

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成28年3月11日提出
【計算期間】	第8計算期間 （自 平成26年12月19日 至 平成27年12月18日）
【ファンド名】	D C ダイワ・ターゲットイヤ-2040
【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 白川 真
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山村 政
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

##### (注1) 商品分類の定義

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

##### (注2) 属性区分の定義

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

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

### < 信託金の限度額 >

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

### < ファンドの特色 >

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

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

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

## 〈2016年1月時点の基本配分比率〉

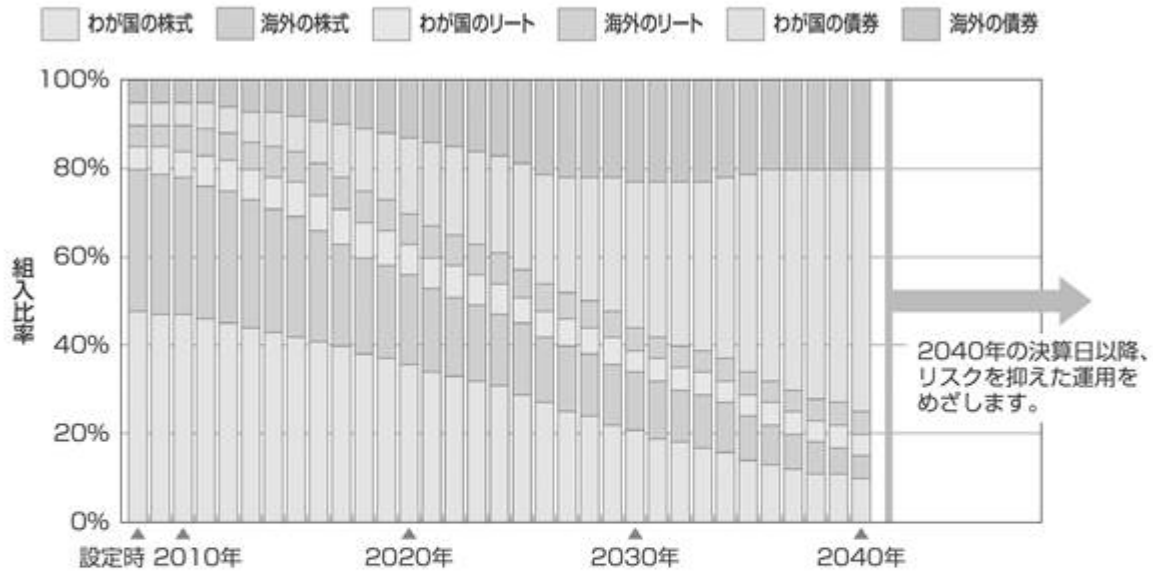
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	42%	27%	8%	7%	8%	8%

## 〈当初設定時の基本配分比率〉

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

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

## ファンドの基本配分比率のイメージ



- (注1) 2016年1月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2015年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要性があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。

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

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

### 運用プロセス



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

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

### 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

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

#### 運用プロセス



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

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

#### MSC I コクサイ指数とは

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

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

## 4

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

## 運用プロセス



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

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

## 東証REIT指数とは

- 「東証REIT指数」は、東京証券取引所上場の不動産投信全銘柄を対象とする時価総額加重平均の指数で、平成15年4月より算出・公表されています。

## 【算出方法の概要】

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

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

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

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



## 5

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

## 運用プロセス



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

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

## S&amp;P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

## 【特徴】

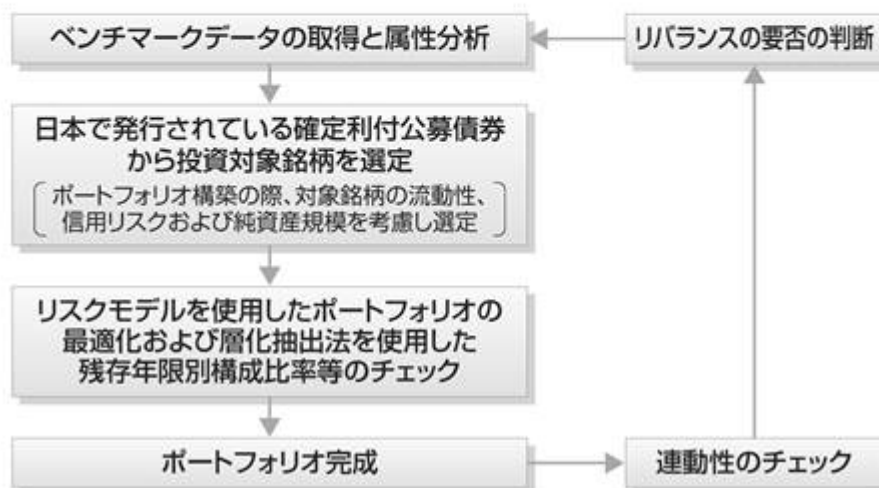
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

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

## 6

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

## 運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

## NOMURA－BPI総合指数とは

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

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

## 7

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

## 運用プロセス



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

## ①為替レート変動への対応

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

## ②債券価格変動への対応

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

## ③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

## シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

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

## 8

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

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

#### NOMURA－BPI総合短期指数とは

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

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

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

## ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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

〈2040年の決算日前日まで〉



〈2040年の決算日から〉



・ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

9

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

10

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

#### 〈分配方針〉

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

#### (2) 【ファンドの沿革】

平成20年2月28日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）
お取扱窓口	販売会社
	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3）
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金（ 3）

受託会社	三井住友信託銀行 株式会社  再信託受託会社： 日本トラスティ・ サービス信託銀行株 式会社	信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行な います。なお、信託事務の一部につき日本トラ スティ・サービス信託銀行株式会社に委託するこ とができます。また、外国における資産の保管は、 その業務を行なうに十分な能力を有すると認めら れる外国の金融機関が行なう場合があります。  委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 　　　　　　　　　　　　　　　　など
------	--	--

損益 投資

投資対象	内外の株式・債券・リート（REIT）および短期金融資産 など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）
------	---

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（平成28年1月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

#### 当初設定時の基本配分比率

トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	.....	信託財産の純資産総額の48%
外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	.....	信託財産の純資産総額の32%
ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券	.....	信託財産の純資産総額の 5%
ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券	.....	信託財産の純資産総額の 5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）の受益証券	.....	信託財産の純資産総額の 5%
外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	.....	信託財産の純資産総額の 5%

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

### (2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。



1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
  - イ．有価証券
  - ロ．約束手形
  - ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

- イ．為替手形

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

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

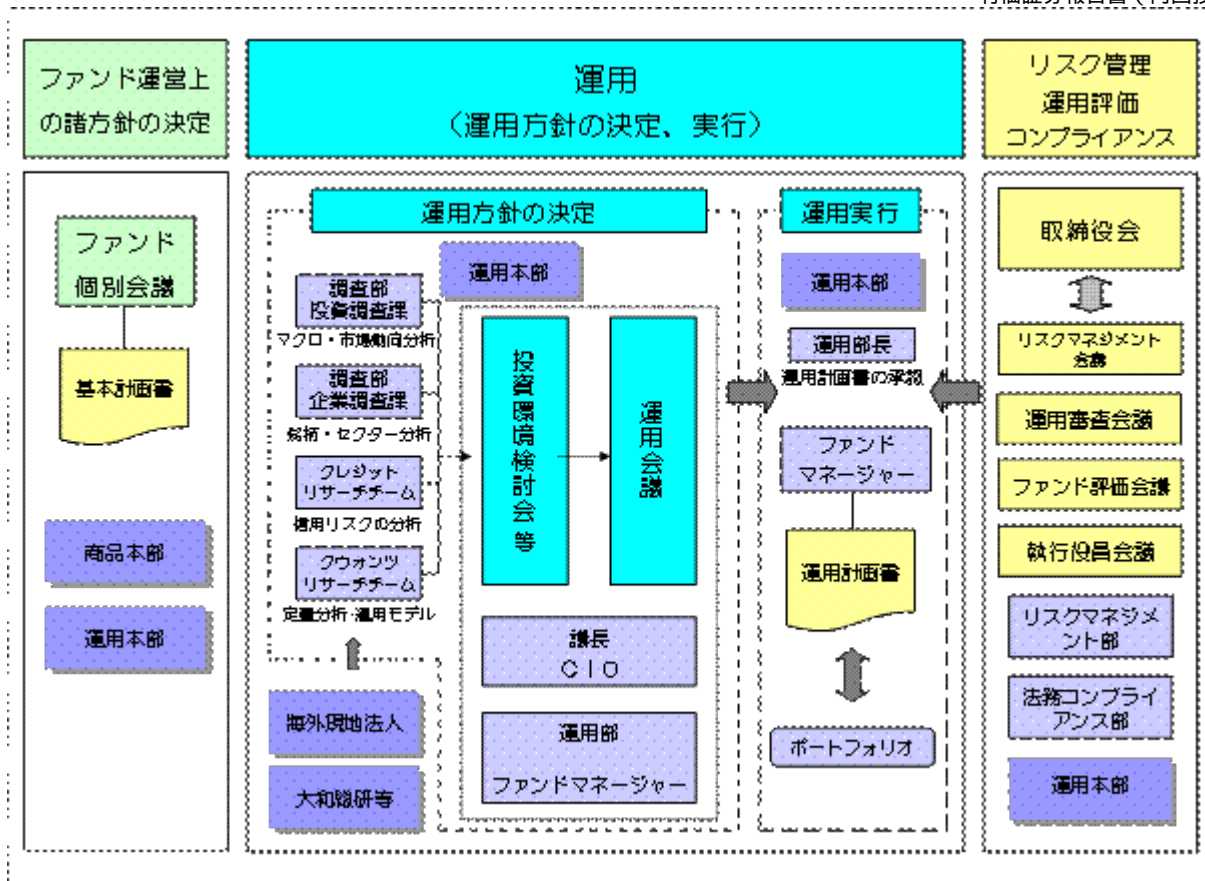
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

### (3) 【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．投資環境の検討

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

#### ハ．基本的な運用方針の決定

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

#### ニ．運用計画書の作成・承認

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

### 職務権限

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

#### イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更

- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（1～5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（1～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

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

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成28年1月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## <参考> 各マザーファンドの概要

### 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

## (2) 投資対象

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

## (3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

（注）東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

## 2. 外国株式インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

## 投資態度

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

## (2) 投資対象

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

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

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）MSCIコクサイ指数とは

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

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

## 3. ダイワJ-REITマザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

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

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

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

#### 投資態度

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

#### (2) 投資対象

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

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

#### イ．為替手形

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

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

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

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

#### (3) 主な投資制限



## 株式

株式への直接投資は、行ないません。

## 投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

## 同一銘柄の投資信託証券

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

## 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

## 先物取引

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

## （注）東証REIT指数とは

「東証REIT指数」は、東京証券取引所上場の不動産投信全銘柄を対象とする時価総額加重平均の指数で、平成15年4月より算出・公表されています。

## [ 算出方法の概要 ]

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## (1) 投資方針

### 主要投資対象

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

### 投資態度

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

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

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

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

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

4．外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

## (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

[ 特徴 ]

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

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

## 5 . ダイワ日本債券インデックスマザーファンド ( B P I )

### (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 - B P I 総合指数 ) の動きに連動する投資成果をめざします。
- ロ . 運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ . 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

### (3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引

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

(注) NOMURA - B P I 総合指数とは

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

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

## 6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の公社債等に投資し、ベンチマーク(NOMURA - B P I 総合短期指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、NOMURA - B P I 総合短期指数が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

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

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、）の行使等により取得したものに限り、

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

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

スワップ取引

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



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

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

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

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

#### 金利先渡取引

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

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

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

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

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

#### (注) NOMURA - B P I 総合短期指数とは

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

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

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

## 7. 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資方針

### 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

### 投資態度

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

## (2) 投資対象

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

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

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

## 3 【投資リスク】

## 〈基準価額の主な変動要因〉

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

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

## (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

## 〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



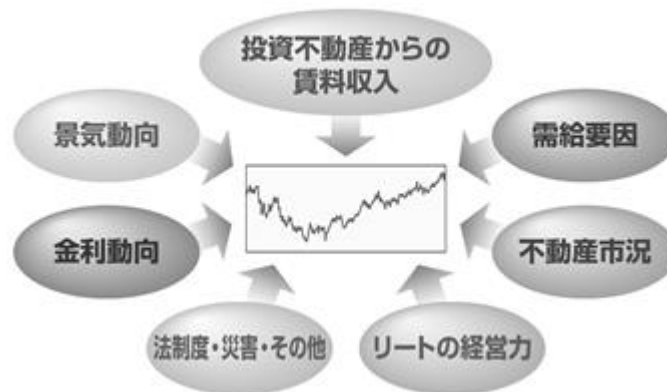
※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

#### リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

##### 〈リートの主な価格変動要因〉



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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

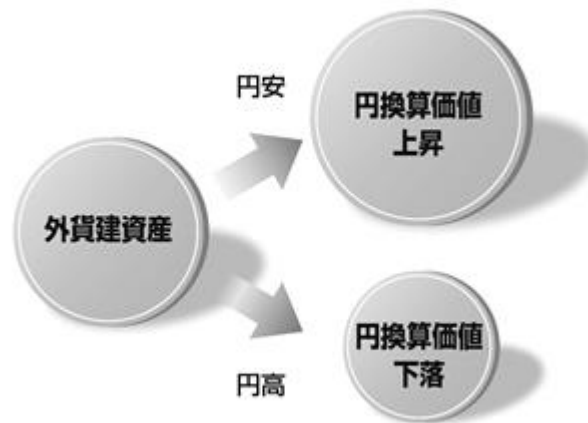
- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

## 外国証券への投資に伴うリスク

## イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

## ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

## (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

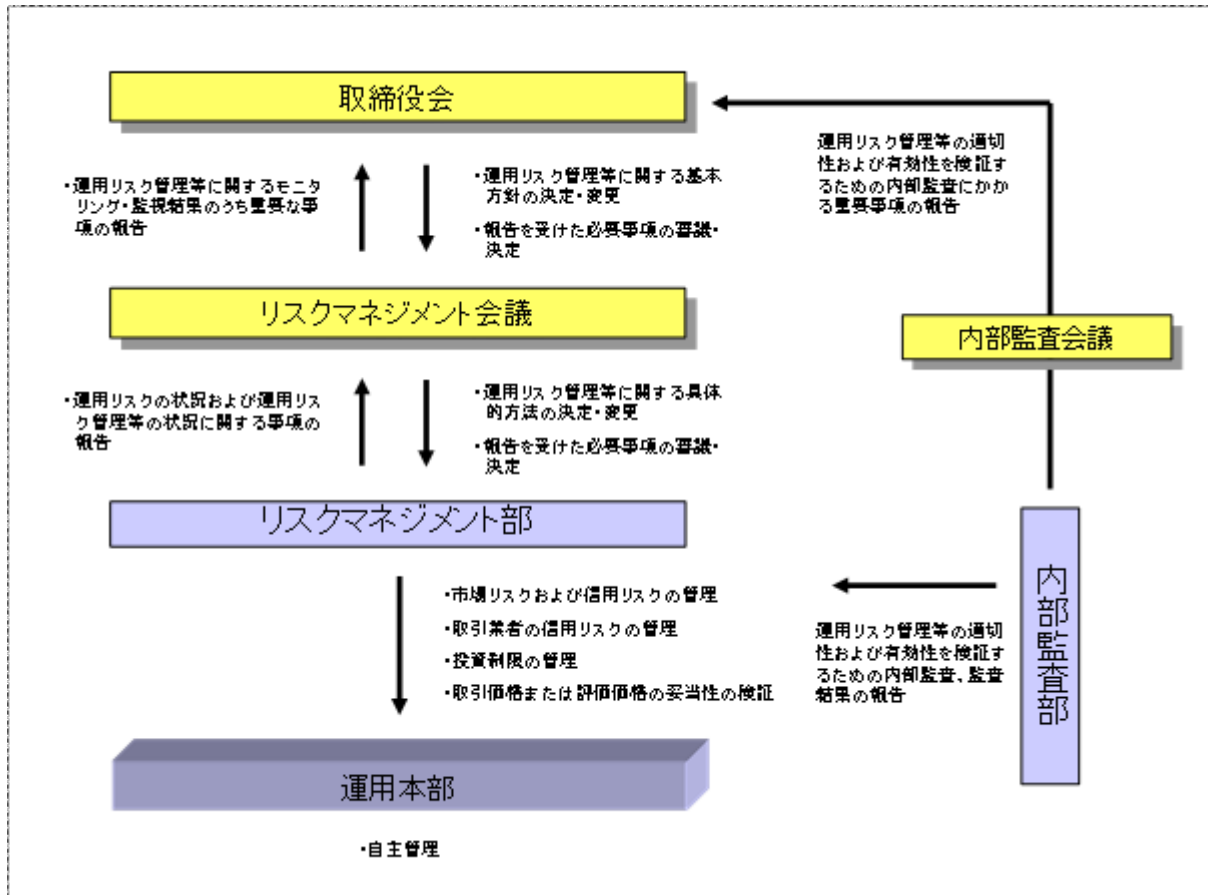
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付を中止することがあります。ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

## (3) その他の留意点

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

## (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。

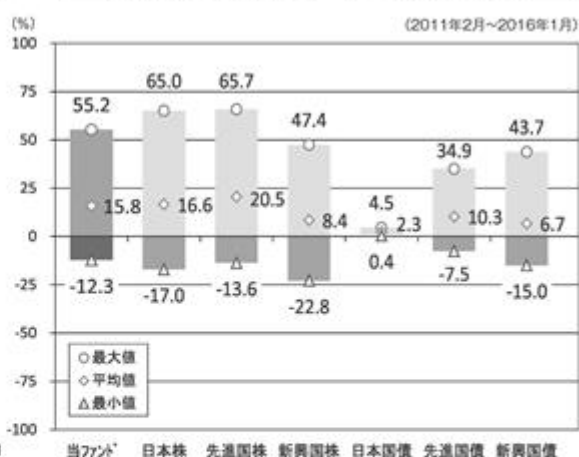
## 参 考 情 報

- 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年間に於ける年間騰落率（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年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

## ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



## 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村証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証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー 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 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

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

## ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。



収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

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

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

< 第1計算期間から2016年3月11日まで >

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

< 2016年3月12日から第18計算期間まで >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.165% （税抜）	年率0.165% （税抜）	年率0.03% （税抜）

< 第19計算期間から第28計算期間まで >

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

< 第29計算期間から第33計算期間まで >

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

< 第34計算期間以降 >

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から收受した後、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、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

#### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

#### ハ．損益通算について

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

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

#### <注1> 個別元本について

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

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

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

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

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

（ ）上記は、平成28年1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】（平成28年1月29日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	21,542,984	99.81
内 日本	21,542,984	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	40,631	0.19
純資産総額	21,583,615	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（平成28年1月29日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	10,767,048	0.9121 9,820,701	0.8539 9,193,982	42.60
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	3,135,944	1.9916 6,245,667	1.8297 5,737,836	26.58
3	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	757,432	2.2966 1,739,519	2.3593 1,787,009	8.28
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	593,810	2.8583 1,697,327	2.8599 1,698,237	7.87
5	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	1,324,673	1.2305 1,630,011	1.2466 1,651,337	7.65
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	721,809	2.1654 1,563,006	2.0429 1,474,583	6.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.81%
合計	99.81%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年12月18日)	681,848	681,848	0.6054	0.6054
第2計算期間末 (平成21年12月18日)	1,176,672	1,176,672	0.6991	0.6991
第3計算期間末 (平成22年12月20日)	952,605	952,605	0.7319	0.7319
第4計算期間末 (平成23年12月19日)	1,354,908	1,354,908	0.6293	0.6293
第5計算期間末 (平成24年12月18日)	3,373,491	3,373,491	0.7645	0.7645
第6計算期間末 (平成25年12月18日)	9,736,661	9,736,661	1.1001	1.1001
第7計算期間末 (平成26年12月18日)	13,831,791	13,831,791	1.2972	1.2972
平成27年1月末日	15,136,491	-	1.3250	-
2月末日	15,076,197	-	1.3869	-

3月末日	15,875,732	-	1.3985	-
4月末日	16,294,834	-	1.4176	-
5月末日	17,032,335	-	1.4682	-
6月末日	17,636,856	-	1.4249	-
7月末日	21,511,921	-	1.4509	-
8月末日	20,186,026	-	1.3584	-
9月末日	19,856,554	-	1.2917	-
10月末日	21,851,887	-	1.3958	-
11月末日	22,375,138	-	1.4091	-
第8計算期間末 (平成27年12月18日)	22,270,544	22,270,544	1.3817	1.3817
12月末日	22,864,160	-	1.3873	-
平成28年1月末日	21,583,615	-	1.3096	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	39.5
第2計算期間	15.5
第3計算期間	4.7
第4計算期間	14.0
第5計算期間	21.5
第6計算期間	43.9
第7計算期間	17.9
第8計算期間	6.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

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

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況（平成28年1月29日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	119,864,919,690	98.01
内 日本	119,864,919,690	98.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,438,870,985	1.99
純資産総額	122,303,790,675	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2,604,590,000	2.13
内 日本	2,604,590,000	2.13

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

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

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

## (2) 投資資産（平成28年1月29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	703,300	7,099.08 4,992,786,332	7,200.00 5,063,760,000	4.14
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,478,600	722.92 3,237,697,635	609.40 2,729,258,840	2.23
3	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	431,600	4,329.91 1,868,792,753	5,028.00 2,170,084,800	1.77
4	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	446,500	4,569.51 2,040,287,180	3,980.00 1,777,070,000	1.45
5	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	374,600	3,991.59 1,495,250,432	4,661.00 1,746,010,600	1.43
6	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	567,100	2,724.57 1,545,104,662	3,008.00 1,705,836,800	1.39
7	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	508,600	3,685.28 1,874,336,800	3,341.00 1,699,232,600	1.39
8	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	316,700	5,931.54 1,878,521,198	5,265.00 1,667,425,500	1.36
9	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,854,500	228.11 1,791,750,944	205.80 1,616,456,100	1.32
10	武田薬品	日本	株式	医薬品	235,600	5,467.69 1,288,189,408	5,773.00 1,360,118,800	1.11
11	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	233,400	5,287.70 1,234,149,420	5,312.00 1,239,820,800	1.01
12	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	103,200	10,175.01 1,050,061,110	10,990.00 1,134,168,000	0.93
13	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	50,600	18,771.45 949,835,430	22,105.00 1,118,513,000	0.91
14	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	662,800	1,577.54 1,045,597,110	1,650.00 1,093,620,000	0.89
15	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	430,300	2,153.68 926,731,341	2,527.00 1,087,368,100	0.89
16	花王	日本	株式	化学	159,200	5,105.39 812,778,306	6,395.00 1,018,084,000	0.83
17	キヤノン	日本	株式	電気機 器	303,100	3,519.17 1,066,662,606	3,342.00 1,012,960,200	0.83



18	ソニー	日本	株式	電気機器	399,600	3,029.29 1,210,507,145	2,523.00 1,008,190,800	0.82
19	三菱地所	日本	株式	不動産業	414,000	2,391.72 990,174,870	2,367.50 980,145,000	0.80
20	東京海上HD	日本	株式	保険業	225,800	4,316.65 974,700,332	4,248.00 959,198,400	0.78
21	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	792,700	1,111.70 881,249,790	1,180.00 935,386,000	0.76
22	ファナック	日本	株式	電気機器	57,900	19,626.44 1,136,371,088	15,810.00 915,399,000	0.75
23	富士重工業	日本	株式	輸送用機器	178,700	4,245.21 758,619,617	4,856.00 867,767,200	0.71
24	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	199,400	4,151.16 827,743,052	4,336.00 864,598,400	0.71
25	日立	日本	株式	電気機器	1,441,000	625.67 901,593,770	586.40 845,002,400	0.69
26	三井不動産	日本	株式	不動産業	295,000	3,118.60 919,987,550	2,803.00 826,885,000	0.68
27	村田製作所	日本	株式	電気機器	59,400	16,112.71 957,095,350	13,695.00 813,483,000	0.67
28	三菱商事	日本	株式	卸売業	417,700	2,076.39 867,310,900	1,905.50 795,927,350	0.65
29	パナソニック	日本	株式	電気機器	646,100	1,249.36 807,211,600	1,114.00 719,755,400	0.59
30	デンソー	日本	株式	輸送用機器	139,200	5,340.78 743,437,796	5,160.00 718,272,000	0.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.01%
合計	98.01%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.11%
鉱業	0.34%
建設業	2.97%

食料品	4.86%
繊維製品	0.74%
パルプ・紙	0.25%
化学	5.97%
医薬品	5.34%
石油・石炭製品	0.46%
ゴム製品	0.95%
ガラス・土石製品	0.94%
鉄鋼	1.15%
非鉄金属	0.86%
金属製品	0.65%
機械	4.39%
電気機器	10.73%
輸送用機器	10.58%
精密機器	1.57%
その他製品	1.50%
電気・ガス業	2.10%
陸運業	4.61%
海運業	0.22%
空運業	0.69%
倉庫・運輸関連業	0.22%
情報・通信業	7.59%
卸売業	3.97%
小売業	4.80%
銀行業	8.18%
証券、商品先物取引業	1.20%
保険業	2.42%
その他金融業	1.35%
不動産業	2.72%
サービス業	3.59%
合計	98.01%

(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 2016年3月	買建	181	2,648,271,989	2,604,590,000	2.13%

