2018年4月1日から2019年3月31日までの第60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2019年3月31日現在の財政状態及び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31年2月1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 深井 康治 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29年12月19日から平成30年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成30年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年7月26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 深井 康治 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2018年12月19日から2019年6月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の2019年6月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月19日から2019年6月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。