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

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

## 外国株式インデックスマザーファンド

### (1) 投資状況 (平成28年1月29日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	68,674,703,140	95.81
内 香港	849,982,343	1.19
内 シンガポール	335,540,994	0.47
内 イスラエル	223,850,982	0.31
内 ノルウェー	167,062,961	0.23
内 スウェーデン	848,276,858	1.18
内 デンマーク	574,943,021	0.80
内 イギリス	5,736,395,419	8.00
内 アイルランド	113,877,012	0.16
内 オランダ	889,644,528	1.24
内 ベルギー	441,973,441	0.62
内 フランス	2,850,042,546	3.98
内 ドイツ	2,676,058,205	3.73
内 スイス	2,806,865,836	3.92
内 ポルトガル	45,343,397	0.06
内 スペイン	938,141,076	1.31
内 イタリア	654,090,217	0.91
内 フィンランド	315,450,702	0.44
内 オーストリア	52,065,927	0.07
内 カナダ	2,477,463,226	3.46
内 アメリカ	43,801,975,833	61.11
内 オーストラリア	1,836,287,158	2.56
内 ニュージーランド	39,371,458	0.05

投資証券		1,846,241,251	2.58
	内 香港	33,281,746	0.05
	内 シンガポール	19,736,075	0.03
	内 イギリス	97,869,232	0.14
	内 フランス	113,541,134	0.16
	内 カナダ	6,940,105	0.01
	内 アメリカ	1,391,483,162	1.94
	内 オーストラリア	183,389,797	0.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,158,342,454	1.62
純資産総額		71,679,286,845	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)	1,022,940,941	1.43
内 アメリカ	1,022,940,941	1.43

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

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

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

## (2) 投資資産（平成28年1月29日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	121,500	14,228.81 1,728,804,214	11,372.65 1,381,777,983	1.93
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	162,600	6,516.70 1,059,634,172	6,291.88 1,023,060,964	1.43
3	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	88,755	9,817.06 871,318,186	9,305.78 825,934,619	1.15
4	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	59,000	12,374.79 730,119,465	12,361.37 729,321,119	1.02
5	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	200,900	3,670.21 737,346,766	3,409.74 685,017,308	0.96

6	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	8,500	81,383.70 691,761,492	76,794.75 652,755,413	0.91
7	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	103,872	6,694.74 695,398,722	5,912.96 614,191,023	0.86
8	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	69,550	9,106.26 633,342,004	8,726.90 606,956,173	0.85
9	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	46,000	12,737.64 585,936,181	13,188.12 606,653,782	0.85
10	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	6,667	90,617.56 604,147,594	88,351.13 589,037,018	0.82
11	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	131,691	4,059.29 534,576,447	4,294.51 565,548,461	0.79
12	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,250	93,238.15 582,739,109	90,447.02 565,293,881	0.79
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	57,737	9,149.85 528,285,409	9,647.84 557,037,534	0.78
14	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	78,720	8,118.47 639,092,438	6,923.43 545,012,693	0.76
15	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	86,854	5,470.81 475,166,975	5,923.83 514,509,086	0.72
16	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	131,363	3,963.32 520,634,564	3,650.27 479,510,943	0.67
17	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	15,350	32,845.11 504,172,439	30,770.68 472,329,969	0.66
18	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	49,650	10,580.77 525,335,479	9,233.58 458,447,694	0.64
19	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	88,700	5,214.33 462,514,011	5,145.43 456,400,164	0.64
20	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	40,018	10,923.02 437,117,490	10,385.15 415,592,949	0.58
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	27,300	16,284.33 444,564,211	14,779.98 403,493,552	0.56
22	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	34,300	13,889.29 476,403,666	11,304.97 387,760,509	0.54

23	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	25,200	16,271.51 410,043,256	15,230.82 383,816,883	0.54
24	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必 需品	31,300	12,176.92 381,141,547	11,778.78 368,675,861	0.51
25	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技 術	101,200	4,165.78 421,580,056	3,622.47 366,594,359	0.51
26	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	222,301	2,112.80 469,679,242	1,635.37 363,544,631	0.51
27	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケ ア	60,521	6,517.79 394,463,616	5,946.80 359,906,525	0.50
28	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必 需品	33,000	10,566.45 348,693,028	10,764.68 355,234,513	0.50
29	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	427,500	927.55 396,539,404	828.97 354,384,812	0.49
30	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技 術	41,500	9,649.05 400,436,267	8,379.91 347,766,560	0.49

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.81%
投資証券	2.58%
合計	98.38%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	6.73%
素材	4.09%
資本財・サービス	9.70%
一般消費財・サービス	12.27%
生活必需品	11.20%
ヘルスケア	13.61%
金融	17.17%
情報技術	14.23%
電気通信サービス	3.38%
公益事業	3.42%

その他	0.00%
合計	95.81%

(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 2016年3月	買建	18	1,080,928,202	1,022,940,941	1.43%

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

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

#### ダイワJ-REITマザーファンド

##### (1) 投資状況（平成28年1月29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	212,671,880,700	98.65
内 日本	212,671,880,700	98.65
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,910,243,544	1.35
純資産総額	215,582,124,244	100.00

##### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	2,125,800,000	0.99
内 日本	2,125,800,000	0.99

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

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

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

## (2) 投資資産（平成28年1月29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	27,858	540,151.36 15,047,536,705	622,000.00 17,327,676,000	8.04
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	25,832	527,653.77 13,630,352,296	638,000.00 16,480,816,000	7.64
3	日本リテールファンド	日本	投資証券	50,353	218,662.64 11,010,320,147	254,700.00 12,824,909,100	5.95
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	73,433	136,385.89 10,015,225,229	148,000.00 10,868,084,000	5.04
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	54,283	146,683.46 7,962,418,783	164,500.00 8,929,553,500	4.14
6	オリックス不動産投資	日本	投資証券	45,786	150,157.99 6,875,133,974	167,800.00 7,682,890,800	3.56
7	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	17,224	364,812.25 6,283,526,353	432,500.00 7,449,380,000	3.46
8	日本プロロジスリート	日本	投資証券	34,147	207,904.95 7,099,330,585	213,800.00 7,300,628,600	3.39
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	25,648	241,161.81 6,185,318,300	260,500.00 6,681,304,000	3.10
10	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	9,549	561,461.19 5,361,392,929	688,000.00 6,569,712,000	3.05
11	API投資法人	日本	投資証券	11,831	476,438.51 5,636,744,078	540,000.00 6,388,740,000	2.96
12	GLP投資法人	日本	投資証券	51,174	110,934.57 5,676,966,088	117,100.00 5,992,475,400	2.78
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	65,388	76,432.40 4,997,762,324	91,100.00 5,956,846,800	2.76
14	森トラスト総合リート	日本	投資証券	26,043	207,976.64 5,416,335,702	200,100.00 5,211,204,300	2.42
15	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	7,988	540,258.45 4,315,584,560	609,000.00 4,864,692,000	2.26



16	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	9,786	457,396.84 4,476,085,499	489,000.00 4,785,354,000	2.22
17	森ヒルズリート	日本	投資証券	30,976	133,983.67 4,150,278,458	152,100.00 4,711,449,600	2.19
18	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	63,009	66,515.92 4,191,102,055	73,400.00 4,624,860,600	2.15
19	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	17,362	208,504.20 3,620,049,968	239,600.00 4,159,935,200	1.93
20	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	9,559	389,461.95 3,722,866,782	431,000.00 4,119,929,000	1.91
21	産業ファンド	日本	投資証券	6,956	493,643.81 3,433,786,387	562,000.00 3,909,272,000	1.81
22	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	14,752	227,629.75 3,357,994,179	247,000.00 3,643,744,000	1.69
23	プレミア投資法人	日本	投資証券	25,983	110,841.27 2,879,988,950	134,500.00 3,494,713,500	1.62
24	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	24,947	125,693.60 3,135,678,381	133,900.00 3,340,403,300	1.55
25	大和ハウズリート	日本	投資証券	6,919	412,109.65 2,851,386,674	464,000.00 3,210,416,000	1.49
26	福岡リート投資法人	日本	投資証券	14,738	172,608.98 2,543,911,271	196,700.00 2,898,964,600	1.34
27	東急リアル・エステート	日本	投資証券	19,287	138,891.11 2,678,792,988	141,300.00 2,725,253,100	1.26
28	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	15,409	144,008.29 2,219,023,804	175,100.00 2,698,115,900	1.25
29	イオンリート投資	日本	投資証券	21,437	130,334.45 2,793,979,805	125,400.00 2,688,199,800	1.25
30	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	32,357	75,733.66 2,450,514,187	81,500.00 2,637,095,500	1.22

(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	98.65%
合計	98.65%

(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 2016年3月	買建	1,200	2,043,181,728	2,125,800,000	0.99%

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

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

#### ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

##### (1) 投資状況（平成28年1月29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	2,665,274,824	98.38
内 ガーンジー	1,850,569	0.07
内 マン島	1,888,615	0.07
内 香港	43,917,031	1.62
内 シンガポール	79,000,909	2.92
内 イスラエル	967,572	0.04
内 イギリス	168,672,583	6.23
内 アイルランド	6,726,264	0.25
内 オランダ	15,580,389	0.58
内 ベルギー	16,804,274	0.62
内 フランス	124,700,677	4.60
内 ドイツ	5,107,473	0.19
内 スペイン	13,533,745	0.50
内 イタリア	2,473,575	0.09
内 カナダ	46,283,010	1.71
内 アメリカ	1,907,320,395	70.41

	内 オーストラリア	217,651,927	8.03
	内 ニュージーランド	12,795,816	0.47
	コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	43,765,490	1.62
	純資産総額	2,709,040,314	100.00

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

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

## (2) 投資資産 (平成28年1月29日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	7,247	22,952.97 166,340,448	22,577.30 163,617,746	6.04
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	3,500	29,136.07 101,976,327	30,103.88 105,363,588	3.89
3	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	8,500	9,741.63 82,804,653	9,160.73 77,866,267	2.87
4	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	2,300	32,202.95 74,066,922	29,923.28 68,823,562	2.54
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	3,200	22,012.60 70,440,377	20,637.34 66,039,500	2.44
6	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	8,300	7,654.09 63,529,393	7,304.17 60,624,645	2.24
7	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	12,246	5,256.63 64,373,235	4,699.42 57,549,166	2.12
8	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	7,779	6,493.98 50,516,762	6,501.59 50,575,925	1.87
9	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	3,600	15,185.50 54,668,220	13,953.23 50,231,638	1.85
10	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	125,000	348.29 43,544,947	371.76 46,470,550	1.72
11	HCP INC	アメリカ	投資証券	10,900	4,326.90 47,163,643	4,230.45 46,111,905	1.70
12	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	13,677	3,133.67 42,859,692	3,331.17 45,560,511	1.68

13	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	4,164	11,769.95 49,010,392	10,508.43 43,757,135	1.62
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	1,567	28,298.68 44,344,134	25,476.97 39,922,425	1.47
15	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	5,817	6,054.25 35,218,316	6,632.13 38,579,140	1.42
16	WESTFIELD CORP	オーストラリア	投資証券	45,000	822.16 36,998,537	844.60 38,007,342	1.40
17	LINK REIT	香港	投資証券	53,000	730.50 38,717,276	672.35 35,635,001	1.32
18	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	18,800	2,133.86 40,117,100	1,851.99 34,817,448	1.29
19	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	3,400	8,733.22 29,693,166	9,605.53 32,658,832	1.21
20	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	2,900	10,148.72 29,431,482	10,798.52 31,315,725	1.16
21	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	9,700	3,186.85 30,913,107	3,195.80 30,999,287	1.14
22	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	24,000	1,443.40 34,644,725	1,252.30 30,055,381	1.11
23	MACERICH CO/THE	アメリカ	投資証券	3,200	9,590.06 30,688,289	9,189.74 29,407,188	1.09
24	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	1,600	17,866.27 28,586,118	17,868.21 28,589,139	1.06
25	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	17,500	2,001.60 35,028,464	1,594.27 27,899,818	1.03
26	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	2,300	14,339.77 32,981,519	11,291.67 25,970,853	0.96
27	UDR INC	アメリカ	投資証券	6,100	4,554.13 27,780,277	4,235.28 25,835,237	0.95
28	KLEPIERRE	フランス	投資証券	4,400	5,591.71 24,603,933	5,091.84 22,404,137	0.83
29	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	55,500	344.18 19,102,834	350.34 19,444,392	0.72
30	VEREIT INC	アメリカ	投資証券	21,208	1,003.82 21,290,889	916.19 19,430,655	0.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.38%
合計	98.38%

(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。

#### 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（平成28年1月29日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	9,712,937,390	67.78
内 日本	9,712,937,390	67.78
地方債証券	1,668,382,089	11.64
内 日本	1,668,382,089	11.64
特殊債券	1,237,789,100	8.64
内 日本	1,237,789,100	8.64
社債券	1,428,332,665	9.97
内 日本	1,428,332,665	9.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	282,283,111	1.97
純資産総額	14,329,724,355	100.00

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

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

#### (2) 投資資産（平成28年1月29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	171,000,000	100.30 171,528,150	100.78 172,349,190	0.100000 2020/09/20	1.20
2	333 10年国債	日本	国債証券	155,000,000	103.39 160,254,500	104.87 162,556,250	0.600000 2024/03/20	1.13
3	339 10年国債	日本	国債証券	154,000,000	101.11 155,716,550	103.12 158,807,880	0.400000 2025/06/20	1.11
4	340 10年国債	日本	国債証券	148,000,000	101.00 149,488,650	103.05 152,525,840	0.400000 2025/09/20	1.06
5	338 10年国債	日本	国債証券	145,000,000	101.27 146,841,500	103.17 149,609,550	0.400000 2025/03/20	1.04
6	332 10年国債	日本	国債証券	135,000,000	103.45 139,664,250	104.85 141,548,850	0.600000 2023/12/20	0.99
7	319 10年国債	日本	国債証券	129,000,000	106.26 137,085,720	106.93 137,950,020	1.100000 2021/12/20	0.96
8	335 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	102.41 133,142,100	104.09 135,317,000	0.500000 2024/09/20	0.94
9	116 5年国債	日本	国債証券	133,000,000	100.60 133,809,970	100.77 134,036,070	0.200000 2018/12/20	0.94
10	334 10年国債	日本	国債証券	125,000,000	103.31 129,147,100	104.89 131,118,750	0.600000 2024/06/20	0.92
11	19 - 1 広島県公債	日本	地方債証券	110,800,000	102.52 113,594,376	102.22 113,265,189	1.780000 2017/05/25	0.79
12	309 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	104.83 107,980,050	105.11 108,268,450	1.100000 2020/06/20	0.76
13	325 10年国債	日本	国債証券	102,000,000	104.86 106,966,380	105.72 107,838,480	0.800000 2022/09/20	0.75
14	308 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	105.74 105,744,000	105.99 105,993,000	1.300000 2020/06/20	0.74
15	21 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	105.79 105,796,200	105.94 105,944,900	1.570000 2019/11/25	0.74
16	21 - 35 兵庫県公債	日本	地方債証券	100,000,000	105.48 105,487,400	105.65 105,652,100	1.460000 2020/01/22	0.74
17	305 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	105.15 105,157,000	105.30 105,308,000	1.300000 2019/12/20	0.73

18	5	日本政策投資CO	日本	特殊債券	100,000,000	105.30 105,305,400	105.30 105,306,800	1.745000 2019/03/20	0.73
19	33	中日本高速道	日本	社債券	100,000,000	104.86 104,868,900	105.30 105,305,200	1.084000 2021/09/17	0.73
20	98	政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	104.98 104,989,100	105.21 105,215,500	1.300000 2020/01/31	0.73
21	70	東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	104.83 104,833,100	105.18 105,188,300	1.193000 2020/09/29	0.73
22	21 - 2	埼玉県公債	日本	地方債証券	100,000,000	105.15 105,154,000	105.18 105,185,400	1.570000 2019/05/27	0.73
23	116	共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	104.16 104,169,900	105.04 105,044,000	0.800000 2022/11/25	0.73
24	76	共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	104.74 104,749,700	104.85 104,856,600	1.400000 2019/07/25	0.73
25	24 - 16	愛知県公債	日本	地方債証券	100,000,000	103.84 103,849,000	104.84 104,844,800	0.757000 2023/01/31	0.73
26	117	共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	103.62 103,620,200	104.51 104,519,600	0.720000 2022/12/22	0.73
27	15	NTTドコモ	日本	社債券	100,000,000	104.72 104,729,200	104.42 104,428,000	1.960000 2018/06/20	0.73
28	122	政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	103.93 103,933,500	104.28 104,281,400	0.900000 2020/11/30	0.73
29	2	政保地方公営機	日本	特殊債券	100,000,000	104.54 104,543,800	104.27 104,271,700	1.600000 2018/11/16	0.73
30	190	政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	102.99 102,998,900	104.18 104,189,600	0.605000 2023/05/31	0.73

(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	67.78%
地方債証券	11.64%
特殊債券	8.64%
社債券	9.97%
合計	98.03%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（平成28年1月29日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	160,940,617,972	98.44
内 ユーロ	65,048,742,853	39.79
内 シンガポール	580,622,237	0.36
内 マレーシア	754,859,742	0.46
内 ノルウェー	452,426,837	0.28
内 スウェーデン	775,098,670	0.47
内 デンマーク	1,019,537,824	0.62
内 イギリス	13,092,502,569	8.01
内 スイス	464,151,695	0.28
内 ポーランド	872,389,024	0.53
内 カナダ	3,185,947,528	1.95
内 アメリカ	69,745,030,729	42.66
内 メキシコ	1,484,380,124	0.91
内 南アフリカ	633,104,128	0.39
内 オーストラリア	2,831,824,012	1.73
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,554,440,721	1.56
純資産総額	163,495,058,693	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）	1,027,716,768	0.63
内 日本	1,027,716,768	0.63

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

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



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

## (2) 投資資産（平成28年1月29日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,410,000	99.55 771,352,186	99.73 772,746,785	0.625000 2017/08/31	0.47
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,275,000	98.22 745,004,182	100.35 761,182,118	2.000000 2025/02/15	0.47
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,143,000	97.99 727,594,921	100.14 743,543,916	2.000000 2025/08/15	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,921,000	100.45 718,913,260	102.53 733,842,163	2.250000 2024/11/15	0.45
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,662,000	101.55 695,000,986	103.64 709,276,860	2.375000 2024/08/15	0.43
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,788,000	99.14 693,579,038	101.32 708,830,221	2.125000 2025/05/15	0.43
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,412,000	102.71 671,928,194	104.69 684,860,709	2.500000 2024/05/15	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,660,000	99.45 680,382,040	99.59 681,339,814	0.500000 2017/07/31	0.42
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,229,000	104.79 662,341,351	106.67 674,242,462	2.750000 2024/02/15	0.41
10	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証 券	3,118,000	153.70 633,407,014	152.36 627,901,277	6.000000 2031/05/01	0.38
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,974,000	99.53 598,411,765	99.70 599,445,842	0.625000 2017/09/30	0.37
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,397,000	130.13 584,268,592	129.90 583,258,384	4.250000 2023/10/25	0.36
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,635,000	103.35 579,028,248	102.95 576,798,523	3.250000 2017/03/31	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,509,000	104.42 569,097,405	105.57 575,403,087	2.625000 2020/11/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,468,000	103.21 557,425,877	105.11 567,681,373	2.500000 2023/08/15	0.35

16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,685,000	97.97 554,814,524	99.85 565,477,500	1.750000 2023/05/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,280,000	108.53 561,497,862	109.21 564,969,103	3.625000 2020/02/15	0.35
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,550,000	118.65 556,733,412	118.39 555,518,175	3.250000 2021/10/25	0.34
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,507,000	167.00 553,374,698	166.41 551,399,851	5.750000 2032/10/25	0.34
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,590,000	115.96 550,223,696	115.51 548,083,745	3.500000 2020/04/25	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,076,000	109.36 538,814,155	110.50 544,410,842	3.625000 2021/02/15	0.33
22	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,480,000	118.15 543,437,414	117.94 542,471,516	3.000000 2022/04/25	0.33
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,623,000	154.78 536,601,193	154.27 534,836,583	5.500000 2029/04/25	0.33
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,146,000	126.99 528,033,080	127.02 528,161,980	3.500000 2026/04/25	0.32
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,325,000	100.05 523,045,041	101.00 528,026,970	1.500000 2019/11/30	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,020,000	107.35 521,615,717	107.96 524,613,704	3.375000 2019/11/15	0.32
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,484,000	157.95 518,582,572	158.73 521,156,455	4.500000 2041/04/25	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	3,581,000	115.41 499,552,729	120.31 520,753,010	3.750000 2043/11/15	0.32
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	3,617,000	112.75 492,928,105	117.48 513,624,528	3.625000 2044/02/15	0.31
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,230,000	120.24 513,315,501	119.87 511,735,938	3.750000 2021/04/25	0.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.44%
合計	98.44%

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

#### 八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2016年2月	買建	191,000	16,533,037	16,433,640	0.01%
		ノルウェー・クローネ 買/円売 2016年2月	買建	307,000	4,214,039	4,301,070	0.00%
		スイス・フラン買/円売 2016年2月	買建	37,000	4,494,189	4,411,510	0.00%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2016年2月	買建	64,000	5,441,208	5,420,160	0.00%
		豪ドル買/円売 2016年2 月	買建	368,000	31,766,750	31,511,840	0.02%
		メキシコ・ペソ買/円売 2016年2月	買建	2,102,000	14,598,783	13,831,160	0.01%
		ポーランド・ズロチ買/ 円売 2016年2月	買建	277,000	8,429,137	8,204,740	0.01%
		デンマーク・クローネ 買/円売 2016年2月	買建	527,000	9,252,723	9,333,169	0.01%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2016年2月	買建	505,000	7,208,168	7,176,050	0.00%
		米ドル買/円売 2016年2 月	買建	3,014,000	362,388,290	364,241,900	0.22%
		ユーロ買/円売 2016年2 月	買建	3,709,000	486,888,554	490,218,530	0.30%
		英ポンド買/円売 2016年 2月	買建	384,000	68,515,695	66,643,200	0.04%
南アフリカ・ランド買/ 円売 2016年2月	買建	804,000	6,240,208	5,989,799	0.00%		

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## (参考情報)運用実績

2016年1月29日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,096円
純資産総額	21百万円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-5.6%
3カ月間	-6.2%
6カ月間	-9.7%
1年間	-1.2%
3年間	50.7%
5年間	76.5%
設定来	31.0%



※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			
	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			
分配金	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を分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
国内株式・先物	1,401	42.7%	日本円	58.9%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.8%
外国株式・先物	1,237	25.8%	米ドル	25.3%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.0%
国内リート・先物	53	8.2%	ユーロ	7.0%	修正デュレーション	TOPIX先物 2803月	日本	0.9%
外国債券	724	7.7%	英ポンド	3.2%	残存年数	日本電信電話	日本	0.8%
国内債券	265	7.5%	豪ドル	1.4%	債券格付別構成	三井住友フィナンシャルG	日本	0.6%
外国リート	320	7.4%	カナダ・ドル	1.2%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.7%
			スイス・フラン	1.1%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.6%
			香港ドル	0.4%	A	日本リートファンド	日本	0.5%
			スウェーデン・クローネ	0.4%	BBB	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.5%
コール・ローン、その他		2.0%	その他	1.0%	BB以下・無格付	野村不動産マスターF	日本	0.4%
合計	4,000	-	合計	100.0%	合計	合計		7.7%

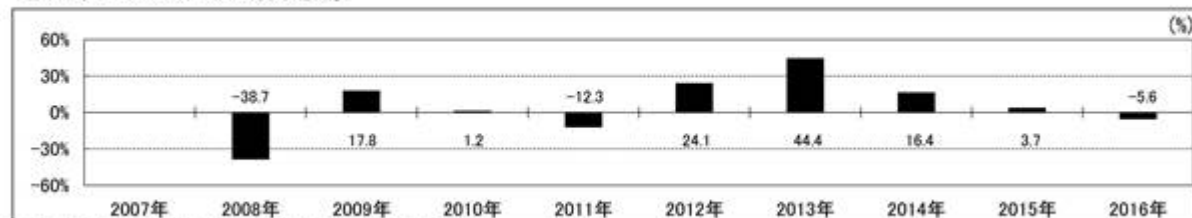
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.8%保有しております。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2008年は設定日(2月28日)から年末、2016年は1月29日までの騰落率を表しています。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

### 2 【換金(解約)手続等】

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

#### <一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

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

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

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

##### （注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

##### （注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

### 3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

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

#### (4) 【計算期間】

毎年12月19日から翌年12月18日までとします。ただし、第1計算期間は、平成20年2月28日から平成20年12月18日までとします。

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

#### (5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、あるいは、第34計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約

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

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

#### 信託約款の変更等

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



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

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎計算期末に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2. の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

#### 公告

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金にかかる請求権

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

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

#### 償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとしします。

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間（平成26年12月19日から平成27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】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 平成26年12月18日現在	第8期 平成27年12月18日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	76,868	114,237
親投資信託受益証券	13,802,071	22,230,158
未収入金	25,000	-
流動資産合計	13,903,939	22,344,395
資産合計	13,903,939	22,344,395
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	28,472	-
未払受託者報酬	3,291	5,595
未払委託者報酬	39,986	67,538
その他未払費用	399	718
流動負債合計	72,148	73,851
負債合計	72,148	73,851
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,662,947	16,118,592
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,168,844	6,151,952
（分配準備積立金）	3,994,121	4,492,750
元本等合計	13,831,791	22,270,544
純資産合計	13,831,791	22,270,544
負債純資産合計	13,903,939	22,344,395

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 至	平成25年12月19日 平成26年12月18日	自 至	平成26年12月19日 平成27年12月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,034,755		958,087
営業収益合計		2,034,755		958,087
営業費用				
受託者報酬		5,922		9,768
委託者報酬		72,019		118,090
その他費用		765		1,264
営業費用合計		78,706		129,122
営業利益		1,956,049		828,965
経常利益		1,956,049		828,965
当期純利益		1,956,049		828,965
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		14,323		38,178
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		886,243		3,168,844
剰余金増加額又は欠損金減少額		387,228		2,472,709
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		387,228		2,472,709
剰余金減少額又は欠損金増加額		46,353		280,388
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		46,353		280,388
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,168,844		6,151,952

## (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8期	
	自 平成26年12月19日	至 平成27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7期	第8期
	平成26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1. 1 期首元本額	8,850,418円	10,662,947円
期中追加設定元本額	2,261,839円	6,366,392円
期中一部解約元本額	449,310円	910,747円
2. 計算期間末日における受益権の総数	10,662,947口	16,118,592口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第7期	第8期
	自 平成25年12月19日 至 平成26年12月18日	自 平成26年12月19日 至 平成27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(1,941,726円)、投資信託約款に規定される収益調整金(706,144円)及び分配準備積立金(2,052,395円)より分配可能額は4,700,265円(1万口当たり4,408.04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(790,787円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,403,170円)及び分配準備積立金(3,701,963円)より分配可能額は7,895,920円(1万口当たり4,898.64円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。</p>
-------------------	--	--

## (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8期 自 平成26年12月19日 至 平成27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8期 平成27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 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7期 平成26年12月18日現在	第8期 平成27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	1,996,370	872,349
合計	1,996,370	872,349

## （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7期 平成26年12月18日現在	第8期 平成27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8期 自 平成26年12月19日 至 平成27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7期 平成26年12月18日現在	第8期 平成27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)	1.2972円 (12,972円)	1.3817円 (13,817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	10,070,697	9,216,701	
	外国株式インデックスマザーファンド	2,985,761	5,966,446	
	外国債券インデックスマザーファンド	637,363	1,821,902	
	ダイワJ-REITマザーファンド	783,940	1,800,396	
	ダイワ・グローバルREITインデッ クス・マザーファンド	735,980	1,593,691	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	1,488,031	1,831,022	
親投資信託受益証券 合計			22,230,158	
合計			22,230,158	

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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		7,421,236,884	4,084,477,555
株式	3 4	123,389,464,940	127,617,012,620
派生商品評価勘定		483,644	190,217
未収入金		478,864,804	-
未収配当金		9,381,600	9,982,175
前払金		9,622,000	-
その他未収収益	5	1,697,749	1,669,870
流動資産合計		131,310,751,621	131,713,332,437
資産合計		131,310,751,621	131,713,332,437
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,904,890	15,719,729
前受金		-	6,987,000
未払解約金		305,769,000	47,678,000
未払利息		98,998	40,250
受入担保金		6,857,039,962	2,848,614,825
流動負債合計		7,165,812,850	2,919,039,804
負債合計		7,165,812,850	2,919,039,804
純資産の部			
元本等			
元本	1	154,467,311,877	140,729,416,146
剰余金			

期末剰余金又は期末欠損金( ) 2	30,322,373,106	11,935,123,513
元本等合計	124,144,938,771	128,794,292,633
純資産合計	124,144,938,771	128,794,292,633
負債純資産合計	131,310,751,621	131,713,332,437

## 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26年12月19日 至 平成27年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1. 1期首	平成25年12月19日	平成26年12月19日
期首元本額	171,609,857,377円	154,467,311,877円
期中追加設定元本額	13,187,877,997円	12,290,042,957円
期中一部解約元本額	30,330,423,497円	26,027,938,688円
期末元本額の内訳		

ファンド名		
適格機関投資家専用投信1号	1,649,409,274円	1,616,982,752円
トピックス・インデックス ファンド	6,799,224,936円	5,766,841,215円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	20,401,008,490円	16,565,398,041円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドVA2	274,800,617円	135,236,221円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	249,489,300円	194,101,497円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	4,326,565,713円	2,983,968,923円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	199,440,727円	120,484,753円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	5,935,437,422円	4,114,870,417円
D-I's TOPIXイン デックス	35,691,598円	33,518,296円
DCダイワ日本株式インデッ クス	60,845,884,388円	61,188,349,174円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,942,655,572円	1,968,640,569円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,042,621,516円	2,029,305,717円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,761,462,103円	1,919,810,266円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,006,891,356円	3,488,114,265円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	23,270,973円	23,279,953円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	43,530,576円	51,309,148円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	7,351,546円	10,070,697円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	22,104,793円	917,794円

ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	73,545,755円	2,605,355円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	46,472,829円	6,008,229円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	71,973,936円	60,710,979円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	418,068,986円	361,268,786円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	209,986,836円	181,226,317円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	2,200,146,307円	1,559,037,954円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	324,009,634円	233,075,123円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	20,172,386,365円	15,409,272,548円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	544,222,851円	406,342,605円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	1,167,273,856円	687,963,617円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,582,483,719円	1,232,853,418円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	315,436,365円	197,835,528円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	371,813,191円	308,115,317円
ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	412,144,225円	700,656,296円
ダイワライフスタイル25	183,464,107円	189,426,696円
ダイワライフスタイル50	604,648,931円	597,732,716円
ダイワライフスタイル75	468,534,417円	467,121,755円
DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)	15,733,858,667円	15,916,963,209円
計	154,467,311,877円	140,729,416,146円
2. 期末日における受益権の総数	154,467,311,877口	140,729,416,146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30,322,373,106円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は11,935,123,513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 6,633,741,300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 2,711,570,200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 725,000,000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 765,800,000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1,069,300円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分1,258,350円が含まれております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成26年12月19日 至 平成27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27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 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26年12月18日現在	平成27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	4,140,446,818	8,992,469,109
合計	4,140,446,818	8,992,469,109

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成26年9月20日から平成26年12月18日まで、及び平成27年9月25日から平成27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26年12月18日 現在			平成27年12月18日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
	うち			うち		

		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	887,272,000	-	885,120,000	2,152,000	1,241,953,000	-	1,226,800,000	15,153,000
合計	887,272,000	-	885,120,000	2,152,000	1,241,953,000	-	1,226,800,000	15,153,000

## (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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1口当たり純資産額	0.8037円	0.9152円
(1万口当たり純資産額)	(8,037円)	(9,152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	35,000	262.00	9,170,000	
日本水産	76,200	470.00	35,814,000	
マルハニチロ	14,000	1,999.00	27,986,000	
サカタのタネ	10,700	2,703.00	28,922,100	
ホクト	7,000	2,361.00	16,527,000	
ショーボンドHD	6,300	4,430.00	27,909,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
ミライト・ホールディングス	20,400	987.00	20,134,800	
日鉄鉱業	19,000	543.00	10,317,000	
三井松島	52,000	134.00	6,968,000	
国際石油開発帝石	332,200	1,141.00	379,040,200	



日本海洋掘削	2,500	2,655.00	6,637,500	貸付株式数 700株 (700株)
石油資源開発	10,100	3,175.00	32,067,500	
K & O エナジーグループ	5,100	1,719.00	8,766,900	
安藤・間	42,800	689.00	29,489,200	
東急建設	20,800	916.00	19,052,800	
コムシスホールディングス	28,600	1,712.00	48,963,200	
ミサワホーム	8,600	874.00	7,516,400	
高松コンストラクションG P	5,300	2,596.00	13,758,800	
東建コーポレーション	2,500	9,230.00	23,075,000	貸付株式数 700株
大成建設	326,000	797.00	259,822,000	
大林組	190,000	1,153.00	219,070,000	
清水建設	194,000	1,036.00	200,984,000	
飛島建設	44,700	199.00	8,895,300	貸付株式数 13,200株 (13,200株)
長谷工コーポレーション	74,100	1,360.00	100,776,000	
松井建設	10,300	753.00	7,755,900	
銭高組	10,000	557.00	5,570,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
鹿島建設	297,000	726.00	215,622,000	
不動テトラ	49,500	143.00	7,078,500	貸付株式数 14,700株
鉄建建設	41,000	290.00	11,890,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
西松建設	72,000	462.00	33,264,000	
三井住友建設	247,500	115.00	28,462,500	貸付株式数 75,200株
大豊建設	25,000	601.00	15,025,000	貸付株式数 6,000株
前田建設	40,000	790.00	31,600,000	
ナカノフドー建設	6,500	755.00	4,907,500	
奥村組	61,000	675.00	41,175,000	
東鉄工業	8,000	2,860.00	22,880,000	
浅沼組	23,000	312.00	7,176,000	
戸田建設	75,000	670.00	50,250,000	
熊谷組	92,000	332.00	30,544,000	
北野建設	20,000	322.00	6,440,000	
三井ホーム	13,000	559.00	7,267,000	
矢作建設	9,500	816.00	7,752,000	
ピーエス三菱	12,800	391.00	5,004,800	
日本ハウスH L D G S	14,300	456.00	6,520,800	貸付株式数 3,900株 (800株)
大東建託	23,300	13,875.00	323,287,500	

新日本建設	9,900	678.00	6,712,200	
N I P P O	15,000	2,023.00	30,345,000	
東亜道路	14,000	440.00	6,160,000	
前田道路	20,000	2,118.00	42,360,000	
日本道路	20,000	612.00	12,240,000	
東亜建設	58,000	321.00	18,618,000	
若築建設	44,000	144.00	6,336,000	貸付株式数 12,000株
東洋建設	20,700	527.00	10,908,900	
五洋建設	70,900	502.00	35,591,800	
大林道路	8,000	839.00	6,712,000	
世紀東急	11,300	642.00	7,254,600	
福 田 組	11,000	1,336.00	14,696,000	
住友林業	44,000	1,606.00	70,664,000	
日本基礎技術	9,000	508.00	4,572,000	
日成ビルド工業	20,000	375.00	7,500,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
パナホーム	25,000	904.00	22,600,000	
大和ハウス	187,000	3,368.00	629,816,000	
ライト工業	12,700	1,115.00	14,160,500	
積水ハウス	210,900	1,965.50	414,523,950	
日特建設	8,500	490.00	4,165,000	貸付株式数 3,000株
ユアテック	11,000	1,139.00	12,529,000	
中電工	9,500	2,668.00	25,346,000	
関 電 工	25,000	823.00	20,575,000	
きんでん	38,000	1,584.00	60,192,000	
東京エネシス	8,000	1,001.00	8,008,000	
トーエネック	10,000	846.00	8,460,000	
住友電設	5,800	1,530.00	8,874,000	
日本電設工業	10,700	2,558.00	27,370,600	
協和エクシオ	25,100	1,225.00	30,747,500	
日本工営	23,000	440.00	10,120,000	
九電工	12,000	2,183.00	26,196,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
三機工業	15,700	1,011.00	15,872,700	
日 揮	63,000	1,862.00	117,306,000	
中外炉工業	28,000	233.00	6,524,000	
太平電業	9,000	1,203.00	10,827,000	
高砂熱学	19,200	1,763.00	33,849,600	
N E C ネットエスアイ	7,200	2,171.00	15,631,200	
明星工業	13,800	510.00	7,038,000	

大 気 社	7,900	2,937.00	23,202,300	
ダイダン	10,000	854.00	8,540,000	
日比谷総合設備	8,700	1,628.00	14,163,600	
東芝プラントシステム	9,800	1,265.00	12,397,000	
日本製粉	43,000	867.00	37,281,000	
日清製粉G本社	69,500	1,962.00	136,359,000	
昭和産業	29,000	446.00	12,934,000	
中部飼料	7,300	1,001.00	7,307,300	
フィード・ワン	47,200	135.00	6,372,000	
日本甜菜糖	49,000	201.00	9,849,000	
三井製糖	27,000	554.00	14,958,000	
ネクスト	17,700	1,452.00	25,700,400	
日本M&Aセンター	9,300	5,600.00	52,080,000	
アコーディア・ゴルフ	16,300	1,157.00	18,859,100	
タケエイ	5,900	1,029.00	6,071,100	貸付株式数 1,600株
パソナグループ	5,800	883.00	5,121,400	貸付株式数 500株
G C A サヴィアン	5,900	1,208.00	7,127,200	
エス・エム・エス	7,800	2,367.00	18,462,600	
テンプホールディングス	41,500	1,865.00	77,397,500	
クックパッド	13,400	2,696.00	36,126,400	
森永製菓	59,000	646.00	38,114,000	
中 村 屋	23,000	470.00	10,810,000	
江崎グリコ	14,500	6,470.00	93,815,000	
不 二 家	51,000	203.00	10,353,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
山崎製パン	46,000	2,520.00	115,920,000	
第一屋製パン	44,000	122.00	5,368,000	
モロゾフ	21,000	433.00	9,093,000	
亀田製菓	3,900	4,705.00	18,349,500	
寿スピリッツ	1,900	5,060.00	9,614,000	
カルビー	23,300	4,955.00	115,451,500	
森永乳業	59,000	563.00	33,217,000	
六甲バター	3,800	1,803.00	6,851,400	
ヤクルト	33,700	5,960.00	200,852,000	
明治ホールディングス	37,400	9,970.00	372,878,000	
雪印メグミルク	15,200	3,165.00	48,108,000	
プリマハム	44,000	324.00	14,256,000	
日本ハム	46,000	2,309.00	106,214,000	
伊藤ハム	32,000	641.00	20,512,000	
丸大食品	37,000	467.00	17,279,000	

米 久	2,700	2,303.00	6,218,100	
S Foods	4,600	2,104.00	9,678,400	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
スタジオアリス	3,500	2,171.00	7,598,500	
シミックホールディングス	3,400	1,583.00	5,382,200	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
システナ	7,400	1,344.00	9,945,600	
デジタルアーツ	3,300	2,145.00	7,078,500	
新日鉄住金SOL	4,800	5,650.00	27,120,000	
総合警備保障	19,700	5,690.00	112,093,000	貸付株式数 5,500株
日本駐車場開発	69,200	141.00	9,757,200	貸付株式数 19,500株 (1,800株)
カカクコム	42,900	2,402.00	103,045,800	
ディップ	6,800	2,707.00	18,407,600	貸付株式数 300株 (100株)
SBSホールディングス	6,100	958.00	5,843,800	
ツクイ	7,700	1,344.00	10,348,800	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
エムスリー	51,000	2,627.00	133,977,000	貸付株式数 14,400株 (14,400株)
ツカダ・グローバルHOLD	6,100	805.00	4,910,500	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
アウトソーシング	3,100	3,235.00	10,028,500	貸付株式数 800株
ウェルネット	2,800	2,874.00	8,047,200	
ディー・エヌ・エー	26,700	1,911.00	51,023,700	
博報堂DYHLDGS	81,700	1,326.00	108,334,200	
ぐるなび	7,200	2,650.00	19,080,000	
一休	4,600	3,415.00	15,709,000	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
ファンコミュニケーションズ	14,900	773.00	11,517,700	貸付株式数 4,100株
サッポロホールディングス	98,000	545.00	53,410,000	
アサヒグループホールディン	117,300	3,867.00	453,599,100	
麒麟HD	256,400	1,718.00	440,495,200	
宝ホールディングス	47,500	936.00	44,460,000	
オエノンホールディングス	36,000	236.00	8,496,000	
コカ・コーラウエスト	21,500	2,572.00	55,298,000	
コカ・コーライーストジャパ ン	22,300	1,934.00	43,128,200	
サントリー食品インター	42,800	5,350.00	228,980,000	
ダイドードリンコ	3,400	5,630.00	19,142,000	

伊藤園	18,900	2,943.00	55,622,700	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
キーコーヒー	6,700	1,911.00	12,803,700	
日清オイリオグループ	36,000	476.00	17,136,000	
不二製油グループ	17,100	1,849.00	31,617,900	
J-オイルミルズ	32,000	346.00	11,072,000	
ローソン	20,700	9,680.00	200,376,000	
サンエー	4,000	5,280.00	21,120,000	
カワチ薬品	4,800	2,425.00	11,640,000	
エービーシー・マート	6,800	6,520.00	44,336,000	
ハードオフコーポレーション	3,800	1,539.00	5,848,200	
アスクル	5,800	4,790.00	27,782,000	貸付株式数 1,500株
ゲオホールディングス	11,000	2,021.00	22,231,000	貸付株式数 3,000株 (900株)
アダストリア	5,200	5,910.00	30,732,000	
くらコーポレーション	3,600	4,860.00	17,496,000	
キャンドゥ	4,600	1,571.00	7,226,600	貸付株式数 1,300株 (100株)
パル	3,600	2,901.00	10,443,600	
JALUX	2,300	2,666.00	6,131,800	
エディオン	23,300	915.00	21,319,500	貸付株式数 8,800株
あらた	2,700	2,831.00	7,643,700	
J Pホールディングス	19,100	348.00	6,646,800	貸付株式数 6,100株 (2,000株)
あみやき亭	1,500	4,790.00	7,185,000	
ひらまつ	9,200	732.00	6,734,400	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
フィールズ	4,200	2,189.00	9,193,800	
双日	355,800	261.00	92,863,800	
ゲンキー	1,300	3,940.00	5,122,000	貸付株式数 300株
アルフレッサホールディングス	69,800	2,384.00	166,403,200	
ハニーズ	6,700	1,006.00	6,740,200	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
キッコーマン	48,000	4,125.00	198,000,000	
味の素	134,000	2,736.00	366,624,000	
キューピー	31,900	2,959.00	94,392,100	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ハウス食品G本社	21,200	2,346.00	49,735,200	

カゴメ	22,500	2,109.00	47,452,500	貸付株式数 7,500株 (7,500株)
アリアケジャパン	5,400	6,660.00	35,964,000	
ニチレイ	69,000	838.00	57,822,000	
横浜冷凍	15,200	1,051.00	15,975,200	貸付株式数 4,300株
東洋水産	30,500	4,175.00	127,337,500	
日清食品HD	26,000	6,360.00	165,360,000	
永谷園ホールディングス	8,000	1,061.00	8,488,000	
フジッコ	6,900	2,150.00	14,835,000	貸付株式数 1,900株
ロックフィールド	4,200	3,005.00	12,621,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
日本たばこ産業	372,800	4,488.00	1,673,126,400	
わらべや日洋	4,100	2,206.00	9,044,600	
ユーグレナ	21,300	1,821.00	38,787,300	貸付株式数 5,900株 (5,200株)
片倉工業	8,800	1,312.00	11,545,600	
グンゼ	51,000	356.00	18,156,000	
ヒューリック	115,900	1,077.00	124,824,300	
アルペン	5,500	2,027.00	11,148,500	貸付株式数 1,500株
クオール	6,200	1,693.00	10,496,600	
アルコニックス	4,900	1,557.00	7,629,300	
神戸物産	3,700	4,165.00	15,410,500	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
ジェイアイエヌ	4,000	4,400.00	17,600,000	貸付株式数 1,000株
ビックカメラ	29,000	999.00	28,971,000	
DCMホールディングス	27,900	798.00	22,264,200	
Monotaro	19,700	3,525.00	69,442,500	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
あいホールディングス	9,200	3,220.00	29,624,000	
アークランドサービス	1,200	5,650.00	6,780,000	貸付株式数 300株 (300株)
J.フロントリテイリング	71,200	1,816.00	129,299,200	
ドトール・日レスHD	10,200	1,830.00	18,666,000	
マツモトキヨシHLDGS	11,500	6,250.00	71,875,000	
ブロンコビリー	2,700	2,432.00	6,566,400	貸付株式数 300株
スタートトゥデイ	17,300	4,035.00	69,805,500	
物語コーポレーション	1,900	5,800.00	11,020,000	
ココカラファイン	6,000	5,180.00	31,080,000	
三越伊勢丹HD	111,200	1,618.00	179,921,600	

東洋紡	240,000	168.00	40,320,000	
ユニチカ	197,000	59.00	11,623,000	
富士紡ホールディングス	37,000	217.00	8,029,000	
日清紡ホールディングス	32,100	1,298.00	41,665,800	
倉敷紡績	66,000	206.00	13,596,000	
ダイワボウHD	56,000	244.00	13,664,000	
シキボウ	48,000	120.00	5,760,000	
日東紡績	43,000	325.00	13,975,000	
トヨタ紡織	19,800	2,555.00	50,589,000	
マクニカ・富士エレHLDGS	10,300	1,563.00	16,098,900	
ウエルシアHD	4,900	6,650.00	32,585,000	
クリエイトSDH	8,700	2,840.00	24,708,000	
バイタルKSKHD	10,600	974.00	10,324,400	
UKCホールディングス	3,900	2,807.00	10,947,300	
TOKAIホールディングス	29,300	542.00	15,880,600	
三洋貿易	5,200	1,411.00	7,337,200	
チムニー	1,700	3,195.00	5,431,500	貸付株式数 400株
ジョイフル本田	8,500	2,457.00	20,884,500	貸付株式数 1,800株
すかいらく	17,000	1,610.00	27,370,000	貸付株式数 5,100株
日本毛織	20,000	891.00	17,820,000	
ダイドーリミテッド	14,700	496.00	7,291,200	
ユナイテッド・スーパーマーケ	19,200	1,010.00	19,392,000	
野村不動産HLDGS	36,400	2,326.00	84,666,400	
三重交通グループHD	12,700	460.00	5,842,000	
プレサンスコーポレーション	2,000	3,975.00	7,950,000	
ユニゾホールディングス	3,600	4,650.00	16,740,000	
日本管理センター	4,400	1,440.00	6,336,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
オープンハウス	8,400	2,336.00	19,622,400	
東急不動産HD	135,200	766.00	103,563,200	
飯田GHD	51,600	2,305.00	118,938,000	
帝国繊維	7,000	1,636.00	11,452,000	
日本コークス工業	64,200	102.00	6,548,400	
あさひ	5,100	1,349.00	6,879,900	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
日本調剤	1,600	4,745.00	7,592,000	貸付株式数 400株
コスモス薬品	2,800	18,690.00	52,332,000	貸付株式数 800株 (800株)

シップヘルスケアHD	11,500	2,843.00	32,694,500	
セブン&アイ・HLDGS	232,300	5,454.00	1,266,964,200	
クリエイト・レストランツ・ホール	5,200	3,335.00	17,342,000	
ツルハホールディングス	11,900	10,470.00	124,593,000	
サンマルクホールディングス	4,800	3,355.00	16,104,000	
トリドール	7,200	2,131.00	15,343,200	
クスリのアオキ	4,500	6,050.00	27,225,000	
帝人	244,000	411.00	100,284,000	
東レ	427,000	1,093.00	466,711,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
クラレ	92,500	1,516.00	140,230,000	
旭化成	368,000	775.50	285,384,000	
サカイオーベックス	28,000	235.00	6,580,000	
稲葉製作所	4,500	1,280.00	5,760,000	
宮地エンジニアリングG	24,000	193.00	4,632,000	
トーカロ	4,800	2,507.00	12,033,600	
SUMCO	47,000	988.00	46,436,000	貸付株式数 13,000株 (13,000株)
川田テクノロジーズ	1,400	3,850.00	5,390,000	
住江織物	20,000	349.00	6,980,000	
芦森工業	25,000	199.00	4,975,000	
アツギ	89,000	117.00	10,413,000	
共和レザー	5,200	935.00	4,862,000	
セーレン	15,500	1,364.00	21,142,000	
小松精練	13,200	684.00	9,028,800	
ワコールホールディングス	35,000	1,437.00	50,295,000	
ホギメディカル	3,800	6,100.00	23,180,000	
T S Iホールディングス	27,400	829.00	22,714,600	
I Tホールディングス	18,700	2,906.00	54,342,200	
電算システム	2,600	2,012.00	5,231,200	貸付株式数 700株 (700株)
グリー	35,100	581.00	20,393,100	貸付株式数 9,700株
コーエーテクモHD	13,800	1,799.00	24,826,200	
三菱総合研究所	2,900	3,290.00	9,541,000	
K L a b	9,000	842.00	7,578,000	貸付株式数 2,600株 (400株)
ポルトゥウィン・ピットクル	4,800	1,128.00	5,414,400	貸付株式数 1,000株
ネクソン	53,400	1,998.00	106,693,200	



アイスタイル	5,300	2,250.00	11,925,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
エイチーム	2,400	1,838.00	4,411,200	貸付株式数 700株 (700株)
コロプラ	15,300	2,553.00	39,060,900	貸付株式数 4,400株 (500株)
ブロードリーフ	6,600	1,158.00	7,642,800	
特種東海製紙	37,000	365.00	13,505,000	
ティーガイア	6,200	1,304.00	8,084,800	
ガンホー・オンライン・エンター	98,300	352.00	34,601,600	貸付株式数 27,500株
GMOペイメントゲートウェイ	5,000	5,850.00	29,250,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
インターネットイニシアティブ	9,600	2,374.00	22,790,400	貸付株式数 200株 (200株)
SRAホールディングス	4,100	2,876.00	11,791,600	
朝日ネット	15,000	523.00	7,845,000	
王子ホールディングス	241,000	483.00	116,403,000	
日本製紙	30,200	1,853.00	55,960,600	
三菱製紙	103,000	83.00	8,549,000	
北越紀州製紙	38,600	716.00	27,637,600	
中越パルプ	29,000	203.00	5,887,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
大王製紙	26,600	1,011.00	26,892,600	貸付株式数 7,500株 (500株)
gumi	6,400	831.00	5,318,400	貸付株式数 1,800株 (200株)
レンゴー	47,000	496.00	23,312,000	
トーモク	23,000	278.00	6,394,000	
ザ・パックス	4,700	3,190.00	14,993,000	
昭和電工	392,000	146.00	57,232,000	
住友化学	436,000	679.00	296,044,000	
住友精化	13,000	741.00	9,633,000	
日産化学	35,500	2,812.00	99,826,000	
ラサ工業	36,000	137.00	4,932,000	
クレハ	44,000	455.00	20,020,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
テイカ	14,000	603.00	8,442,000	
石原産業	111,000	100.00	11,100,000	
日東エフシー	5,800	881.00	5,109,800	
日本曹達	40,000	705.00	28,200,000	

東ソー	159,000	622.00	98,898,000	
トクヤマ	106,000	271.00	28,726,000	貸付株式数 28,000株 (28,000株)
セントラル硝子	64,000	559.00	35,776,000	
東亜合成	37,200	1,026.00	38,167,200	
大阪ソーダ	28,000	449.00	12,572,000	貸付株式数 7,000株
関東電化	15,000	793.00	11,895,000	
デンカ	125,000	525.00	65,625,000	
イビデン	37,000	1,741.00	64,417,000	貸付株式数 10,200株 (10,200株)
信越化学	105,500	6,618.00	698,199,000	
日本カ - バイド	28,000	174.00	4,872,000	
堺 化 学	28,000	418.00	11,704,000	
エア・ウォーター	48,000	1,891.00	90,768,000	
大陽日酸	45,900	1,066.00	48,929,400	
日本化学工業	25,000	279.00	6,975,000	
日本パ - カライジング	30,600	1,237.00	37,852,200	
高压ガス	12,000	669.00	8,028,000	
四国化成	10,000	1,182.00	11,820,000	
ステラ ケミファ	4,900	1,795.00	8,795,500	
保土谷化学	34,000	233.00	7,922,000	貸付株式数 4,000株
日本触媒	8,500	8,920.00	75,820,000	
大日精化	24,000	550.00	13,200,000	
カネカ	80,000	1,233.00	98,640,000	
協和発酵キリン	71,000	2,147.00	152,437,000	
三菱瓦斯化学	100,000	592.00	59,200,000	
三井化学	252,000	523.00	131,796,000	
J S R	56,800	1,829.00	103,887,200	
東京応化工業	12,000	3,780.00	45,360,000	
三菱ケミカルH L D G S	396,700	764.40	303,237,480	
日本合成化学	14,000	870.00	12,180,000	
ダイセル	81,900	1,789.00	146,519,100	
住友ベ - クライト	55,000	498.00	27,390,000	
積水化学	136,000	1,556.00	211,616,000	
日本ゼオン	51,000	952.00	48,552,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
アイカ工業	17,800	2,409.00	42,880,200	
宇部興産	317,000	250.00	79,250,000	貸付株式数 88,000株 (88,000株)
積水樹脂	10,200	1,635.00	16,677,000	

タキロン	17,000	609.00	10,353,000	
旭有機材	32,000	225.00	7,200,000	
日立化成	29,200	1,928.00	56,297,600	
ニチバン	9,000	613.00	5,517,000	
リケンテクノス	13,500	421.00	5,683,500	貸付株式数 3,700株
大倉工業	20,000	357.00	7,140,000	
積水化成品	18,000	410.00	7,380,000	
群栄化学	20,000	307.00	6,140,000	
ダイキョーニシカワ	1,900	8,840.00	16,796,000	
日本化薬	38,000	1,338.00	50,844,000	
カーリットホールディングス	10,200	516.00	5,263,200	
E P Sホールディングス	6,800	1,336.00	9,084,800	
プレステージ・インター	6,200	1,185.00	7,347,000	
アミューズ	1,800	5,890.00	10,602,000	
野村総合研究所	39,000	4,625.00	180,375,000	
ドリームインキュベータ	2,800	2,337.00	6,543,600	貸付株式数 500株
ケネディクス	79,700	460.00	36,662,000	貸付株式数 24,300株
電通	65,700	6,760.00	444,132,000	貸付株式数 18,500株 (18,500株)
インテージホールディングス	4,000	1,715.00	6,860,000	
イオンファンタジー	2,800	2,037.00	5,703,600	貸付株式数 700株 (700株)
メディカルシステムネット ワーク	7,600	660.00	5,016,000	
日本精化	7,900	906.00	7,157,400	
A D E K A	29,100	1,707.00	49,673,700	
日油	45,000	933.00	41,985,000	
ミヨシ油脂	38,000	140.00	5,320,000	
花 王	158,500	6,038.00	957,023,000	
第一工業製薬	18,000	351.00	6,318,000	貸付株式数 4,000株
三洋化成	20,000	987.00	19,740,000	
武田薬品	234,700	5,981.00	1,403,740,700	
アステラス製薬	659,900	1,701.00	1,122,489,900	
大日本住友製薬	42,500	1,464.00	62,220,000	貸付株式数 12,200株
塩野義製薬	86,100	5,402.00	465,112,200	
田辺三菱製薬	67,600	2,087.00	141,081,200	貸付株式数 17,200株
あすか製薬	8,500	1,531.00	13,013,500	
日本新薬	14,000	4,890.00	68,460,000	
中外製薬	58,500	4,455.00	260,617,500	
科研製薬	10,200	8,420.00	85,884,000	

エーザイ	72,600	8,077.00	586,390,200	
ロート製薬	28,900	2,355.00	68,059,500	
小野薬品	26,800	21,525.00	576,870,000	
久光製薬	18,400	5,060.00	93,104,000	
持田製薬	4,200	8,280.00	34,776,000	
参天製薬	108,200	1,997.00	216,075,400	
扶桑薬品	28,000	289.00	8,092,000	
日本ケミファ	11,000	632.00	6,952,000	
ツムラ	18,600	3,455.00	64,263,000	貸付株式数 5,200株
日医工	13,900	2,944.00	40,921,600	
テルモ	86,400	3,940.00	340,416,000	
みらかホールディングス	15,000	5,350.00	80,250,000	
キッセイ薬品工業	10,700	2,976.00	31,843,200	
生化学工業	12,000	1,706.00	20,472,000	
栄研化学	5,700	2,185.00	12,454,500	
鳥居薬品	4,700	2,718.00	12,774,600	
JCRファーマ	5,000	2,734.00	13,670,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
東和薬品	2,800	7,540.00	21,112,000	
富士製薬工業	2,500	2,185.00	5,462,500	
沢井製薬	9,900	8,300.00	82,170,000	
ゼリア新薬工業	12,800	1,590.00	20,352,000	
第一三共	198,900	2,528.50	502,918,650	
キョーリン製薬HD	16,100	2,590.00	41,699,000	
大幸薬品	3,400	1,705.00	5,797,000	貸付株式数 800株 (800株)
ダイト	3,100	3,250.00	10,075,000	
大塚ホールディングス	126,200	4,422.00	558,056,400	
大正製薬HD	14,000	8,400.00	117,600,000	貸付株式数 3,900株
大日本塗料	43,000	231.00	9,933,000	
日本ペイントHOLD	45,500	2,802.00	127,491,000	貸付株式数 12,800株 (12,800株)
関西ペイント	66,200	1,807.00	119,623,400	
中国塗料	18,000	851.00	15,318,000	
日本特殊塗料	5,700	1,083.00	6,173,100	
藤倉化成	12,100	562.00	6,800,200	
太陽ホールディングス	4,500	4,570.00	20,565,000	
DIC	233,000	338.00	78,754,000	
サカティンクス	12,600	1,267.00	15,964,200	
東洋インキSCホールディン	57,000	483.00	27,531,000	

T & K T O K A	3,100	2,312.00	7,167,200	
アルプス技研	2,900	2,537.00	7,357,300	
オリエンタルランド	63,300	7,100.00	449,430,000	
ダスキン	17,300	2,200.00	38,060,000	
パーク24	28,200	2,843.00	80,172,600	貸付株式数 4,500株 (4,500株)
明光ネットワークジャパン	8,100	1,401.00	11,348,100	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
ファルコホールディングス	4,000	1,473.00	5,892,000	
フジ・メディア・HD	57,700	1,463.00	84,415,100	貸付株式数 16,000株
ラウンドワン	20,800	555.00	11,544,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
リゾートトラスト	24,600	3,050.00	75,030,000	
オービック	19,300	6,550.00	126,415,000	
ジャストシステム	11,500	968.00	11,132,000	
ヤフー	400,200	504.00	201,700,800	貸付株式数 111,700株 (111,700株)
ビー・エム・エル	4,000	3,510.00	14,040,000	
トレンドマイクロ	27,400	5,260.00	144,124,000	
りらいあコミュニケーション	10,900	1,118.00	12,186,200	
日本オラクル	8,900	6,070.00	54,023,000	
フューチャーアーキテクト	10,200	731.00	7,456,200	
C A C H O L D I N G S	6,500	986.00	6,409,000	
ユー・エス・エス	71,200	1,857.00	132,218,400	
オービックビジネスC	3,000	7,110.00	21,330,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	12,800	2,417.00	30,937,600	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
アイティフォー	14,200	584.00	8,292,800	
サイバーエージェント	14,500	5,120.00	74,240,000	
楽天	275,500	1,385.00	381,567,500	
大塚商会	15,000	6,210.00	93,150,000	
総合メディカル	3,000	4,345.00	13,035,000	
サイボウズ	18,300	314.00	5,746,200	
セントラルスポーツ	3,000	2,311.00	6,933,000	
電通国際情報S	4,400	2,378.00	10,463,200	
ウェザーニューズ	2,200	4,335.00	9,537,000	
C I J	10,400	501.00	5,210,400	
WOWOW	3,200	3,065.00	9,808,000	貸付株式数 800株 (800株)

フルキャストホールディングス	6,600	717.00	4,732,200	
富士フイルムHLDGS	134,700	4,852.00	653,564,400	
コニカミノルタ	141,300	1,197.00	169,136,100	
資生堂	112,000	2,592.00	290,304,000	貸付株式数 32,700株
ライオン	68,000	1,164.00	79,152,000	貸付株式数 21,000株
高砂香料	4,200	2,904.00	12,196,800	
マンダム	5,700	4,835.00	27,559,500	
ミルボン	3,800	4,970.00	18,886,000	貸付株式数 1,000株
ファンケル	14,000	1,708.00	23,912,000	
コーセー	9,500	11,310.00	107,445,000	
シーズ・ホールディングス	8,400	2,013.00	16,909,200	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
ポーラ・オルビスHD	6,000	8,240.00	49,440,000	
ノエビアホールディングス	3,700	3,605.00	13,338,500	
コニシ	5,200	2,604.00	13,540,800	
長谷川香料	7,900	1,552.00	12,260,800	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
星光PMC	3,600	1,229.00	4,424,400	貸付株式数 1,000株
小林製薬	8,800	9,850.00	86,680,000	
荒川化学工業	6,100	1,193.00	7,277,300	
日本高純度化学	3,100	2,278.00	7,061,800	
JCU	2,000	4,230.00	8,460,000	
新田ゼラチン	5,900	711.00	4,194,900	
デクセリアルズ	13,500	1,314.00	17,739,000	貸付株式数 3,700株
アース製薬	4,000	5,100.00	20,400,000	
イハラケミカル	9,700	1,606.00	15,578,200	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
大成ラミック	2,800	3,065.00	8,582,000	
クミアイ化学	12,900	1,124.00	14,499,600	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
日本農薬	14,400	739.00	10,641,600	貸付株式数 4,000株 (3,900株)
昭和シエル石油	59,700	1,040.00	62,088,000	
ニチレキ	9,000	933.00	8,397,000	
東燃ゼネラル石油	86,000	1,086.00	93,396,000	
ユシロ化学	4,800	1,397.00	6,705,600	
ピーピー・カストロール	4,300	1,293.00	5,559,900	
富士石油	16,800	370.00	6,216,000	
出光興産	29,500	1,919.00	56,610,500	

J Xホールディングス	695,700	491.30	341,797,410	
コスモエネルギーHLDGS	17,600	1,589.00	27,966,400	
横浜ゴム	36,100	1,945.00	70,214,500	
東洋ゴム	26,500	2,409.00	63,838,500	
ブリヂストン	198,500	4,311.00	855,733,500	
住友ゴム	54,400	1,628.00	88,563,200	
オカモト	19,000	1,122.00	21,318,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
アキレス	63,000	154.00	9,702,000	
ニッタ	6,700	3,270.00	21,909,000	
住友理工	13,000	1,042.00	13,546,000	
三ツ星ベルト	16,000	934.00	14,944,000	
バンドー化学	24,000	510.00	12,240,000	
鬼怒川ゴム	15,000	657.00	9,855,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
旭硝子	312,000	698.00	217,776,000	
日本板硝子	289,000	100.00	28,900,000	
有沢製作所	10,100	781.00	7,888,100	
日本山村硝子	30,000	183.00	5,490,000	
日本電気硝子	122,000	618.00	75,396,000	
住友大阪セメント	119,000	457.00	54,383,000	
太平洋セメント	369,000	364.00	134,316,000	
日本ヒュ-ム	7,600	730.00	5,548,000	
日本コンクリ-ト	15,800	345.00	5,451,000	貸付株式数 4,300株 (3,800株)
アジアパイルHD	8,700	549.00	4,776,300	
東海カーボン	56,000	345.00	19,320,000	
日本カーボン	33,000	329.00	10,857,000	
東洋炭素	4,100	1,879.00	7,703,900	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ノリタケ	37,000	273.00	10,101,000	
TOTO	43,600	4,045.00	176,362,000	
日本碍子	75,000	2,768.00	207,600,000	
日本特殊陶業	50,600	3,245.00	164,197,000	
MARUWA	2,500	2,755.00	6,887,500	貸付株式数 700株 (700株)
品川リフラクトリーズ	18,000	256.00	4,608,000	
フジインコーポレーテッド	5,600	1,726.00	9,665,600	
ニチアス	31,000	808.00	25,048,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)

新日鐵住金	265,500	2,357.50	625,916,250	
神戸製鋼所	1,090,000	132.00	143,880,000	
合同製鐵	36,000	230.00	8,280,000	
J F E ホールディングス	161,900	1,858.00	300,810,200	
日新製鋼	26,700	1,252.00	33,428,400	
東京製鐵	32,700	767.00	25,080,900	
共英製鋼	6,700	2,183.00	14,626,100	
大和工業	13,100	3,025.00	39,627,500	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
東京鐵鋼	15,000	576.00	8,640,000	
大阪製鐵	4,200	2,162.00	9,080,400	
淀川製鋼所	9,100	2,476.00	22,531,600	
東洋鋼鈹	16,700	429.00	7,164,300	
丸一鋼管	19,200	3,500.00	67,200,000	貸付株式数 5,400株 (5,400株)
大同特殊鋼	100,000	468.00	46,800,000	
日本高周波	46,000	97.00	4,462,000	
日本冶金工	50,800	143.00	7,264,400	貸付株式数 15,600株 (15,600株)
山陽特殊製鋼	36,000	570.00	20,520,000	
愛知製鋼	37,000	564.00	20,868,000	
日立金属	67,300	1,504.00	101,219,200	
大平洋金属	41,000	320.00	13,120,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
新日本電工	40,100	218.00	8,741,800	
栗本鉄工所	35,000	221.00	7,735,000	
日本製鋼所	99,000	427.00	42,273,000	貸付株式数 19,000株 (19,000株)
三菱製鋼	47,000	234.00	10,998,000	
日本輕金属HD	139,600	212.00	29,595,200	貸付株式数 39,000株
三井金属	155,000	218.00	33,790,000	
東邦亜鉛	36,000	268.00	9,648,000	
三菱マテリアル	370,000	391.00	144,670,000	
住友鋁山	163,000	1,377.50	224,532,500	
D O W A ホールディングス	77,000	847.00	65,219,000	
古河機金	98,000	228.00	22,344,000	
大阪チタニウム	5,800	2,496.00	14,476,800	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
東邦チタニウム	10,200	988.00	10,077,600	貸付株式数 2,800株
U A C J	86,000	289.00	24,854,000	



古河電工	189,000	265.00	50,085,000	
住友電工	235,800	1,667.00	393,078,600	
フジクラ	85,000	671.00	57,035,000	
昭和電線HLDGS	98,000	72.00	7,056,000	貸付株式数 24,000株
タツタ電線	15,700	455.00	7,143,500	
リョービ	38,000	505.00	19,190,000	
アーステイ	8,200	739.00	6,059,800	
アサヒHD	9,200	1,846.00	16,983,200	
東洋製罐グループHD	42,100	2,316.00	97,503,600	
ホッカンホールディングス	20,000	327.00	6,540,000	
横河ブリッジHLDGS	12,300	1,385.00	17,035,500	貸付株式数 3,400株
三和ホールディングス	60,600	972.00	58,903,200	
文化シヤッタ -	17,600	1,039.00	18,286,400	
三協立山	8,000	1,635.00	13,080,000	
アルインコ	4,200	1,126.00	4,729,200	
LIXILグループ	82,100	2,718.00	223,147,800	
ノーリツ	12,400	1,840.00	22,816,000	
長府製作所	6,900	2,833.00	19,547,700	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
リンナイ	10,900	10,620.00	115,758,000	
ユニプレス	11,900	2,768.00	32,939,200	
岡 部	13,400	932.00	12,488,800	
ジーテクト	6,700	1,741.00	11,664,700	
東 プ レ	11,700	2,787.00	32,607,900	
高周波熱錬	12,800	950.00	12,160,000	
東京製綱	45,000	204.00	9,180,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
パイオラックス	3,200	6,480.00	20,736,000	
日本発条	55,600	1,200.00	66,720,000	
三浦工業	25,700	1,699.00	43,664,300	貸付株式数 7,500株 (7,500株)
タ ク マ	22,000	1,018.00	22,396,000	
テクノプロ・ホールディング	8,600	3,635.00	31,261,000	
ジャパンマテリアル	3,000	2,501.00	7,503,000	貸付株式数 800株 (400株)
ベクトル	2,600	1,931.00	5,020,600	貸付株式数 700株 (700株)
リクルートホールディングス	118,000	3,645.00	430,110,000	
ツ ガ ミ	18,000	518.00	9,324,000	貸付株式数 5,000株
オークマ	39,000	1,009.00	39,351,000	

東芝機械	35,000	404.00	14,140,000	
アマダホールディングス	88,300	1,148.00	101,368,400	
アイダエンジニア	16,500	1,262.00	20,823,000	
滝澤鉄工所	31,000	160.00	4,960,000	
富士機械製造	20,100	1,195.00	24,019,500	
牧野フライス	30,000	916.00	27,480,000	
オーエスジー	26,800	2,243.00	60,112,400	貸付株式数 7,600株
旭ダイヤモンド	16,900	1,375.00	23,237,500	
D M G 森精機	32,900	1,435.00	47,211,500	
ソディック	12,100	923.00	11,168,300	
ディスコ	7,500	11,520.00	86,400,000	
日東工器	4,000	2,701.00	10,804,000	
豊田自動織機	51,200	6,460.00	330,752,000	
O K K	36,000	149.00	5,364,000	
島精機製作所	8,700	1,976.00	17,191,200	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
日阪製作所	9,400	965.00	9,071,000	
やまびこ	11,600	1,027.00	11,913,200	
ナプテスコ	31,200	2,471.00	77,095,200	
三井海洋開発	6,800	1,780.00	12,104,000	貸付株式数 1,900株
S M C	17,600	31,530.00	554,928,000	
新川	7,200	587.00	4,226,400	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
ホソカワミクロン	12,000	632.00	7,584,000	
ユニオンツール	3,000	3,290.00	9,870,000	貸付株式数 800株 (800株)
オイレス工業	8,100	2,122.00	17,188,200	
日精エーエスビー	2,400	2,177.00	5,224,800	貸付株式数 700株
サト - ホールディングス	8,200	2,413.00	19,786,600	
日精樹脂工業	5,500	971.00	5,340,500	
小松製作所	288,900	1,931.00	557,865,900	
住友重機械	173,000	534.00	92,382,000	貸付株式数 47,000株 (47,000株)
日立建機	26,800	1,804.00	48,347,200	貸付株式数 7,400株 (7,400株)
巴工業	3,800	1,572.00	5,973,600	
井関農機	66,000	188.00	12,408,000	貸付株式数 18,000株 (18,000株)
T O W A	6,700	799.00	5,353,300	貸付株式数 1,800株 (1,800株)

丸山製作所	27,000	201.00	5,427,000	
北川鉄工所	31,000	274.00	8,494,000	
クボタ	283,000	1,947.50	551,142,500	貸付株式数 89,000株 (89,000株)
東洋エンジニア	34,000	319.00	10,846,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
三菱化工機	24,000	260.00	6,240,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
月島機械	11,800	1,104.00	13,027,200	
帝国電機製作所	6,200	906.00	5,617,200	
新東工業	14,600	1,006.00	14,687,600	
渋谷工業	5,500	1,763.00	9,696,500	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
アイチ コーポレーション	10,000	830.00	8,300,000	
小森コーポレーション	14,800	1,429.00	21,149,200	
鶴見製作所	5,100	2,039.00	10,398,900	
住友精密	13,000	448.00	5,824,000	
荏原製作所	132,000	571.00	75,372,000	貸付株式数 34,000株
西島製作所	7,700	1,037.00	7,984,900	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
北越工業	7,400	831.00	6,149,400	
千代田化工建	44,000	921.00	40,524,000	
ダイキン工業	82,000	8,548.00	700,936,000	
オルガノ	14,000	484.00	6,776,000	
ト - ヨ - カネツ	38,000	259.00	9,842,000	
栗田工業	34,300	2,545.00	87,293,500	貸付株式数 6,600株 (6,600株)
椿本チエイン	34,000	902.00	30,668,000	
日本コンベヤ	24,000	179.00	4,296,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
日 機 装	22,400	986.00	22,086,400	貸付株式数 6,100株 (6,100株)
新興プランテック	13,500	982.00	13,257,000	
アネスト岩田	11,300	1,040.00	11,752,000	
ダイフク	28,100	1,975.00	55,497,500	貸付株式数 8,200株 (8,200株)
加藤製作所	15,000	523.00	7,845,000	
油研工業	21,000	256.00	5,376,000	
タダノ	27,000	1,452.00	39,204,000	
フジテック	16,900	1,236.00	20,888,400	貸付株式数 4,700株

C K D	16,600	1,210.00	20,086,000	
キトー	8,200	1,048.00	8,593,600	貸付株式数 2,100株
平和	17,100	2,339.00	39,996,900	貸付株式数 4,700株 (4,700株)
理想科学工業	6,600	1,954.00	12,896,400	
S A N K Y O	15,300	4,735.00	72,445,500	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
日本金銭機械	6,400	1,212.00	7,756,800	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	3,900	2,065.00	8,053,500	
福島工業	3,900	2,640.00	10,296,000	
ダイコク電機	3,200	1,514.00	4,844,800	
竹内製作所	8,500	2,566.00	21,811,000	
ア マ ノ	17,900	1,601.00	28,657,900	
J U K I	8,600	1,100.00	9,460,000	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
サンデンホールディングス	37,000	374.00	13,838,000	
蛇の目ミシン	6,700	840.00	5,628,000	
ブラザー工業	72,800	1,407.00	102,429,600	
マックス	10,000	1,215.00	12,150,000	
モリタホールディングス	11,000	1,353.00	14,883,000	
グローリー	19,300	3,615.00	69,769,500	
新晃工業	4,800	1,482.00	7,113,600	
大和冷機工業	10,800	939.00	10,141,200	
セガサミーホールディングス	60,800	1,161.00	70,588,800	
日本ピストンリング	3,500	2,031.00	7,108,500	
リ ケ ン	31,000	423.00	13,113,000	
T P R	7,300	3,415.00	24,929,500	
ホシザキ電機	12,200	7,840.00	95,648,000	
大豊工業	6,000	1,474.00	8,844,000	
日本精工	116,300	1,409.00	163,866,700	貸付株式数 32,300株 (32,300株)
N T N	142,000	518.00	73,556,000	
ジェイテクト	60,500	2,048.00	123,904,000	
不 二 越	54,000	546.00	29,484,000	
ミネベア	91,000	1,075.00	97,825,000	
日本トムソン	21,000	539.00	11,319,000	
T H K	37,300	2,185.00	81,500,500	
ユーシン精機	2,900	2,273.00	6,591,700	貸付株式数 800株 (800株)

イーグル工業	7,500	2,293.00	17,197,500	
日本ピラ - 工業	7,500	1,053.00	7,897,500	
キッツ	29,200	535.00	15,622,000	
日立	1,437,000	693.10	995,984,700	
東芝	1,188,000	282.50	335,610,000	
三菱電機	600,000	1,264.00	758,400,000	
富士電機	172,000	521.00	89,612,000	
東洋電機製造	15,000	442.00	6,630,000	
安川電機	70,200	1,599.00	112,249,800	
シンフォニアテクノロジー	44,000	196.00	8,624,000	
明電舎	56,000	479.00	26,824,000	
山洋電気	16,000	759.00	12,144,000	
デンヨー	5,700	1,929.00	10,995,300	
日立工機	16,600	886.00	14,707,600	
三桜工業	9,900	740.00	7,326,000	
マキタ	36,500	6,750.00	246,375,000	
東芝テック	43,000	411.00	17,673,000	
マブチモーター	16,200	6,580.00	106,596,000	
日本電産	67,600	8,772.00	592,987,200	
東光高岳	3,300	1,526.00	5,035,800	
ダイヘン	35,000	564.00	19,740,000	
田淵電機	7,300	773.00	5,642,900	貸付株式数 1,000株
JVCケンウッド	42,900	305.00	13,084,500	
第一精工	3,000	1,587.00	4,761,000	貸付株式数 300株 (300株)
日新電機	14,400	971.00	13,982,400	
大崎電気	12,000	685.00	8,220,000	貸付株式数 3,000株
オムロン	64,300	4,165.00	267,809,500	
日東工業	9,400	2,114.00	19,871,600	
I D E C	9,300	1,061.00	9,867,300	
ジーエス・ユアサコーポ	110,000	452.00	49,720,000	
メルコホールディングス	4,200	2,251.00	9,454,200	
日本電気	776,000	387.00	300,312,000	
富士通	545,000	624.10	340,134,500	
沖電気	256,000	151.00	38,656,000	
電気興業	19,000	553.00	10,507,000	
サンケン電気	32,000	454.00	14,528,000	
アイホン	4,100	2,006.00	8,224,600	
ルネサスエレクトロニクス	28,900	781.00	22,570,900	貸付株式数 8,000株
セイコーエプソン	83,800	1,862.00	156,035,600	

ワコム	46,900	470.00	22,043,000	貸付株式数 15,100株 (15,100株)
アルバック	9,800	3,255.00	31,899,000	
アクセル	4,900	1,365.00	6,688,500	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
E I Z O	6,100	2,956.00	18,031,600	
ジャパンディスプレイ	105,100	342.00	35,944,200	貸付株式数 30,800株 (30,800株)
日本信号	16,000	1,273.00	20,368,000	
京三製作所	19,000	357.00	6,783,000	
能美防災	7,100	1,570.00	11,147,000	
ホーチキ	5,200	1,076.00	5,595,200	
エレコム	5,900	1,575.00	9,292,500	
日本無線	19,000	371.00	7,049,000	
パナソニック	643,400	1,247.50	802,641,500	
シャープ	474,000	120.00	56,880,000	貸付株式数 146,000株 (132,000株)
アンリツ	34,600	777.00	26,884,200	
富士通ゼネラル	17,000	1,591.00	27,047,000	
日立国際電気	13,000	1,693.00	22,009,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
ソ ニ ー	398,100	2,998.50	1,193,702,850	
T D K	34,100	7,780.00	265,298,000	
帝国通信工業	36,000	207.00	7,452,000	
ミツミ電機	23,000	610.00	14,030,000	貸付株式数 5,900株
タムラ製作所	25,000	354.00	8,850,000	
アルプス電気	47,500	3,245.00	154,137,500	
パイオニア	91,900	331.00	30,418,900	貸付株式数 26,300株
日本電波工業	6,300	790.00	4,977,000	貸付株式数 2,100株
日本トリム	1,700	4,140.00	7,038,000	貸付株式数 300株 (100株)
ローランド ディー . ジー .	3,300	2,639.00	8,708,700	
フオスタ - 電機	7,300	2,600.00	18,980,000	
クラリオン	31,000	419.00	12,989,000	貸付株式数 8,000株
S M K	18,000	615.00	11,070,000	
ヨコオ	8,100	591.00	4,787,100	
東 光	16,000	396.00	6,336,000	貸付株式数 5,000株
ホシデン	18,600	620.00	11,532,000	
ヒロセ電機	9,000	14,380.00	129,420,000	
日本航空電子	16,000	1,770.00	28,320,000	

T O A	7,600	1,293.00	9,826,800	
日立マクセル	9,600	2,154.00	20,678,400	
古野電気	9,100	873.00	7,944,300	
ユニデンホールディングス	30,000	151.00	4,530,000	貸付株式数 8,000株
アルパイン	14,100	1,568.00	22,108,800	
アイコム	4,200	2,460.00	10,332,000	
船井電機	6,300	986.00	6,211,800	貸付株式数 1,700株
横河電機	56,800	1,408.00	79,974,400	
新電元工業	22,000	459.00	10,098,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
アズビル	18,000	3,040.00	54,720,000	
日本光電工業	23,600	2,676.00	63,153,600	
共和電業	13,700	428.00	5,863,600	
堀場製作所	10,500	4,580.00	48,090,000	
アドバンテスト	39,600	1,043.00	41,302,800	貸付株式数 11,500株
エスベック	7,100	1,467.00	10,415,700	
パナソニックデバイス	8,300	665.00	5,519,500	
キーエンス	12,700	64,260.00	816,102,000	
日置電機	3,800	2,251.00	8,553,800	
シスメックス	43,700	7,550.00	329,935,000	
メガチップス	6,800	1,096.00	7,452,800	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
O B A R A G R O U P	3,800	4,325.00	16,435,000	
デンソー	138,500	5,790.00	801,915,000	
コーセル	9,400	1,089.00	10,236,600	
オプテックス	4,700	3,030.00	14,241,000	
千代田インテグレ	3,400	2,798.00	9,513,200	
レーザーテック	6,700	1,319.00	8,837,300	
スタンレー電気	40,200	2,734.00	109,906,800	
岩崎電気	22,000	244.00	5,368,000	
ウシオ電機	34,400	1,677.00	57,688,800	
日本セラミック	3,900	1,977.00	7,710,300	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
日本デジタル研究所	5,800	1,692.00	9,813,600	
山一電機	5,700	882.00	5,027,400	
図 研	5,900	1,182.00	6,973,800	
日本電子	23,000	785.00	18,055,000	
カ シ オ	56,600	2,693.00	152,423,800	貸付株式数 19,200株
ファナック	57,600	21,085.00	1,214,496,000	
エンプラス	3,100	4,510.00	13,981,000	

ローム	27,600	6,310.00	174,156,000	
浜松ホトニクス	43,800	3,365.00	147,387,000	
三井ハイテック	10,500	748.00	7,854,000	
新光電気工業	22,000	801.00	17,622,000	
京セラ	92,200	5,578.00	514,291,600	
太陽誘電	27,600	1,693.00	46,726,800	
村田製作所	59,100	17,365.00	1,026,271,500	
ユーシン	8,200	719.00	5,895,800	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
双葉電子工業	9,900	1,643.00	16,265,700	
日東電工	45,500	8,596.00	391,118,000	
北陸電気工業	35,000	173.00	6,055,000	
東海理化電機	16,500	3,015.00	49,747,500	
ニチコン	18,700	964.00	18,026,800	
日本ケミコン	50,000	223.00	11,150,000	
K O A	8,900	1,022.00	9,095,800	
三井造船	223,000	189.00	42,147,000	貸付株式数 41,000株 (41,000株)
日立造船	44,600	666.00	29,703,600	
三菱重工業	1,003,000	551.50	553,154,500	
川崎重工業	441,000	450.00	198,450,000	
I H I	436,000	330.00	143,880,000	
名村造船所	17,200	1,052.00	18,094,400	
日本車輛	30,000	295.00	8,850,000	貸付株式数 8,000株 (7,000株)
近畿車輛	13,000	387.00	5,031,000	
F P G	17,500	862.00	15,085,000	貸付株式数 4,800株 (400株)
じもとホールディングス	45,000	195.00	8,775,000	
全国保証	14,800	4,015.00	59,422,000	
足利ホールディングス	36,600	454.00	16,616,400	
東京ＴＹフィナンシャルＧ	7,800	3,895.00	30,381,000	
九州フィナンシャルＧ	84,600	832.00	70,387,200	
日産自動車	790,900	1,257.00	994,161,300	
いすゞ自動車	163,500	1,332.50	217,863,750	
トヨタ自動車	716,700	7,658.00	5,488,488,600	
日野自動車	80,400	1,412.00	113,524,800	
三菱自動車工業	223,300	1,042.00	232,678,600	
エフテック	4,900	1,236.00	6,056,400	貸付株式数 1,600株
武蔵精密工業	6,500	2,539.00	16,503,500	



日産車体	27,400	1,335.00	36,579,000	貸付株式数 7,200株 (7,200株)
新明和工業	25,000	1,099.00	27,475,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
極東開発工業	12,300	1,365.00	16,789,500	
日信工業	12,900	1,839.00	23,723,100	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
トピー工業	51,000	269.00	13,719,000	
ティラド	35,000	192.00	6,720,000	
曙ブレーキ	31,300	318.00	9,953,400	貸付株式数 8,700株
タチエス	9,900	1,947.00	19,275,300	
N O K	27,300	2,903.00	79,251,900	貸付株式数 6,800株
フタバ産業	20,400	540.00	11,016,000	
K Y B	66,000	382.00	25,212,000	
シロキ工業	19,000	380.00	7,220,000	
大同メタル工業	9,200	1,113.00	10,239,600	
プレス工業	32,500	529.00	17,192,500	
カルソニックカンセイ	42,000	1,074.00	45,108,000	
太平洋工業	13,300	1,367.00	18,181,100	貸付株式数 4,100株
ケーヒン	13,300	2,137.00	28,422,100	
河西工業	7,800	1,872.00	14,601,600	
アイシン精機	56,600	5,200.00	294,320,000	
富士機工	10,300	481.00	4,954,300	
マ ッ ダ	178,500	2,507.50	447,588,750	
ダイハツ	65,400	1,595.00	104,313,000	貸付株式数 18,400株 (18,400株)
今仙電機製作所	7,400	1,272.00	9,412,800	
本田技研	506,600	3,919.00	1,985,365,400	
スズキ	117,100	3,666.00	429,288,600	
富士重工業	177,700	4,942.00	878,193,400	
ヤマハ発動機	79,600	2,831.00	225,347,600	
ショーワ	15,900	1,170.00	18,603,000	
小糸製作所	33,700	5,000.00	168,500,000	
T B K	11,500	472.00	5,428,000	
エクセディ	7,900	2,880.00	22,752,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
ミツバ	10,000	2,005.00	20,050,000	
豊田合成	20,500	2,848.00	58,384,000	
愛三工業	10,900	1,240.00	13,516,000	
ヨ ロ ズ	5,700	2,792.00	15,914,400	

エフ・シー・シー	9,500	2,660.00	25,270,000	
シマノ	22,600	18,560.00	419,456,000	
テイ・エス テック	13,200	3,145.00	41,514,000	
ジャムコ	2,600	4,155.00	10,803,000	貸付株式数 700株 (700株)
小野建	6,300	1,108.00	6,980,400	
佐島電機	6,700	783.00	5,246,100	
カップ・クリエイト	9,400	1,201.00	11,289,400	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
ライトオン	5,400	1,434.00	7,743,600	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	9,300	2,160.00	20,088,000	
三菱食品	6,300	2,941.00	18,528,300	
良品計画	6,400	25,280.00	161,792,000	
松田産業	5,900	1,404.00	8,283,600	
メディパルHD	55,700	2,078.00	115,744,600	
アルビス	2,300	2,214.00	5,092,200	
アズワン	4,800	4,610.00	22,128,000	
シモジマ	6,300	1,103.00	6,948,900	
ドウシシャ	6,500	2,516.00	16,354,000	
コナカ	8,400	636.00	5,342,400	
コーナン商事	7,600	1,687.00	12,821,200	
黒田電気	10,600	2,249.00	23,839,400	
ネットワンシステムズ	26,600	775.00	20,615,000	
ワタミ	8,500	834.00	7,089,000	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	35,900	4,445.00	159,575,500	
丸文	5,900	971.00	5,728,900	
西松屋チェーン	12,000	1,070.00	12,840,000	
ゼンショーホールディングス	28,300	1,508.00	42,676,400	
ハピネット	6,100	1,176.00	7,173,600	
幸楽苑ホールディングス	5,600	1,576.00	8,825,600	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
サイゼリヤ	9,200	3,010.00	27,692,000	
エクセル	3,300	1,550.00	5,115,000	
V Tホールディングス	20,200	684.00	13,816,800	
ガリバーインターナショナル	15,300	1,106.00	16,921,800	貸付株式数 5,100株 (5,100株)
ユナイテッドアローズ	8,000	4,905.00	39,240,000	
進和	4,300	1,718.00	7,387,400	

ハイデイ日高	4,700	3,365.00	15,815,500	
シークス	3,700	3,690.00	13,653,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
京都きもの友禅	8,500	946.00	8,041,000	貸付株式数 2,500株
コロワイド	18,700	1,806.00	33,772,200	貸付株式数 5,700株 (5,700株)
壱番屋	2,700	5,790.00	15,633,000	
スギホールディングス	10,000	6,760.00	67,600,000	
島津製作所	73,000	1,958.00	142,934,000	
J M S	20,000	318.00	6,360,000	
ブイ・テクノロジー	1,600	4,875.00	7,800,000	貸付株式数 400株
スター精密	11,400	1,579.00	18,000,600	
東京計器	27,000	226.00	6,102,000	
東京精密	11,200	2,700.00	30,240,000	
マニー	5,700	2,324.00	13,246,800	
ニコン	104,800	1,619.00	169,671,200	貸付株式数 33,400株
トプコン	19,200	2,119.00	40,684,800	貸付株式数 4,800株 (4,800株)
オリンパス	83,900	4,700.00	394,330,000	
理研計器	5,800	1,450.00	8,410,000	
S C R E E Nホールディングス	59,000	881.00	51,979,000	
キヤノン電子	6,000	1,995.00	11,970,000	
タムロン	5,000	2,252.00	11,260,000	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
H O Y A	131,000	4,907.00	642,817,000	
ノーリツ鋼機	8,000	608.00	4,864,000	
キヤノン	302,100	3,680.00	1,111,728,000	
リ コ ー	182,500	1,216.00	221,920,000	貸付株式数 50,800株 (50,800株)
シチズンホールディングス	70,000	868.00	60,760,000	
リズム時計	33,000	161.00	5,313,000	
大研医器	6,300	1,045.00	6,583,500	貸付株式数 1,700株 (300株)
メニコン	3,100	3,395.00	10,524,500	
パラマウントベッドHD	6,100	4,315.00	26,321,500	
前田工織	8,000	1,115.00	8,920,000	貸付株式数 1,900株 (300株)
永大産業	14,000	423.00	5,922,000	
アートネイチャー	5,800	1,102.00	6,391,600	

バンダイナムコHLDGS	58,100	2,656.00	154,313,600	
共立印刷	15,700	302.00	4,741,400	
フランスベッドHLDGS	9,400	1,001.00	9,409,400	
マーベラス	10,200	942.00	9,608,400	貸付株式数 2,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,000	4,960.00	49,600,000	
エイベックス・グループHD	10,900	1,332.00	14,518,800	
トッパン・フォームズ	10,800	1,437.00	15,519,600	
フジシールインターナショナル	7,100	3,680.00	26,128,000	
タカラトミー	18,500	749.00	13,856,500	貸付株式数 6,000株
大建工業	26,000	335.00	8,710,000	
凸版印刷	160,000	1,064.00	170,240,000	
大日本印刷	167,000	1,198.00	200,066,000	
図書印刷	14,000	543.00	7,602,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
共同印刷	24,000	327.00	7,848,000	
日本写真印刷	9,800	2,399.00	23,510,200	貸付株式数 2,700株
藤森工業	5,500	2,986.00	16,423,000	
宝印刷	4,900	1,323.00	6,482,700	
前澤化成工業	7,400	1,138.00	8,421,200	
アシックス	52,600	2,527.00	132,920,200	貸付株式数 14,600株 (14,600株)
ツ ツ ミ	3,500	2,565.00	8,977,500	
ジェイ エス ピー	4,300	2,482.00	10,672,600	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ニ チ ハ	8,500	1,821.00	15,478,500	
エフピコ	5,200	4,430.00	23,036,000	
小松ウオール工業	2,500	2,067.00	5,167,500	
ヤマハ	41,800	2,904.00	121,387,200	
河合楽器	2,600	2,220.00	5,772,000	
クリナップ	9,100	715.00	6,506,500	
ビジョン	32,100	2,944.00	94,502,400	
天馬	5,000	2,400.00	12,000,000	
キングジム	6,800	811.00	5,514,800	
リンテック	13,400	2,677.00	35,871,800	
信越ポリマー	14,300	686.00	9,809,800	
東 リ	21,000	341.00	7,161,000	
イトーキ	12,600	916.00	11,541,600	
任 天 堂	34,700	16,775.00	582,092,500	

三菱鉛筆	4,300	5,420.00	23,306,000	
松 風	4,000	1,518.00	6,072,000	
タカラスタンダ - ド	25,000	965.00	24,125,000	
コ ク ヨ	29,900	1,343.00	40,155,700	
ナカバヤシ	17,000	303.00	5,151,000	
ニ フ コ	11,300	5,350.00	60,455,000	
グロープライド	3,300	1,625.00	5,362,500	
岡村製作所	19,900	1,237.00	24,616,300	
日本バルカー	33,000	303.00	9,999,000	
伊 藤 忠	437,000	1,429.00	624,473,000	
丸 紅	547,400	625.80	342,562,920	
スクロール	11,000	429.00	4,719,000	
高 島	17,000	232.00	3,944,000	
ヨンドシーホールディングス	4,700	2,815.00	13,230,500	
三陽商会	37,000	289.00	10,693,000	
長瀬産業	33,100	1,520.00	50,312,000	
蝶 理	4,700	1,674.00	7,867,800	
豊田通商	62,300	2,811.00	175,125,300	
オンワ - ドホールディングス	39,000	751.00	29,289,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
三共生興	13,200	461.00	6,085,200	
兼 松	126,000	203.00	25,578,000	
美 津 濃	31,000	567.00	17,577,000	
ファミリーマート	16,700	5,750.00	96,025,000	貸付株式数 5,500株
三井物産	501,500	1,427.50	715,891,250	
日本紙パルプ	25,000	330.00	8,250,000	
東京エレクトロン	50,600	7,500.00	379,500,000	
日立ハイテクノロジーズ	19,300	3,200.00	61,760,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
カメイ	8,000	1,180.00	9,440,000	
東都水産	28,000	190.00	5,320,000	
スターゼン	2,500	3,400.00	8,500,000	
セイコーHD	35,000	716.00	25,060,000	
山 善	22,100	1,113.00	24,597,300	
住友商事	349,500	1,251.00	437,224,500	
日本ユニシス	15,900	1,322.00	21,019,800	貸付株式数 4,900株
内田洋行	17,000	469.00	7,973,000	
三菱商事	416,800	1,980.00	825,264,000	
第一実業	18,000	530.00	9,540,000	

キヤノンマーケティングJPN	16,000	1,875.00	30,000,000	
西華産業	22,000	297.00	6,534,000	
菱洋エレクトロ	7,300	1,399.00	10,212,700	
ユアサ商事	6,000	3,045.00	18,270,000	
神鋼商事	30,000	246.00	7,380,000	
阪和興業	59,000	547.00	32,273,000	
カナデン	10,100	983.00	9,928,300	
菱電商事	13,000	801.00	10,413,000	
ニプロ	41,500	1,321.00	54,821,500	
岩谷産業	65,000	634.00	41,210,000	
すてきナイスグループ	35,000	176.00	6,160,000	
兼松エレクトロニクス	5,200	2,131.00	11,081,200	
三愛石油	15,000	1,010.00	15,150,000	
稲畑産業	15,200	1,228.00	18,665,600	
ゴ-ルドウイン	2,600	5,140.00	13,364,000	貸付株式数 700株 (700株)
ユニ・チャ-ム	119,000	2,399.50	285,540,500	
デサント	14,100	1,420.00	20,022,000	
ワキタ	12,800	1,034.00	13,235,200	
東邦ホールディングス	18,000	2,893.00	52,074,000	
サンゲツ	20,800	2,223.00	46,238,400	
ミツウロコグループ	12,300	590.00	7,257,000	
シナネンホールディングス	16,000	467.00	7,472,000	
伊藤忠エネクス	15,200	942.00	14,318,400	
サンリオ	17,300	2,878.00	49,789,400	貸付株式数 200株
サンワテクノス	5,000	961.00	4,805,000	
リョ-サン	9,000	3,140.00	28,260,000	
新光商事	7,100	1,290.00	9,159,000	
トーホ-	3,600	2,393.00	8,614,800	
三信電気	8,600	1,250.00	10,750,000	
東陽テクニカ	10,400	1,069.00	11,117,600	
モスフードサービス	7,700	3,180.00	24,486,000	
加賀電子	5,600	1,738.00	9,732,800	
三益半導体	5,500	1,177.00	6,473,500	
木曽路	7,900	2,151.00	16,992,900	貸付株式数 2,400株
サトレストランシステムズ	9,500	895.00	8,502,500	
千趣会	14,200	802.00	11,388,400	貸付株式数 3,800株 (3,800株)

ケーヨー	13,200	495.00	6,534,000	貸付株式数 3,600株 (2,100株)
アデランス	10,900	837.00	9,123,300	
上新電機	15,000	1,054.00	15,810,000	
日本瓦斯	6,500	2,863.00	18,609,500	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
ロイヤルホールディングス	10,000	2,336.00	23,360,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
いなげや	7,600	1,307.00	9,933,200	
島 忠	14,600	2,686.00	39,215,600	
チヨダ	6,800	3,845.00	26,146,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
ライフコーポレーション	3,800	3,075.00	11,685,000	
リンガーハット	5,600	2,705.00	15,148,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
A O K Iホールディングス	13,100	1,558.00	20,409,800	
オークワ	10,000	1,120.00	11,200,000	
コメリ	8,700	2,468.00	21,471,600	
青山商事	10,800	4,815.00	52,002,000	
しまむら	6,400	13,590.00	86,976,000	
高 島 屋	82,000	1,062.00	87,084,000	
松 屋	12,000	1,219.00	14,628,000	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	28,500	2,397.00	68,314,500	
近鉄百貨店	27,000	323.00	8,721,000	
パ ル コ	6,300	1,105.00	6,961,500	
丸井グループ	69,400	1,944.00	134,913,600	
クレディセゾン	42,600	2,427.00	103,390,200	
アクシアル リテイリング	4,600	4,050.00	18,630,000	
イオン	229,500	1,831.50	420,329,250	
ユニーグループ・HD	54,000	778.00	42,012,000	
イ ズ ミ	10,900	4,745.00	51,720,500	
東武ストア	17,000	300.00	5,100,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
平 和 堂	11,300	2,817.00	31,832,100	
フ ジ	6,500	2,511.00	16,321,500	
ヤオコー	6,400	5,040.00	32,256,000	
ゼビオホールディングス	8,000	2,350.00	18,800,000	
ケースホールディングス	11,800	4,250.00	50,150,000	貸付株式数 3,800株 (3,800株)

PALTA C	9,200	2,198.00	20,221,600	
新生銀行	492,000	220.00	108,240,000	
あおぞら銀行	366,000	423.00	154,818,000	
三菱UFJフィナンシャルG	4,457,300	758.20	3,379,524,860	
りそなホールディングス	654,000	583.20	381,412,800	
三井住友トラストHD	1,165,000	457.10	532,521,500	
三井住友フィナンシャルG	444,300	4,543.00	2,018,454,900	
第四銀行	70,000	518.00	36,260,000	
北越銀行	63,000	252.00	15,876,000	
西日本シティ銀行	178,000	307.00	54,646,000	
千葉銀行	213,000	826.00	175,938,000	
横浜銀行	371,000	714.50	265,079,500	
常陽銀行	195,000	544.00	106,080,000	
群馬銀行	121,000	696.00	84,216,000	貸付株式数 3,000株
武蔵野銀行	8,800	4,360.00	38,368,000	
千葉興業銀行	16,200	684.00	11,080,800	
筑波銀行	26,000	399.00	10,374,000	
七十七銀行	85,000	637.00	54,145,000	
青森銀行	43,000	379.00	16,297,000	
秋田銀行	39,000	402.00	15,678,000	
山形銀行	34,000	467.00	15,878,000	
岩手銀行	4,100	4,845.00	19,864,500	貸付株式数 1,100株
東邦銀行	50,000	421.00	21,050,000	
東北銀行	54,000	156.00	8,424,000	
みちのく銀行	30,000	201.00	6,030,000	貸付株式数 10,000株
ふくおかフィナンシャルG	241,000	570.00	137,370,000	
静岡銀行	162,000	1,160.00	187,920,000	
十六銀行	69,000	464.00	32,016,000	
スルガ銀行	57,700	2,370.00	136,749,000	
八十二銀行	100,000	723.00	72,300,000	
山梨中央銀行	36,000	599.00	21,564,000	
大垣共立銀行	75,000	478.00	35,850,000	
福井銀行	51,000	234.00	11,934,000	
北國銀行	61,000	395.00	24,095,000	
清水銀行	2,600	3,020.00	7,852,000	
滋賀銀行	50,000	586.00	29,300,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
南都銀行	52,000	369.00	19,188,000	
百五銀行	49,000	570.00	27,930,000	
京都銀行	105,000	1,102.00	115,710,000	



紀陽銀行	21,300	1,729.00	36,827,700	
三重銀行	28,000	267.00	7,476,000	
ほくほくフィナンシャルG	369,000	241.00	88,929,000	
広島銀行	162,000	682.00	110,484,000	
山陰合同銀行	34,000	961.00	32,674,000	
中国銀行	37,800	1,573.00	59,459,400	
鳥取銀行	34,000	218.00	7,412,000	
伊予銀行	58,300	1,134.00	66,112,200	
百十四銀行	60,000	439.00	26,340,000	
四国銀行	46,000	271.00	12,466,000	
阿波銀行	45,000	685.00	30,825,000	
大分銀行	32,000	464.00	14,848,000	貸付株式数 11,000株
宮崎銀行	39,000	393.00	15,327,000	
佐賀銀行	38,000	268.00	10,184,000	
十八銀行	36,000	347.00	12,492,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
沖縄銀行	4,600	4,645.00	21,367,000	
琉球銀行	11,500	1,673.00	19,239,500	
セブン銀行	206,800	522.00	107,949,600	
みずほフィナンシャルG	7,816,900	243.40	1,902,633,460	
高知銀行	35,000	142.00	4,970,000	
山口フィナンシャルG	51,000	1,404.00	71,604,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
芙蓉総合リース	6,600	5,640.00	37,224,000	
興銀リース	11,100	2,494.00	27,683,400	
東京センチュリーリース	13,300	4,120.00	54,796,000	
SBIホールディングス	67,000	1,318.00	88,306,000	
日本証券金融	27,900	636.00	17,744,400	貸付株式数 7,300株 (7,300株)
アイフル	91,200	392.00	35,750,400	貸付株式数 26,500株
ポケットカード	8,600	542.00	4,661,200	
長野銀行	31,000	203.00	6,293,000	貸付株式数 8,000株
名古屋銀行	48,000	429.00	20,592,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
北洋銀行	81,700	416.00	33,987,200	
愛知銀行	2,000	6,320.00	12,640,000	
第三銀行	39,000	177.00	6,903,000	
中京銀行	27,000	228.00	6,156,000	
東日本銀行	29,000	381.00	11,049,000	
大光銀行	27,000	242.00	6,534,000	

愛媛銀行	31,000	250.00	7,750,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
トマト銀行	40,000	175.00	7,000,000	
みなと銀行	57,000	198.00	11,286,000	
京葉銀行	44,000	552.00	24,288,000	
関西アーバン銀行	6,400	1,327.00	8,492,800	
栃木銀行	31,000	685.00	21,235,000	
北日本銀行	2,400	3,285.00	7,884,000	
東和銀行	86,000	106.00	9,116,000	
福島銀行	85,000	96.00	8,160,000	
大東銀行	51,000	210.00	10,710,000	
リコーリース	4,900	3,700.00	18,130,000	
イオンフィナンシャルサービス	36,800	2,725.00	100,280,000	
アコム	111,300	600.00	66,780,000	貸付株式数 36,500株 (36,500株)
ジャックス	33,000	429.00	14,157,000	
オリコ	239,600	260.00	62,296,000	
日立キャピタル	13,200	3,255.00	42,966,000	
オリックス	392,800	1,687.00	662,653,600	
三菱UFJリース	141,100	619.00	87,340,900	
ジャフコ	9,600	4,600.00	44,160,000	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
トモニホールディングス	45,200	453.00	20,475,600	
大和証券G本社	518,000	752.00	389,536,000	
野村ホールディングス	1,068,300	696.30	743,857,290	
岡三証券グループ	48,000	707.00	33,936,000	
丸三証券	17,600	1,246.00	21,929,600	
東洋証券	29,000	380.00	11,020,000	
東海東京HD	62,300	710.00	44,233,000	
光世証券	32,000	177.00	5,664,000	貸付株式数 3,000株
水戸証券	25,400	408.00	10,363,200	
いちよし証券	13,600	1,102.00	14,987,200	
松井証券	23,800	1,117.00	26,584,600	
損保ジャパン興亜HD	123,600	3,777.00	466,837,200	
日本取引所グループ	163,200	1,932.00	315,302,400	
マネックスG	65,400	318.00	20,797,200	貸付株式数 18,300株 (18,300株)
カブドットコム証券	48,400	377.00	18,246,800	
極東証券	9,200	1,574.00	14,480,800	

岩井コスモホールディング	7,200	1,351.00	9,727,200	
藍澤證券	10,800	698.00	7,538,400	
フィデアホール	35,000	264.00	9,240,000	
池田泉州HD	49,600	485.00	24,056,000	
アニコムホールディングス	4,400	2,847.00	12,526,800	貸付株式数 1,200株 (500株)
MS&AD	166,100	3,369.00	559,590,900	
マネースクウェアHD	2,700	1,448.00	3,909,600	
SONY FH	53,600	2,156.00	115,561,600	
第一生命	355,800	2,024.00	720,139,200	
東京海上HD	224,200	4,525.00	1,014,505,000	
イー・ギャランティ	2,600	2,695.00	7,007,000	貸付株式数 600株 (600株)
NECキャピタルソリューション	3,400	1,662.00	5,650,800	貸付株式数 800株 (800株)
T&Dホールディングス	203,300	1,598.00	324,873,400	
三井不動産	294,000	3,140.00	923,160,000	
三菱地所	413,000	2,544.50	1,050,878,500	
平和不動産	12,200	1,339.00	16,335,800	
東京建物	61,700	1,372.00	84,652,400	
ダイビル	14,800	986.00	14,592,800	
京阪神ビルディング	10,400	693.00	7,207,200	
住友不動産	134,000	3,640.00	487,760,000	
大京	107,000	197.00	21,079,000	
テーオーシー	23,000	1,016.00	23,368,000	
東京楽天地	19,000	511.00	9,709,000	
レオパレス21	66,100	686.00	45,344,600	
スターツコーポレーション	6,800	2,361.00	16,054,800	
フジ住宅	7,300	755.00	5,511,500	貸付株式数 3,600株
空港施設	12,100	575.00	6,957,500	
住友不動産販売	4,600	2,772.00	12,751,200	
ゴールドクレスト	4,900	2,259.00	11,069,100	
リロ・ホールディング	2,300	13,760.00	31,648,000	
タカラレーベン	25,800	706.00	18,214,800	
サンヨーハウジング名古屋	5,900	1,160.00	6,844,000	
イオンモール	35,700	2,131.00	76,076,700	
東祥	2,200	3,110.00	6,842,000	
トーセイ	9,700	754.00	7,313,800	
エヌ・ティ・ティ都市開発	33,000	1,183.00	39,039,000	
サンフロンティア不動産	7,800	910.00	7,098,000	

エフ・ジェー・ネクスト	8,400	510.00	4,284,000	
東武鉄道	304,000	587.00	178,448,000	
相鉄ホールディングス	96,000	695.00	66,720,000	
東京急行	329,000	944.00	310,576,000	
京浜急行	153,000	991.00	151,623,000	
小田急電鉄	182,000	1,232.00	224,224,000	
京王電鉄	158,000	1,027.00	162,266,000	
京成電鉄	85,000	1,482.00	125,970,000	貸付株式数 24,000株 (24,000株)
富士急行	17,000	1,124.00	19,108,000	
新京成電鉄	25,000	435.00	10,875,000	
東日本旅客鉄道	102,900	11,365.00	1,169,458,500	
西日本旅客鉄道	54,400	7,906.00	430,086,400	
東海旅客鉄道	50,400	20,980.00	1,057,392,000	
西武ホールディングス	44,800	2,415.00	108,192,000	
鴻池運輸	8,700	1,546.00	13,450,200	
西日本鉄道	72,000	678.00	48,816,000	
ハマキョウレックス	5,100	2,216.00	11,301,600	
サカイ引越センター	1,300	6,680.00	8,684,000	
近鉄グループHLDGS	561,000	477.00	267,597,000	
阪急阪神HLDGS	376,000	777.00	292,152,000	
南海電鉄	126,000	680.00	85,680,000	
京阪電鉄	125,000	811.00	101,375,000	
神戸電鉄	27,000	360.00	9,720,000	
名古屋鉄道	201,000	482.00	96,882,000	貸付株式数 56,000株 (56,000株)
山陽電鉄	27,000	463.00	12,501,000	
トランコム	1,900	6,420.00	12,198,000	貸付株式数 500株
日本通運	220,000	547.00	120,340,000	
ヤマトホールディングス	103,500	2,488.50	257,559,750	
山 九	74,000	588.00	43,512,000	
日 新	29,000	365.00	10,585,000	
丸全昭和運輸	24,000	428.00	10,272,000	
センコー	26,000	785.00	20,410,000	
トナミホールディングス	15,000	342.00	5,130,000	
ニッコンホールディングス	18,700	2,317.00	43,327,900	
福山通運	34,000	576.00	19,584,000	貸付株式数 9,000株 (5,000株)
セイノーホールディングス	40,200	1,254.00	50,410,800	
神奈川中央交通	12,000	693.00	8,316,000	

日立物流	12,100	2,011.00	24,333,100	
日本郵船	506,000	293.00	148,258,000	
商船三井	277,000	298.00	82,546,000	貸付株式数 77,000株
川崎汽船	245,000	249.00	61,005,000	
N S ユナイテッド海運	29,000	216.00	6,264,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
飯野海運	29,800	507.00	15,108,600	
日本航空	106,300	4,190.00	445,397,000	
A N A ホールディングス	1,040,000	344.50	358,280,000	
三菱倉庫	41,000	1,587.00	65,067,000	貸付株式数 11,000株
三井倉庫H O L D	35,000	338.00	11,830,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
住友倉庫	43,000	638.00	27,434,000	
渋沢倉庫	22,000	310.00	6,820,000	
ヤマタネ	33,000	187.00	6,171,000	
東陽倉庫	25,000	255.00	6,375,000	
日本トランスシティ	17,000	426.00	7,242,000	
安田倉庫	7,100	903.00	6,411,300	
東洋埠頭	37,000	183.00	6,771,000	
上 組	65,000	1,010.00	65,650,000	
キューソー流通システム	2,200	2,798.00	6,155,600	貸付株式数 500株
郵船ロジスティクス	6,200	1,605.00	9,951,000	
近鉄エクスプレス	10,400	2,097.00	21,808,800	
東京放送H D	33,800	1,934.00	65,369,200	貸付株式数 9,400株
日本テレビH L D S	51,100	2,329.00	119,011,900	
テレビ朝日H D	15,700	2,151.00	33,770,700	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
スカパー J S A T H D	45,500	662.00	30,121,000	貸付株式数 12,700株 (12,700株)
テレビ東京H D	5,800	2,365.00	13,717,000	貸付株式数 1,600株 (200株)
コネクシオ	6,800	1,134.00	7,711,200	
日本通信	32,600	278.00	9,062,800	貸付株式数 9,200株
日本電信電話	429,800	4,726.00	2,031,234,800	
K D D I	564,900	3,069.00	1,733,678,100	
光通信	6,700	8,300.00	55,610,000	
N T T ドコモ	428,900	2,469.00	1,058,954,100	
エムティーアイ	8,500	671.00	5,703,500	
G M O インターネット	21,000	1,711.00	35,931,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)

カドカワ	18,100	1,876.00	33,955,600	
学研ホールディングス	28,000	275.00	7,700,000	
ゼンリン	8,400	2,491.00	20,924,400	
東京電力	478,100	737.00	352,359,700	
中部電力	172,900	1,636.50	282,950,850	
関西電力	230,600	1,466.00	338,059,600	
中国電力	77,200	1,554.00	119,968,800	
北陸電力	55,000	1,755.00	96,525,000	
東北電力	140,700	1,469.00	206,688,300	
四国電力	50,900	1,816.00	92,434,400	貸付株式数 14,100株 (14,100株)
九州電力	124,400	1,265.00	157,366,000	貸付株式数 34,900株 (33,800株)
北海道電力	53,100	1,137.00	60,374,700	
沖縄電力	6,200	3,130.00	19,406,000	
電源開発	47,500	4,215.00	200,212,500	
東京瓦斯	624,000	554.70	346,132,800	
大阪瓦斯	578,000	427.00	246,806,000	
東邦瓦斯	140,000	773.00	108,220,000	
北海道瓦斯	21,000	278.00	5,838,000	貸付株式数 7,000株 (2,000株)
広島ガス	14,700	433.00	6,365,100	
西部瓦斯	66,000	268.00	17,688,000	
静岡ガス	18,000	760.00	13,680,000	
メタウォーター	3,700	2,988.00	11,055,600	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
松竹	38,000	1,123.00	42,674,000	
東宝	40,000	3,350.00	134,000,000	
エイチ・アイ・エス	9,800	3,730.00	36,554,000	
東映	22,000	1,161.00	25,542,000	
NTTデータ	34,600	5,960.00	206,216,000	
共立メンテナンス	4,500	10,010.00	45,045,000	
イチネンホールディングス	6,800	1,138.00	7,738,400	
建設技術研究所	4,800	1,285.00	6,168,000	
アインホールディングス	6,900	5,950.00	41,055,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
東京テアトル	56,000	137.00	7,672,000	
よみうりランド	16,000	402.00	6,432,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
東京都競馬	45,000	273.00	12,285,000	

常磐興産	35,000	155.00	5,425,000	
カナモト	8,600	2,986.00	25,679,600	貸付株式数 2,300株
東京ドーム	50,000	571.00	28,550,000	
D T S	6,800	2,902.00	19,733,600	
スクウェア・エニックス・H D	23,500	2,967.00	69,724,500	
シーイーシー	5,800	1,180.00	6,844,000	
カプコン	14,600	2,973.00	43,405,800	
西尾レントオール	5,100	3,105.00	15,835,500	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
日本空港ビルデング	17,800	5,510.00	98,078,000	貸付株式数 4,900株
トランス・コスモス	7,200	3,015.00	21,708,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
乃村工藝社	13,500	1,855.00	25,042,500	
ジャステック	6,500	1,005.00	6,532,500	
S C S K	13,400	4,955.00	66,397,000	
藤田観光	24,000	556.00	13,344,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
K N T - C Tホールディング ス	31,000	241.00	7,471,000	
日本管財	5,800	1,949.00	11,304,200	
トーカイ	3,100	3,490.00	10,819,000	
セコム	61,200	8,185.00	500,922,000	
アイネス	9,100	1,081.00	9,837,100	
丹青社	12,200	984.00	12,004,800	貸付株式数 3,500株
メイテック	7,600	4,215.00	32,034,000	
T K C	5,700	3,240.00	18,468,000	
アサツー ディ・ケイ	10,500	3,335.00	35,017,500	
富士ソフト	9,000	2,838.00	25,542,000	
応用地質	7,400	1,406.00	10,404,400	
船井総研ホールディン	7,800	2,041.00	15,919,800	
N S D	13,100	1,750.00	22,925,000	
コナミホールディングス	25,300	3,030.00	76,659,000	
ベネッセホールディングス	19,500	3,400.00	66,300,000	
イオンディライト	6,000	3,855.00	23,130,000	
ニチイ学館	11,400	869.00	9,906,600	貸付株式数 4,800株 (4,800株)
ダイセキ	12,000	2,025.00	24,300,000	
日鉄住金物産	36,000	415.00	14,940,000	
トラスコ中山	6,300	4,615.00	29,074,500	

ヤマダ電機	168,400	526.00	88,578,400	貸付株式数 50,600株 (50,600株)
オートバックスセブン	21,500	2,184.00	46,956,000	
アークランドサカモト	5,200	2,651.00	13,785,200	
ニトリホールディングス	23,900	10,160.00	242,824,000	
吉野家ホールディングス	20,800	1,550.00	32,240,000	
加藤産業	9,200	2,750.00	25,300,000	
イノテック	10,800	593.00	6,404,400	
イエローハット	5,600	2,532.00	14,179,200	
松屋フーズ	3,600	2,903.00	10,450,800	
JBC Cホールディングス	7,900	758.00	5,988,200	
サガミチェーン	9,500	1,301.00	12,359,500	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
日 伝	2,900	3,000.00	8,700,000	
ミロク情報サービス	6,300	893.00	5,625,900	
因幡電機産業	7,900	3,810.00	30,099,000	
王将フードサービス	4,300	4,130.00	17,759,000	貸付株式数 1,300株
ブレナス	6,700	2,047.00	13,714,900	
ミニストップ	4,500	2,291.00	10,309,500	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
アークス	10,500	2,607.00	27,373,500	
パローホールディングス	12,100	2,827.00	34,206,700	
ミスミグループ本社	62,400	1,630.00	101,712,000	貸付株式数 17,400株
ベ ル ク	3,000	4,425.00	13,275,000	
ファーストリテイリング	11,100	44,070.00	489,177,000	貸付株式数 3,100株
ソフトバンクグループ	315,400	6,106.00	1,925,832,400	
スズケン	25,300	4,615.00	116,759,500	
サンドラッグ	11,800	7,690.00	90,742,000	
サックスパーホールディング	5,900	1,786.00	10,537,400	
ジェコス	4,900	1,032.00	5,056,800	
ベルーナ	15,500	655.00	10,152,500	
合計			127,617,012,620	

(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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	537,997,146	394,510,426
コール・ローン	165,308,800	116,360,930
株式	75,952,619,888	74,579,327,005
投資証券	1,756,088,720	1,920,827,331
派生商品評価勘定	10,042,849	11,514,060
未収入金	1,440,826	829,797
未収配当金	97,472,217	100,900,855
差入委託証拠金	483,498,088	446,723,235
流動資産合計	79,004,468,534	77,570,993,639
資産合計	79,004,468,534	77,570,993,639
負債の部		
流動負債		
未払解約金	67,318,000	42,366,000
流動負債合計	67,318,000	42,366,000
負債合計	67,318,000	42,366,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 40,934,323,072	38,798,220,086
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	38,002,827,462	38,730,407,553
元本等合計	78,937,150,534	77,528,627,639

純資産合計	78,937,150,534	77,528,627,639
負債純資産合計	79,004,468,534	77,570,993,639

## 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26年12月19日 至 平成27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、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。 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。</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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1. 1 期首	平成25年12月19日	平成26年12月19日
期首元本額	44,891,925,596円	40,934,323,072円
期中追加設定元本額	4,855,554,109円	3,988,667,428円
期中一部解約元本額	8,813,156,633円	6,124,770,414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	1,375,301,973円	854,988,201円
V A		
ダイワ国内重視バランスファ	51,988,101円	44,919,625円
ンド30 V A (一般投資家私		
募)		
ダイワ国内重視バランスファ	770,197,210円	586,365,436円
ンド50 V A (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)	83,075,634円	55,778,109円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	2,454,327,535円	1,901,956,624円
D-I's 外国株式インデッ クス	1,080,494円	1,474,975円
DCダイワ外国株式インデッ クス	19,816,726,749円	20,512,600,044円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	404,159,831円	452,732,808円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	574,230,884円	623,597,529円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	407,312,710円	491,420,954円
大和DC海外株式インデック スファンド	1,474,330,436円	1,406,631,036円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	6,644,893円	7,648,234円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	9,404,656円	13,014,049円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,985,056円	2,985,761円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	4,627,190円	207,864円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	30,611,679円	1,203,627円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	20,450,186円	18,503,727円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	178,130,353円	163,351,857円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	2,710,722,413円	2,140,275,783円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	665,345,093円	533,285,293円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,337,064,025円	5,345,204,620円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	281,738,024円	244,716,827円

ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	134,587,395円	269,990,197円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,009,097,274円	2,980,922,871円
ダイワライフスタイル25	19,098,014円	21,630,820円
ダイワライフスタイル50	63,402,328円	68,685,540円
ダイワライフスタイル75	48,682,936円	54,127,675円
計	40,934,323,072円	38,798,220,086円
2. 期末日における受益権の総数	40,934,323,072口	38,798,220,086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26年12月19日 至 平成27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であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成27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 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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	2,842,004,079	2,283,954,721
投資証券	4,280,226	6,553,724
合計	2,846,284,305	2,290,508,445

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成26年12月2日から平成26年12月18日まで、及び平成27年12月1日から平成27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26年12月18日 現在				平成27年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,122,993,632	-	1,133,036,481	10,042,849	980,507,952	-	992,022,012	11,514,060

合計	1,122,993,632	-	1,133,036,481	10,042,849	980,507,952	-	992,022,012	11,514,060

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	平成26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.9284円	1.9983円
(1万口当たり純資産額)	(19,284円)	(19,983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	
	PALO ALTO NETWORK	1,500	186.570	279,855.000	
	JARDEN CORP	4,000	57.130	228,520.000	
	JAZZ PHARMACEUTI	1,300	138.890	180,557.000	
	SYNCHRONY FINANC	17,500	30.010	525,175.000	
	ABBOTT LABS	31,700	45.260	1,434,742.000	
	ALCOA INC	27,300	9.150	249,795.000	
	VERISK ANALYTI	3,300	76.910	253,803.000	
	LAS VEGAS SANDS	8,700	41.820	363,834.000	
	AMPHENOL CORP-A	6,600	52.730	348,018.000	
	FIDELITY NATIONA	6,029	59.880	361,016.520	
	QORVO INC	3,200	52.750	168,800.000	
	AFLAC INC	9,100	60.380	549,458.000	
	DARDEN RESTAURAN	2,900	58.390	169,331.000	
	ADOBE SYS INC	10,700	94.200	1,007,940.000	
CF INDUSTRIES HO	5,000	41.240	206,200.000		
LULULEMON ATH	2,500	50.000	125,000.000		

PEOPLE'S UNITED	6,800	16.260	110,568.000	
GARMIN LTD	2,600	35.520	92,352.000	
AETNA INC	7,479	108.860	814,163.940	
AIR PRODS & CHEM	4,300	130.360	560,548.000	
ALTERA CORP	6,500	52.990	344,435.000	
HONEYWELL INTL	15,800	102.310	1,616,498.000	
TOTAL SYS SERVS	3,751	52.790	198,015.290	
WR BERKLEY CORP	2,100	53.690	112,749.000	
AUTOZONE INC	670	755.310	506,057.700	
DOLLAR TREE INC	4,721	76.580	361,534.180	
PINNACLE WEST	2,400	63.590	152,616.000	
CELANESE CORP-A	3,300	65.920	217,536.000	
DR HORTON INC	7,166	31.520	225,872.320	
CONTL RES INC/OK	2,100	24.170	50,757.000	
DENTSPLY INTL	3,000	60.260	180,780.000	
AUTODESK INC	4,800	60.740	291,552.000	
MOODY'S CORP	3,900	97.880	381,732.000	
DEVON ENERGY CO	8,200	28.980	237,636.000	
ALBEMARLE CORP	2,400	52.420	125,808.000	
ALLIANT ENERGY	2,500	63.710	159,275.000	
CITIGROUP INC	63,323	52.840	3,345,987.320	
AUTOMATIC DATA	10,100	84.810	856,581.000	
AMERICAN ELECTRI	10,500	57.420	602,910.000	
NETSUITE INC	800	82.660	66,128.000	
ALLEGHANY CORP	350	478.870	167,604.500	
DUN & BRADSTREET	750	104.080	78,060.000	
HESS CORP	5,700	49.200	280,440.000	
DAVITA HEALTHCAR	3,600	68.120	245,232.000	
DANAHER CORP	13,100	91.890	1,203,759.000	
AVNET INC	2,800	43.810	122,668.000	
INTERCONTINENTAL	2,370	248.370	588,636.900	
UNDER ARMOUR-A	3,800	81.270	308,826.000	
ARCHER-DANIELS	13,400	34.290	459,486.000	
BUNGE LTD	3,100	64.040	198,524.000	
TE CONNECTIVITY	8,825	63.390	559,416.750	
APPLE INC	120,500	108.980	13,132,090.000	
DISCOVER FINANCI	9,400	53.880	506,472.000	
BOEING CO/THE	13,600	145.560	1,979,616.000	
CINCINNATI FIN	3,215	59.650	191,774.750	



SPECTRA ENERG	14,096	22.940	323,362.240	
BECTON DICKINSON	4,437	155.910	691,772.670	
CDK GLOBAL INC	2,900	48.050	139,345.000	
COLUMBIA PIPELIN	6,700	19.670	131,789.000	
CH ROBINSON	3,100	64.200	199,020.000	
CR BARD INC	1,600	190.620	304,992.000	
BANK NY MELLON	24,071	41.260	993,169.460	
VERIZON COMMUNIC	85,954	46.100	3,962,479.400	
BERKSHIRE HATH-B	24,800	133.970	3,322,456.000	
ANSYS INC	1,900	91.360	173,584.000	
H&R BLOCK INC	5,100	33.680	171,768.000	
BB&T CORP	16,800	37.830	635,544.000	
BROADCOM CORP-A	11,650	56.480	657,992.000	
BAKER HUGHES INC	9,223	43.360	399,909.280	
BRISTOL-MYER SQB	35,600	69.280	2,466,368.000	
EDGEWELL PERSONA	1,300	75.850	98,605.000	
JPMORGAN CHASE	78,120	66.280	5,177,793.600	
LEGG MASON INC	2,150	39.070	84,000.500	
T ROWE PRICE GRP	5,600	71.010	397,656.000	
CIGNA CORP	5,550	143.000	793,650.000	
LKQ CORP	6,800	27.990	190,332.000	
RENAISSANCERE	1,000	111.020	111,020.000	
FRONTIER COMMUNI	22,142	4.790	106,060.180	
BROWN-FORMAN -B	2,500	101.490	253,725.000	
AMERIPRISE FINAN	3,960	105.100	416,196.000	
DOLLAR GENERAL C	6,500	71.540	465,010.000	
SERVICENOW INC	3,000	87.270	261,810.000	
CATERPILLAR INC	12,100	64.900	785,290.000	
CMS ENERGY CORP	6,000	36.200	217,200.000	
MOSAIC CO/THE	6,800	28.840	196,112.000	
DELTA AIR LI	4,400	51.030	224,532.000	
MEAD JOHNSON	4,400	77.590	341,396.000	
CORNING INC	26,600	18.090	481,194.000	
CISCO SYSTEMS	108,300	26.720	2,893,776.000	
DU PONT (EI)	19,200	65.230	1,252,416.000	
ISIS PHARM	2,600	58.200	151,320.000	
MORGAN STANLEY	31,700	32.380	1,026,446.000	
WABCO HOLDINGS	1,100	97.590	107,349.000	
DOW CHEMICAL CO	23,900	50.250	1,200,975.000	

AVAGO TECHNOLOGI	5,600	140.480	786,688.000	
UNITED THERAPEUT	900	158.140	142,326.000	
ENSCO PLC-CL A	4,900	15.390	75,411.000	
DICK'S SPORTING	2,000	36.190	72,380.000	
ACUITY BRANDS	900	232.700	209,430.000	
ALNYLAM PHARMACE	1,500	88.180	132,270.000	
ARAMARK	4,800	32.480	155,904.000	
DTE ENERGY CO	3,800	79.950	303,810.000	
CENTENE CORP	2,200	61.860	136,092.000	
CITIZENS FINANCI	9,000	26.480	238,320.000	
ENVISION HEALTHC	3,800	23.810	90,478.000	
GARTNER INC	1,700	90.490	153,833.000	
SPLUNK INC	2,600	54.300	141,180.000	
WHITEWAVE FOOD	3,600	38.170	137,412.000	
AGCO CORP	1,700	44.580	75,786.000	
DOMINION RES/VA	12,700	67.540	857,758.000	
MONSTER BEVERAGE	3,000	150.290	450,870.000	
DEERE & CO	6,600	76.910	507,606.000	
AIRGAS INC	1,500	137.490	206,235.000	
QUANTA SERVICES	4,900	19.860	97,314.000	
TIME WARNER INC	17,633	64.860	1,143,676.380	
VMWARE INC-CL A	1,900	57.080	108,452.000	
BAXALTA INC	11,600	37.240	431,984.000	
NASDAQ INC	2,700	56.080	151,416.000	
WESTLAKE CHEMICA	1,200	53.690	64,428.000	
CONS EDISON INC	6,200	64.220	398,164.000	
WYNDHAM WORLDWID	2,600	72.270	187,902.000	
HUNT (JB) TRANS	2,100	72.580	152,418.000	
COLGATE-PALMOLIV	18,400	67.330	1,238,872.000	
AMETEK INC	5,225	53.550	279,798.750	
CHURCH & DWIGHT	2,900	85.240	247,196.000	
TABLEAU SOFTWA-A	1,000	90.210	90,210.000	
LYONDELLBASELL-A	8,600	87.690	754,134.000	
COSTCO WHOLESALE	9,400	160.680	1,510,392.000	
SCANA CORP	2,900	61.430	178,147.000	
KEURIG GREEN MOU	2,600	88.870	231,062.000	
AFFIL MANAGERS	1,200	157.730	189,276.000	
CHIPOTLE MEXICAN	650	554.890	360,678.500	
LEUCADIA NATL	6,600	16.360	107,976.000	

CUMMINS INC	3,700	85.960	318,052.000	
ACTIVISION BLIZZ	10,900	38.870	423,683.000	
HANESBRANDS INC	8,500	29.350	249,475.000	
HILTON WORLDWIDE	10,700	22.120	236,684.000	
TRANSDIGM GROUP	1,100	219.680	241,648.000	
SBA COMM CORP-A	2,800	101.010	282,828.000	
NIELSEN HOLDINGS	7,600	46.250	351,500.000	
KINDER MORGAN IN	39,381	15.370	605,285.970	
HCA HOLDINGS INC	7,100	64.740	459,654.000	
CABOT OIL & GAS	8,800	15.350	135,080.000	
T-MOBILE US INC	5,950	39.200	233,240.000	
ZILLOW GRO-C	1,800	24.430	43,974.000	
COCA-COLA CO/THE	87,800	43.490	3,818,422.000	
COCA-COLA ENTER	4,700	49.010	230,347.000	
EXPEDITORS INTL	4,000	46.310	185,240.000	
EATON VANCE CORP	2,500	31.890	79,725.000	
FMC TECHNOLOGIES	4,900	29.040	142,296.000	
FRANKLIN RES INC	8,700	35.450	308,415.000	
CSX CORP	20,800	25.600	532,480.000	
FLUOR CORP	3,300	46.120	152,196.000	
LABORATORY CP	2,200	121.680	267,696.000	
EXPEDIA INC	2,175	128.670	279,857.250	
AUTOLIV INC	1,850	124.190	229,751.500	
AMAZON.COM INC	8,400	670.650	5,633,460.000	
FLOWSERVE CORP	2,900	40.800	118,320.000	
EDWARDS LIFE	4,600	80.990	372,554.000	
EXXON MOBIL CORP	88,055	77.960	6,864,767.800	
FLIR SYSTEMS	3,100	28.450	88,195.000	
AES CORP	14,300	9.200	131,560.000	
L-3 COMM HLDGS	1,800	117.650	211,770.000	
EVEREST RE GROUP	1,000	181.910	181,910.000	
EOG RESOURCES	11,600	73.300	850,280.000	
EQT CORP	3,200	47.750	152,800.000	
AKAMAI TECHNOLOG	3,900	52.590	205,101.000	
AMERISOURCEBERGE	4,400	102.340	450,296.000	
AGILENT TECH INC	7,290	40.780	297,286.200	
FORD MOTOR CO	79,123	13.980	1,106,139.540	
MACY'S INC	7,398	34.500	255,231.000	
DISCOVERY COMM-A	3,440	26.480	91,091.200	

LIBERTY GLOBAL-A	5,387	40.050	215,749.350	
LIBERTY MEDIA -A	2,100	38.580	81,018.000	
DISCOVERY COMM-C	5,820	25.380	147,711.600	
MOBILEYE NV	1,700	40.160	68,272.000	
NEXTERA ENERGY	9,500	103.410	982,395.000	
FREEMPORT-MCMORAN	22,308	6.120	136,524.960	
US BANCORP	37,900	43.830	1,661,157.000	
UNITED RENTALS	2,200	66.900	147,180.000	
F5 NETWORKS	1,600	98.940	158,304.000	
FASTENAL CO	6,000	39.990	239,940.000	
FISERV INC	5,000	92.910	464,550.000	
GENERAL ELECTRIC	199,400	30.550	6,091,670.000	
NORWEGIAN CRUISE	3,300	57.110	188,463.000	
GOODYEAR TIRE	5,600	32.500	182,000.000	
GENERAL MOTORS C	30,800	34.110	1,050,588.000	
TRIPADVISOR INC	2,500	85.380	213,450.000	
LINKEDIN CORP-A	2,300	231.150	531,645.000	
GENERAL DYNAMICS	5,700	138.160	787,512.000	
GOLDMAN SACHS GP	8,300	182.610	1,515,663.000	
GAMESTOP CORP-A	2,300	29.050	66,815.000	
ALPHABET INC-A	6,150	769.830	4,734,454.500	
ALPHABET INC-C	6,567	749.430	4,921,506.810	
GENERAL MILLS IN	12,600	57.230	721,098.000	
FIRSTENERGY CORP	8,768	31.530	276,455.040	
GENUINE PARTS CO	3,300	85.870	283,371.000	
FIFTH THIRD BANC	17,500	20.285	354,987.500	
MEDIVATION INC	3,400	43.660	148,444.000	
HARRIS CORP	2,500	83.120	207,800.000	
AMERICAN AIRLINE	3,800	42.460	161,348.000	
HALLIBURTON CO	18,400	34.180	628,912.000	
HOME DEPOT INC	27,000	131.350	3,546,450.000	
ASSURANT INC	1,600	80.890	129,424.000	
HUNTINGTON BANC	17,800	11.120	197,936.000	
HERSHEY CO/THE	3,300	89.830	296,439.000	
HARLEY-DAVIDSON	4,500	45.420	204,390.000	
HUMANA INC	3,200	176.880	566,016.000	
STARWOOD HOTELS	3,800	66.940	254,372.000	
NXP SEMICONDUCTO	2,600	84.580	219,908.000	
HELMERICH & PAYN	2,300	51.800	119,140.000	

HENRY SCHEIN INC	1,800	155.200	279,360.000	
HP INC	39,200	11.900	466,480.000	
HEWLETT PACKA	39,200	14.310	560,952.000	
HOLLYFRONTIER CO	3,900	42.260	164,814.000	
ARCH CAPITAL GRP	2,800	69.930	195,804.000	
HARMAN INTL	1,400	91.300	127,820.000	
KRAFT HEINZ CO/T	12,803	71.920	920,791.760	
IBM	19,900	136.750	2,721,325.000	
INTL PAPER CO	8,600	37.720	324,392.000	
FORTUNE BRANDS H	3,200	55.300	176,960.000	
ZOETIS INC	10,300	46.730	481,319.000	
INGERSOLL-RAND	5,729	53.420	306,043.180	
CHENIERE ENERGY	4,700	37.280	175,216.000	
LEGGETT & PLATT	3,100	43.280	134,168.000	
LIBERTY GLOBAL-C	13,423	38.560	517,590.880	
JUNIPER NETWORKS	7,500	29.110	218,325.000	
JM SMUCKER CO	2,400	123.640	296,736.000	
JOHNSON&JOHNSON	58,500	103.640	6,062,940.000	
ABBVIE INC	35,029	56.380	1,974,935.020	
HOLOGIC INC	5,100	38.400	195,840.000	
KIMBERLY-CLARK	7,700	125.840	968,968.000	
KROGER CO	20,000	41.940	838,800.000	
KLA-TENCOR CORP	3,300	68.050	224,565.000	
LOCKHEED MARTIN	5,700	215.220	1,226,754.000	
FLEETCOR TECHNOL	1,700	142.790	242,743.000	
L BRANDS INC	5,300	96.580	511,874.000	
LOWE'S COS INC	19,600	74.900	1,468,040.000	
ELI LILLY & CO	21,100	86.220	1,819,242.000	
LEVEL 3 COMM INC	6,500	52.110	338,715.000	
LAM RESEARCH	3,300	78.700	259,710.000	
RANGE RESOURCES	3,700	21.170	78,329.000	
JONES LANG LASAL	900	162.880	146,592.000	
LOEWS CORP	6,100	36.960	225,456.000	
LINCOLN NATL CRP	5,449	50.240	273,757.760	
MCDONALDS CORP	19,900	117.500	2,338,250.000	
3M CO	13,200	148.850	1,964,820.000	
FACEBOOK INC-A	45,600	106.220	4,843,632.000	
MANPOWERGROUP IN	1,700	84.150	143,055.000	
MCGRAW HILL FINA	5,800	95.320	552,856.000	

MARTIN MAR MTL5	1,200	142.740	171,288.000	
CONCHO RESOURCES	2,800	95.470	267,316.000	
PHILLIPS 66	11,300	81.780	924,114.000	
MURPHY OIL CORP	3,600	21.800	78,480.000	
MGM RESORTS INTE	9,300	21.450	199,485.000	
MATTEL INC	7,200	26.850	193,320.000	
MCCORMICK-N/V	2,500	84.790	211,975.000	
MYLAN NV	8,700	52.970	460,839.000	
METLIFE INC	20,300	47.470	963,641.000	
MARVELL TECH GRP	8,400	8.470	71,148.000	
MOTOROLA SOLUTIO	3,428	68.560	235,023.680	
MONSANTO CO	9,806	95.740	938,826.440	
METTLER-TOLEDO	600	332.060	199,236.000	
ROCKWELL AUTOMAT	2,800	100.020	280,056.000	
MERCK & CO	59,821	52.660	3,150,173.860	
MASCO CORP	7,400	28.370	209,938.000	
M&T BANK CORP	3,219	124.740	401,538.060	
MARSH & MCLENNAN	11,500	55.780	641,470.000	
MARRIOTT INTL-A	4,782	66.030	315,755.460	
WORKDAY INC-A	2,200	80.520	177,144.000	
MICHAEL KORS HOL	4,400	39.430	173,492.000	
TOWERS WATSON-A	1,500	131.970	197,955.000	
VANTIV INC -CL A	3,300	48.540	160,182.000	
FIREEYE INC	2,200	21.150	46,530.000	
REALOGY HOLDINGS	3,200	37.760	120,832.000	
NETAPP INC	6,700	28.300	189,610.000	
NIKE INC -CL B	14,300	130.220	1,862,146.000	
NORFOLK SOUTHERN	6,500	85.060	552,890.000	
MICROCHIP TECH	4,500	46.440	208,980.000	
RAYMOND JAMES	2,700	58.960	159,192.000	
ALLY FINANCIAL I	9,300	18.430	171,399.000	
NORTHROP GRUMMAN	3,900	188.310	734,409.000	
DELPHI AUTOMOTIV	6,200	83.460	517,452.000	
NEWMONT MINING	11,500	17.610	202,515.000	
ADT CORP/THE	3,962	33.150	131,340.300	
MCKESSON CORP	4,900	190.020	931,098.000	
MAXIM INTEGRATED	6,000	37.590	225,540.000	
XYLEM INC	3,800	36.460	138,548.000	
PHILIP MORRIS IN	33,000	89.080	2,939,640.000	

NUCOR CORP	6,800	38.470	261,596.000	
WESTERN UNION	11,346	18.130	205,702.980	
NEWELL RUBBERMAI	6,000	44.820	268,920.000	
OCCIDENTAL PETE	16,300	66.420	1,082,646.000	
LIBERTY MEDIA -C	4,500	37.300	167,850.000	
PAYCHEX INC	6,800	53.350	362,780.000	
PATTERSON COS	1,900	44.400	84,360.000	
O'REILLY AUTOMOT	2,100	254.350	534,135.000	
ALTRIA GROUP INC	41,100	58.430	2,401,473.000	
PG&E CORP	10,200	53.850	549,270.000	
PFIZER INC	131,363	32.330	4,246,965.790	
ALKERMES PLC	3,200	77.690	248,608.000	
XCEL ENERGY INC	10,600	36.400	385,840.000	
STRYKER CORP	7,200	92.710	667,512.000	
PARKER HANNIFIN	2,900	95.190	276,051.000	
PIONEER NATURAL	3,200	130.510	417,632.000	
POLARIS INDS	1,400	85.010	119,014.000	
PROCTER & GAMBLE	57,737	80.290	4,635,703.730	
EXELON CORP	18,722	26.600	498,005.200	
ALEXION PHARM	4,800	185.790	891,792.000	
CONOCOPHILLIPS	26,400	47.280	1,248,192.000	
PEPSICO INC	30,900	100.200	3,096,180.000	
PRUDENTL FINL	9,700	81.850	793,945.000	
AMERICAN WATER W	3,800	59.290	225,302.000	
ACCENTURE PLC-A	13,400	103.260	1,383,684.000	
AXIS CAPITAL	2,200	55.750	122,650.000	
PENTAIR PLC	4,005	49.580	198,567.900	
QUALCOMM INC	33,300	47.540	1,583,082.000	
PARTNERRE LTD	1,000	138.990	138,990.000	
INVESCO LTD	9,050	31.190	282,269.500	
ADVANCE AUTO PAR	1,550	153.070	237,258.500	
PRINCIPAL FINL	6,200	45.230	280,426.000	
ENERGEN CORP	1,700	44.670	75,939.000	
RAYTHEON CO	6,600	127.470	841,302.000	
SCRIPPS NET-CL A	1,800	54.280	97,704.000	
RED HAT INC	3,900	78.860	307,554.000	
REGENERON PHARM	1,600	551.490	882,384.000	
REPUBLIC SVCS	5,300	43.840	232,352.000	
PRICELINE GROUP	1,100	1,313.740	1,445,114.000	

ROSS STORES INC	8,800	53.860	473,968.000	
PACKAGING CORP	2,100	61.960	130,116.000	
RESMED INC	3,000	55.190	165,570.000	
QUEST DIAGNOSTIC	3,100	68.850	213,435.000	
ROBERT HALF INTL	2,800	45.810	128,268.000	
REYNOLDS AMERICA	18,478	45.500	840,749.000	
RITE AID CORP	19,600	7.880	154,448.000	
RALPH LAUREN COR	1,300	112.750	146,575.000	
AUTONATION INC	1,700	59.760	101,592.000	
ROCKWELL COLLINS	2,700	89.740	242,298.000	
REGIONS FINANCIA	28,835	9.730	280,564.550	
CHEVRON CORP	40,018	90.540	3,623,229.720	
EDISON INTL	6,900	60.900	420,210.000	
TESLA MOTORS	2,000	233.390	466,780.000	
SYMANTEC CORP	14,700	20.160	296,352.000	
ENDO INTERNATIONAL	4,300	61.380	263,934.000	
STANLEY BLACK &	3,322	107.540	357,247.880	
SYNOPSYS INC	3,400	45.220	153,748.000	
CHARTER COM-A	1,800	183.030	329,454.000	
CBRE GROUP INC-A	6,400	35.380	226,432.000	
TWITTER INC	10,400	23.310	242,424.000	
NAVIENT CORP	8,700	12.480	108,576.000	
SANDISK CORP	4,400	74.830	329,252.000	
SOUTHERN CO	19,600	46.510	911,596.000	
SYSCO CORP	12,500	41.250	515,625.000	
TRAVELERS COS IN	6,823	113.270	772,841.210	
SOUTHWESTRN ENGY	7,900	5.150	40,685.000	
SEI INVESTMENTS	3,200	52.470	167,904.000	
STERICYCLE INC	1,800	118.660	213,588.000	
SCHLUMBERGER LTD	27,067	69.200	1,873,036.400	
SENSATA TECHNOLO	3,500	44.660	156,310.000	
AT&T INC	130,491	34.030	4,440,608.730	
SOUTHWEST AIR	3,800	43.510	165,338.000	
SHERWIN-WILLIAMS	1,700	263.200	447,440.000	
SEMPRA ENERGY	5,000	95.950	479,750.000	
TIFFANY & CO	2,800	73.230	205,044.000	
SEAGATE TECHNOLO	7,000	33.920	237,440.000	
TEXAS INSTRUMENT	21,700	56.530	1,226,701.000	
SALESFORCE.COM	13,300	78.430	1,043,119.000	



SIGNET JEWELERS	1,700	116.420	197,914.000	
WESTROCK CO	5,530	44.870	248,131.100	
TIME WARNER CABL	6,053	184.510	1,116,839.030	
TYCO INTERNATION	8,925	31.280	279,174.000	
TESORO CORP	2,800	105.950	296,660.000	
UNION PAC CORP	18,400	77.330	1,422,872.000	
MARATHON OIL	14,300	12.780	182,754.000	
MARATHON PETROLE	11,800	51.320	605,576.000	
UNITED TECH CORP	18,100	93.870	1,699,047.000	
UNITED PARCEL-B	15,000	100.000	1,500,000.000	
UNUM GROUP	5,400	33.070	178,578.000	
SPRINT CORP	17,765	3.600	63,954.000	
QUINTILES TRANSN	1,900	69.860	132,734.000	
VOYA FINANCIAL I	5,000	36.710	183,550.000	
AMEREN CORP	5,100	44.030	224,553.000	
UNITEDHEALTH GRP	20,326	119.220	2,423,265.720	
VERISIGN INC	2,200	87.850	193,270.000	
VALERO ENERGY	10,892	71.680	780,738.560	
ULTA SALON COSME	1,300	185.430	241,059.000	
FNF GROUP	5,238	33.070	173,220.660	
UNIVERSAL HLTH-B	2,000	116.120	232,240.000	
ANTHEM INC	5,700	139.010	792,357.000	
WALT DISNEY CO	33,900	112.010	3,797,139.000	
WELLS FARGO & CO	103,072	55.470	5,717,403.840	
FOOT LOCKER INC	2,900	64.010	185,629.000	
WASTE MANAGEMENT	9,600	53.280	511,488.000	
WILLIAMS COS INC	15,100	23.700	357,870.000	
TRACTOR SUPPLY	2,900	85.870	249,023.000	
WHITING PETROLEU	4,400	9.720	42,768.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	147.030	249,951.000	
WAL-MART STORES	34,300	58.980	2,023,014.000	
ZIMMER BIOMET HO	3,700	100.710	372,627.000	
WEATHERFORD INTE	16,800	8.610	144,648.000	
WYNN RESORTS LTD	1,800	64.270	115,686.000	
XEROX CORP	22,944	10.190	233,799.360	
WABTEC CORP	2,100	70.320	147,672.000	
TJX COS INC	14,500	70.650	1,024,425.000	
WATERS CORP	1,800	131.300	236,340.000	
UNITED CONTINENT	2,000	57.320	114,640.000	

ALLERGAN PLC	8,307	309.510	2,571,099.570	
WHOLE FOODS MKT	7,800	33.380	260,364.000	
WALGREENS BOOTS	18,600	83.340	1,550,124.000	
WILLIS GRP HLDGS	3,400	46.130	156,842.000	
WESTERN DIGITAL	4,900	59.400	291,060.000	
WEC ENERGY GROUP	6,730	51.260	344,979.800	
PUB SERV ENTERP	10,900	38.110	415,399.000	
VISA INC-CLASS A	41,000	78.690	3,226,290.000	
PPL CORP	14,300	33.920	485,056.000	
PEPCO HOLDINGS	5,600	26.280	147,168.000	
PULTEGROUP INC	7,400	17.750	131,350.000	
PPG INDS INC	5,800	98.240	569,792.000	
NORTHERN TRUST	4,900	71.970	352,653.000	
PRECISION CASTPT	3,000	231.490	694,470.000	
NVIDIA CORP	11,650	32.670	380,605.500	
PNC FINANCIAL SE	11,093	95.680	1,061,378.240	
LIBERTY INTER-A	9,550	26.400	252,120.000	
TERADATA CORP	3,200	26.820	85,824.000	
TYSON FOODS-A	6,500	52.880	343,720.000	
NETFLIX INC	8,600	122.510	1,053,586.000	
THERMO FISHER	8,500	138.160	1,174,360.000	
NRG ENERGY	7,100	9.520	67,592.000	
TORCHMARK CORP	2,675	56.990	152,448.250	
FIRST REPUBLIC B	3,100	66.520	206,212.000	
TEXTRON INC	5,900	41.420	244,378.000	
TWENTY-FIRST C-A	26,650	27.490	732,608.500	
TWENTY-FIRST - B	9,600	28.230	271,008.000	
NEWS CORP-CL A	8,337	13.360	111,382.320	
OGE ENERGY CORP	4,200	25.520	107,184.000	
OMNICOM GROUP	5,300	73.670	390,451.000	
ORACLE CORP	73,183	36.930	2,702,648.190	
MASTERCARD INC-A	21,400	99.330	2,125,662.000	
ONEOK INC	4,600	19.860	91,356.000	
OCEANEERING INTL	2,100	37.680	79,128.000	
CENTURYLINK INC	12,095	25.400	307,213.000	
ROPER TECHNOLOGI	2,100	184.600	387,660.000	
YUM! BRANDS INC	9,200	72.200	664,240.000	
ALLIANCE DATA	1,300	269.060	349,778.000	
MOLSON COORS-B	3,300	93.720	309,276.000	

NOBLE ENERGY INC	8,900	31.220	277,858.000	
BANK OF AMERICA	222,301	17.300	3,845,807.300	
BIOMARIN PHARMAC	3,400	100.640	342,176.000	
NORDSTROM INC	3,000	51.340	154,020.000	
AMERICAN EXPRESS	19,000	69.570	1,321,830.000	
ANALOG DEVICES	6,700	56.120	376,004.000	
TD AMERITRADE HO	6,000	34.830	208,980.000	
AMERICAN INTERNA	27,372	60.130	1,645,878.360	
ASHLAND INC	1,400	103.330	144,662.000	
ANADARKO PETROLE	10,900	46.730	509,357.000	
SKYWORKS SOLUTIO	4,100	77.800	318,980.000	
ROYAL CARIBBEAN	3,800	93.950	357,010.000	
MALLINCKRODT	2,500	71.620	179,050.000	
AVERY DENNISON	1,900	63.070	119,833.000	
COGNIZANT TECH-A	13,100	60.420	791,502.000	
EMERSON ELEC CO	14,100	45.000	634,500.000	
AON PLC	6,000	93.270	559,620.000	
AMGEN INC	16,200	161.430	2,615,166.000	
CORE LABS NV	1,000	111.670	111,670.000	
COACH INC	5,900	32.640	192,576.000	
EATON CORP PLC	10,086	50.130	505,611.180	
CELGENE CORP	16,900	112.170	1,895,673.000	
CONSTELLATION-A	3,700	139.890	517,593.000	
APPLIED MATERIAL	26,000	18.060	469,560.000	
CIT GROUP INC	3,900	40.500	157,950.000	
CIMAREX ENERGY C	1,900	95.740	181,906.000	
CME GROUP INC	6,900	94.970	655,293.000	
NATL OILWELL VAR	8,244	33.670	277,575.480	
ECOLAB INC	5,800	115.300	668,740.000	
EQUIFAX INC	2,600	113.200	294,320.000	
GAP INC/THE	5,000	25.200	126,000.000	
GILEAD SCIENCES	31,100	102.360	3,183,396.000	
ST JUDE MEDICAL	5,900	61.060	360,254.000	
DR PEPPER SNAPPL	4,148	93.030	385,888.440	
HORMEL FOODS CRP	3,200	79.490	254,368.000	
STATE ST CORP	8,943	66.400	593,815.200	
STAPLES INC	13,600	9.480	128,928.000	
SUNTRUST BANKS	11,048	43.240	477,715.520	
SCHWAB (CHARLES)	25,200	33.210	836,892.000	

IHS INC-CLASS A	1,500	116.630	174,945.000	
BAXTER INTL INC	11,600	37.540	435,464.000	
B/E AEROSPACE IN	2,300	41.810	96,163.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,000	53.140	212,560.000	
CROWN HOLDINGS I	3,100	48.900	151,590.000	
CHUBB CORP	4,900	131.010	641,949.000	
CARDINAL HEALTH	7,100	87.960	624,516.000	
FEDEX CORP	5,700	151.840	865,488.000	
CAPITAL ONE FINA	11,654	74.380	866,824.520	
FMC CORP	2,800	37.540	105,112.000	
FLEXTRONICS INTL	12,200	11.015	134,383.000	
CERNER CORP	6,600	60.380	398,508.000	
INTL FLVR & FRAG	1,800	118.090	212,562.000	
CITRIX SYSTEMS	3,400	77.660	264,044.000	
INTEL CORP	100,400	34.910	3,504,964.000	
CAMERON INTERNAT	4,100	62.560	256,496.000	
INTERPUBLIC GRP	8,800	22.490	197,912.000	
HARTFORD FINL SV	9,200	43.310	398,452.000	
ILLINOIS TOOL WO	7,000	92.550	647,850.000	
SIRIUS XM HOLDIN	55,300	4.020	222,306.000	
ILLUMINA INC	3,000	181.250	543,750.000	
CHESAPEAKE ENERG	11,900	3.720	44,268.000	
SEALED AIR CORP	4,400	43.070	189,508.000	
INTUITIVE SURGIC	800	539.070	431,256.000	
CHECK POINT SOFT	1,400	82.680	115,752.000	
SNAP-ON INC	1,200	170.450	204,540.000	
CALPINE CORP	7,200	12.500	90,000.000	
CABLEVISION SY-A	4,300	31.280	134,504.000	
CARMAX INC	4,600	57.150	262,890.000	
COMERICA INC	4,000	42.310	169,240.000	
CHICAGO BRIDGE &	2,300	38.320	88,136.000	
DUKE ENERGY CORP	14,828	70.500	1,045,374.000	
TARGET CORP	12,600	72.330	911,358.000	
DOVER CORP	3,500	59.460	208,110.000	
WW GRAINGER INC	1,300	194.850	253,305.000	
JACOBS ENGIN GRP	2,600	41.600	108,160.000	
JOHNSON CONTROLS	14,200	38.890	552,238.000	
CINTAS CORP	2,100	90.520	190,092.000	
CA INC	7,105	28.500	202,492.500	

CONAGRA FOODS	9,000	40.630	365,670.000	
CLOROX CO	2,800	131.340	367,752.000	
ENTERGY CORP	3,800	67.230	255,474.000	
MICROSOFT CORP	161,400	55.700	8,989,980.000	
INCYTE CORP	3,400	114.810	390,354.000	
CVS HEALTH CORP	23,574	94.710	2,232,693.540	
MEDTRONIC PLC	30,188	77.900	2,351,645.200	
MICRON TECH	23,000	14.320	329,360.000	
BLACKROCK INC	2,600	330.210	858,546.000	
CENTERPOINT ENER	9,100	17.840	162,344.000	
HASBRO INC	2,400	66.390	159,336.000	
KELLOGG CO	5,600	71.610	401,016.000	
KEYCORP	18,400	13.000	239,200.000	
KANSAS CITY SOUT	2,400	71.920	172,608.000	
MONDELEZ INTER-A	34,711	44.360	1,539,779.960	
KOHL'S CORP	4,400	44.450	195,580.000	
COOPER COS INC	1,000	136.440	136,440.000	
NY COMM BANCORP	10,000	16.680	166,800.000	
APACHE CORP	8,110	42.950	348,324.500	
ACE LTD	7,000	115.600	809,200.000	
ARROW ELECTRONIC	2,000	54.720	109,440.000	
ALLSTATE CORP	8,900	62.370	555,093.000	
EBAY INC	23,700	28.050	664,785.000	
PAYPAL HOLDINGS	23,400	35.540	831,636.000	
EASTMAN CHEMICAL	3,200	66.800	213,760.000	
XILINX INC	5,600	47.100	263,760.000	
EXPRESS SCRIPTS	14,310	86.650	1,239,961.500	
DISH NETWORK-A	4,700	58.140	273,258.000	
YAHOO! INC	19,300	33.230	641,339.000	
ESTEE LAUDER	4,900	89.210	437,129.000	
TOLL BROTHERS	3,800	33.880	128,744.000	
TRIMBLE NAVIG	5,400	21.930	118,422.000	
LINEAR TECH CORP	5,300	43.300	229,490.000	
LENNAR CORP-A	3,900	48.680	189,852.000	
LEAR CORP	1,700	122.070	207,519.000	
E*TRADE FINANCIA	5,700	29.950	170,715.000	
HERTZ GLOBAL HOL	8,300	14.410	119,603.000	
PROGRESSIVE CORP	12,800	31.480	402,944.000	
PRAXAIR INC	6,200	102.920	638,104.000	

PACCAR INC	7,637	45.440	347,025.280	
PVH CORP	1,700	74.090	125,953.000	
EMC CORP/MA	41,100	25.570	1,050,927.000	
BIOGEN INC	5,030	297.170	1,494,765.100	
STARBUCKS CORP	31,400	59.515	1,868,771.000	
PERRIGO CO PLC	3,100	146.260	453,406.000	
EVERSOURCE ENERG	6,680	51.720	345,489.600	
INTUIT INC	5,700	97.870	557,859.000	
BORGWARNER INC	4,800	41.070	197,136.000	
BEST BUY CO INC	6,500	29.800	193,700.000	
BALL CORP	2,800	70.520	197,456.000	
BOSTON SCIENTIFC	28,847	18.600	536,554.200	
BED BATH &BEYOND	3,600	51.710	186,156.000	
XL GROUP PLC	6,300	38.390	241,857.000	
ELECTRONIC ARTS	6,800	71.120	483,616.000	
VULCAN MATERIALS	2,900	94.700	274,630.000	
VERTEX PHARM	5,200	117.940	613,288.000	
VF CORP	7,100	62.460	443,466.000	
CBS CORP-B	9,471	46.520	440,590.920	
VIACOM INC-B	7,271	39.800	289,385.800	
MOHAWK INDS	1,300	193.340	251,342.000	
NUANCE COMMUNICA	6,000	20.485	122,910.000	
VARIAN MEDICAL S	2,200	78.450	172,590.000	
CARNIVAL CORP	8,700	50.460	439,002.000	
COMCAST CORP-A	52,170	57.405	2,994,818.850	
HONGKONG LAND	12,500	6.950	86,875.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 389,999,609.430 (47,771,052,159)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド
MERLIN	14,100	4.442	62,632.200	
TUI AG-DI	10,747	12.220	131,328.340	
BP PLC	397,900	3.403	1,354,053.700	
UNILEVER PLC	27,760	28.580	793,380.800	
BARCLAYS PLC	365,700	2.187	799,785.900	
ROLLS-ROYCE HOLD	39,400	5.735	225,959.000	
MARKS & SPENCER	35,300	4.580	161,674.000	
RANDGOLD RES LTD	1,900	39.770	75,563.000	

REXAM PLC	15,160	5.960	90,353.600
PRUDENTIAL PLC	56,300	15.035	846,470.500
INMARSAT PLC	9,400	11.300	106,220.000
ROYAL BK SCOTLAN	68,191	2.947	200,958.870
JOHNSON MATTHEY	4,409	26.160	115,339.440
BAE SYSTEMS PLC	67,700	4.963	335,995.100
AVIVA PLC	88,366	5.060	447,131.960
GLAXOSMITHKLINE	106,102	13.415	1,423,358.330
MELROSE INDUSTRI	24,042	2.852	68,567.780
AUTO TRADER	16,000	4.360	69,760.000
ROYAL MAIL	17,100	4.440	75,924.000
RELX PLC	24,746	11.740	290,518.040
BG GROUP PLC	74,400	9.458	703,675.200
DIAGEO PLC	54,900	18.335	1,006,591.500
RIO TINTO PLC	27,600	18.590	513,084.000
STANDARD CHARTER	55,700	5.499	306,294.300
TESCO PLC	175,300	1.448	253,834.400
FRESNILLO PLC	5,000	6.545	32,725.000
SMITH & NEPHEW	19,300	11.200	216,160.000
GLENORE PLC	236,925	0.808	191,435.400
HARGREAVES LANSD	5,700	14.740	84,018.000
SMITHS GRP PLC	8,433	9.270	78,173.910
BABCOCK INTL GRP	6,100	9.940	60,634.000
DIRECT LINE INSU	29,883	4.079	121,892.750
DIXONS CARPHONE	20,900	4.880	101,992.000
PEARSON PLC	17,363	7.515	130,482.940
SAINSBURY PLC	28,525	2.558	72,966.950
NEXT PLC	3,100	74.050	229,555.000
TAYLOR WIMPEY PL	68,900	1.979	136,353.100
WHITBREAD PLC	4,011	44.640	179,051.040
IMI PLC	5,850	8.535	49,929.750
BUNZL PLC	7,255	18.530	134,435.150
ABERDEEN ASSET	20,600	2.890	59,534.000
GKN PLC	36,500	2.996	109,354.000
SPORTS DIRECT IN	5,500	5.765	31,707.500
VODAFONE GROUP	577,383	2.147	1,239,641.300
CRODA INTL.	3,100	30.120	93,372.000
KINGFISHER PLC	51,911	3.294	170,994.830
WPP PLC	28,200	15.300	431,460.000

UNITED UTILITIES	14,727	9.255	136,298.380	
SEVERN TRENT	5,133	21.620	110,975.460	
RECKITT BENCKISE	13,900	61.750	858,325.000	
ST JAMES'S PLACE	11,000	9.885	108,735.000	
SCHRODERS PLC	2,700	29.330	79,191.000	
TATE & LYLE	10,100	5.890	59,489.000	
AMEC FOSTER WHEE	8,600	3.925	33,755.000	
SSE PLC	21,400	14.830	317,362.000	
WEIR GROUP PLC	4,800	9.480	45,504.000	
BARRATT DEV	21,200	6.150	130,380.000	
ASTRAZENECA PLC	27,600	44.340	1,223,784.000	
WOLSELEY PLC	5,615	37.000	207,755.000	
LEGAL & GEN GRP	130,600	2.634	344,000.400	
3I GROUP PLC	21,091	4.697	99,064.420	
SKY PLC	22,200	11.020	244,644.000	
ASHTED GROUP	11,200	11.270	126,224.000	
SAGE GROUP	24,114	5.890	142,031.460	
NATIONAL GRID PL	81,328	9.259	753,015.950	
LLOYDS BANKING	1,246,965	0.713	889,086.040	
RSA INSURANCE G	21,760	4.242	92,305.920	
IMPERIAL TOBACCO	20,700	35.170	728,019.000	
CENTRICA PLC	107,160	2.135	228,786.600	
PROVIDENT FIN	3,200	33.650	107,680.000	
ARM HOLDINGS	30,500	10.400	317,200.000	
BRIT AMER TOBACC	40,160	37.325	1,498,972.000	
ICAP PLC	12,000	5.030	60,360.000	
SABMILLER PLC	21,000	40.500	850,500.000	
BHP BILLITON PLC	45,577	7.000	319,039.000	
ASSOC BRIT FOODS	7,700	34.040	262,108.000	
HSBC HLDGS PLC	421,500	5.317	2,241,115.500	
SHIRE PLC	12,800	44.500	569,600.000	
OLD MUTUAL PLC	104,025	1.718	178,714.950	
ANGLO AMER PLC	29,883	2.635	78,741.700	
MONDI PLC	7,500	13.450	100,875.000	
WM MORRISON SUP	50,900	1.483	75,484.700	
CARNIVAL PLC	4,161	35.540	147,881.940	
EASYJET PLC	3,500	17.150	60,025.000	
COMPASS GROUP	36,641	11.530	422,470.730	
PERSIMMON	6,800	19.540	132,872.000	



	BT GROUP PLC	182,600	4.707	859,498.200	
	COCA-COLA HBC AG	4,400	15.060	66,264.000	
	WILLIAM HILL	19,200	3.800	72,960.000	
	BURBERRY GROUP	9,589	12.010	115,163.890	
	INTERCONTINENTAL	5,073	25.740	130,579.020	
	AGGREKO PLC	5,468	9.140	49,977.520	
	CAPITA PLC	14,290	12.100	172,909.000	
	TRAVIS PERKINS	5,300	19.350	102,555.000	
	INTERTEK GROUP	3,500	27.380	95,830.000	
	ITV PLC	82,500	2.675	220,687.500	
	PETROFAC LTD	5,600	7.890	44,184.000	
	LONDON STOCK EX	6,649	27.090	180,121.410	
	ROYAL DUTCH SH-A	84,900	14.500	1,231,050.000	
	ROYAL DUTCH SH-B	53,381	14.600	779,362.600	
	MEGGITT PLC	17,700	3.628	64,215.600	
	G4S PLC	34,600	2.156	74,597.600	
	COBHAM PLC	25,600	2.861	73,241.600	
	ADMIRAL GROUP	4,600	16.750	77,050.000	
	INVESTEC PLC	12,300	4.695	57,748.500	
	ANTOFAGASTA PLC	8,600	4.150	35,690.000	
	STANDARD LIFE	42,463	3.773	160,212.890	
	EXPERIAN PLC	20,954	11.680	244,742.720	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 33,705,335.780 (6,154,931,366)	
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	
	BEZEQ THE ISRAEL	56,400	8.242	464,848.800	
	ISRAEL CHEMICALS	14,000	16.700	233,800.000	
	TEVA PHARMA	18,900	253.700	4,794,930.000	
	BANK HAPOALIM	26,500	19.730	522,845.000	
	BANK LEUMI LE-IS	37,600	13.600	511,360.000	
	NICE SYSTEMS LTD	1,700	229.200	389,640.000	
	イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 6,917,423.800 (217,691,326)	
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	54,500	2.130	116,085.000	
	BHP BILLITON LTD	70,200	17.020	1,194,804.000	

SOUTH32 LTD	118,200	1.060	125,292.000	
LENDLEASE GROUP	12,100	13.450	162,745.000	
ASCIANO LTD	21,600	8.820	190,512.000	
ALUMINA LTD	69,900	1.100	76,890.000	
WOODSIDE PETRO	16,100	26.820	431,802.000	
FORTECUE METALS	39,700	1.835	72,849.500	
BENDIGO AND ADEL	11,800	11.240	132,632.000	
NATL AUST BANK	57,000	28.940	1,649,580.000	
WESTPAC BANKING	70,498	32.180	2,268,625.640	
SANTOS LTD	34,000	3.480	118,320.000	
AUST AND NZ BANK	60,200	26.530	1,597,106.000	
RIO TINTO LTD	9,700	43.360	420,592.000	
ORIGIN ENERGY	36,400	4.400	160,160.000	
AMCOR LTD	26,700	13.220	352,974.000	
AURIZON HOLDINGS	46,800	4.910	229,788.000	
OIL SEARCH LTD	29,500	6.110	180,245.000	
SEEK LTD	7,500	14.760	110,700.000	
TREASURY WINE ES	14,600	8.160	119,136.000	
NEWCREST MINING	17,600	12.840	225,984.000	
INCITEC PIVOT LT	45,600	3.750	171,000.000	
COMMONW BK AUSTR	37,000	80.690	2,985,530.000	
CALTEX AUST LTD	6,000	36.500	219,000.000	
ORICA LTD	8,300	14.970	124,251.000	
QBE INSURANCE	30,600	12.080	369,648.000	
CIMIC GROUP LTD	2,900	23.520	68,208.000	
WOOLWORTHS LTD	28,100	23.530	661,193.000	
COCA-COLA AMATIL	13,700	9.040	123,848.000	
TABCORP HLDGS	20,500	4.550	93,275.000	
CROWN RESORTS LT	10,600	11.580	122,748.000	
QANTAS AIRWAYS	14,554	3.900	56,760.600	
TELSTRA CORP	93,600	5.440	509,184.000	
AMP LTD	66,500	5.520	367,080.000	
JAMES HARDIE-CDI	11,400	16.280	185,592.000	
MACQUARIE GROUP	6,484	79.240	513,792.160	
CSL LTD	10,300	103.530	1,066,359.000	
WESFARMERS LTD	24,445	39.350	961,910.750	
COCHLEAR LTD	1,700	94.090	159,953.000	
SUNCORP GROUP LT	28,700	11.520	330,624.000	
BORAL LTD	22,700	5.510	125,077.000	

	ASX LTD	4,200	40.460	169,932.000	
	COMPUTERSHARE LT	13,900	11.360	157,904.000	
	HARVEY NORMAN	14,000	3.890	54,460.000	
	INSURANCE AUSTRALIA	51,100	5.390	275,429.000	
	SONIC HEALTHCARE	9,500	17.840	169,480.000	
	TRANSURBAN GROUP	42,400	10.160	430,784.000	
	ILUKA RESOURCES	12,000	5.450	65,400.000	
	SYDNEY AIRPORT	25,100	6.180	155,118.000	
	TATTS GROUP LTD	36,900	4.270	157,563.000	
	AGL ENERGY LTD	15,200	17.290	262,808.000	
	BRAMBLES LTD	34,900	11.050	385,645.000	
	APA GROUP	24,200	8.490	205,458.000	
	DUET GROUP	50,000	2.310	115,500.000	
	RAMSAY HEALTH	2,900	65.860	190,994.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 21,948,330.650 (1,914,772,366)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL	6,600	42.500	280,500.000	
	CONSTELLATION SO	400	582.130	232,852.000	
	PRAIRIESKY ROYAL	3,000	21.410	64,230.000	
	RESTAURANT BRAND	4,387	50.240	220,402.880	
	SILVER WHEATON	9,000	16.650	149,850.000	
	INTACT FINANCIAL	2,900	88.150	255,635.000	
	BCE INC	3,430	53.520	183,573.600	
	FRANCO-NEVADA CO	3,500	62.650	219,275.000	
	SUNCOR ENERGY	31,880	35.440	1,129,827.200	
	METRO INC	5,500	38.610	212,355.000	
	NATL BK CANADA	7,000	40.580	284,060.000	
	BANK OF NOVA SCO	26,600	57.150	1,520,190.000	
	CAN IMPL BK COMM	8,700	94.120	818,844.000	
	TORONTO-DOM BANK	40,400	54.900	2,217,960.000	
	GREAT-WEST LIFEC	6,700	34.760	232,892.000	
	MEG ENERGY CORP	3,800	7.690	29,222.000	
	ROYAL BANK OF CA	31,500	74.940	2,360,610.000	
	TOURMALINE OIL C	3,800	21.380	81,244.000	
	VERMILION ENERGY	2,500	36.250	90,625.000	
	TRANSCANADA CORP	15,400	46.560	717,024.000	
	PEMBINA PIPELINE	7,500	30.000	225,000.000	

BOMBARDIER INC-B	36,600	1.170	42,822.000	
BARRICK GOLD CRP	24,500	9.690	237,405.000	
CAE INC	7,400	15.170	112,258.000	
THOMSON REUTERS	7,804	52.810	412,129.240	
POTASH CORP SAS	17,800	24.010	427,378.000	
EMPIRE CO LTD A	3,900	25.240	98,436.000	
WEST FRASER TIMB	1,400	52.720	73,808.000	
VERESEN INC	6,200	8.560	53,072.000	
CCL INDS B	600	225.230	135,138.000	
ELEMENT FINANCIA	8,200	16.480	135,136.000	
LOBLAW COS LTD	4,860	65.300	317,358.000	
CAN UTILITIES-A	2,800	32.090	89,852.000	
ROGERS COMMUNI-B	8,100	47.450	384,345.000	
AGNICO EAGLE MIN	4,800	34.930	167,664.000	
KINROSS GOLD	29,500	2.480	73,160.000	
BANK OF MONTREAL	14,300	78.990	1,129,557.000	
POWER CORP CDA	8,000	29.690	237,520.000	
METHANEX CORP	2,200	44.730	98,406.000	
CAMECO CORP	9,200	16.250	149,500.000	
TELUS CORP	5,400	37.920	204,768.000	
POWER FINANCIAL	5,600	32.740	183,344.000	
TECK RESOURCES-B	12,100	4.330	52,393.000	
CANADIAN TIRE-A	1,700	119.130	202,521.000	
TURQUOISE HILL R	20,800	3.250	67,600.000	
AGRIUM INC	2,900	128.670	373,143.000	
CAN NATURAL RES	24,300	28.230	685,989.000	
FAIRFAX FINL HLD	450	646.890	291,100.500	
MAGNA INTL	8,900	57.300	509,970.000	
WESTON (GEORGE)	1,100	106.940	117,634.000	
BLACKBERRY LTD	11,900	10.890	129,591.000	
SUN LIFE FINANCI	13,200	43.660	576,312.000	
ENBRIDGE INC	18,900	43.900	829,710.000	
BROOKFIELD ASS-A	19,000	44.580	847,020.000	
MANULIFE FIN	42,500	20.430	868,275.000	
VALEANT PHARMACE	7,100	156.030	1,107,813.000	
GOLDCORP INC	17,759	15.260	271,002.340	
ENCANA CORP	18,400	6.960	128,064.000	
CANADIAN PACIFIC	3,400	177.300	602,820.000	
IND ALLIANCE INS	2,800	44.560	124,768.000	

	GILDAN ACTIVEWEA	5,200	40.280	209,456.000	
	CAN NATL RAILWAY	17,600	77.610	1,365,936.000	
	CGI GROUP INC-A	4,900	56.890	278,761.000	
	HUSKY ENERGY INC	7,400	14.170	104,858.000	
	ONEX CORP	2,000	84.150	168,300.000	
	SHAW COMM-B	8,700	24.900	216,630.000	
	FINNING INTL INC	3,900	18.050	70,395.000	
	SNC-LAVALIN GRP	3,400	42.220	143,548.000	
	ELDORADO GOLD	17,200	3.980	68,456.000	
	IGM FINANCIAL IN	2,300	35.470	81,581.000	
	OPEN TEXT CORP	2,800	66.550	186,340.000	
	CI FINANCIAL COR	4,800	30.660	147,168.000	
	SAPUTO INC	5,800	32.470	188,326.000	
	FIRST QUANTUM	14,700	3.870	56,889.000	
	ALIMEN COUCHE-B	9,000	62.210	559,890.000	
	YAMANA GOLD INC	20,100	2.510	50,451.000	
	FORTIS INC	6,100	37.840	230,824.000	
	CRESCENT POINT	10,500	15.260	160,230.000	
	CENOVUS ENERGY	18,300	17.440	319,152.000	
	DOLLARAMA INC	2,700	78.790	212,733.000	
	ALTAGAS LTD	3,100	30.290	93,899.000	
	KEYERA CORP	4,000	40.010	160,040.000	
	PEYTO EXPL & DEV	3,400	23.080	78,472.000	
	INTER PIPELINE L	7,400	22.030	163,022.000	
	CANADIAN OIL SAN	11,200	8.240	92,288.000	
	ARC RESOURCES LT	7,500	16.200	121,500.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 29,604,098.760 (2,598,647,790)	
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	29,000	19.110	554,190.000	
	DBS GROUP HLDGS	38,500	16.590	638,715.000	
	SINGAPORE AIRLIN	12,470	11.040	137,668.800	
	KEPPEL CORP LTD	31,500	6.470	203,805.000	
	UOL GROUP LTD	13,200	6.090	80,388.000	
	CITY DEVELOPS	11,200	7.540	84,448.000	
	CAPITALAND LTD	59,000	3.260	192,340.000	
	SEMBORP MARINE	25,000	1.785	44,625.000	

	SINGAP PRESS HLG	41,000	3.910	160,310.000	
	JARDINE CYCLE &	3,000	34.500	103,500.000	
	OCBC BANK	67,000	8.730	584,910.000	
	GENTING SINGAPOR	153,000	0.775	118,575.000	
	SINGAPORE TELECO	175,050	3.780	661,689.000	
	NOBLE GROUP LTD	115,181	0.420	48,376.020	
	SINGAP TECH ENG	35,000	2.960	103,600.000	
	SEMBCORP INDUS	29,000	3.040	88,160.000	
	GOLDEN AGRI-RESO	219,400	0.320	70,208.000	
	SINGAPORE EXCH	19,000	7.670	145,730.000	
	COMFORTDELGRO CO	46,800	2.970	138,996.000	
	WILMAR INTERNATI	56,000	2.920	163,520.000	
	GLOBAL LOGISTIC	69,000	2.060	142,140.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 4,465,893.820 (385,406,637)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFY AG-REG	900	118.500	106,650.000	
	UBS GROUP AG	80,200	19.130	1,534,226.000	
	ADECCO SA-REG	3,700	67.500	249,750.000	
	ROCHE HLDG-GENUS	15,350	270.100	4,146,035.000	
	PARGESA HOLDI-BR	800	62.250	49,800.000	
	SIKA AG-BR	54	3,529.000	190,566.000	
	LINDT&SPRUENGLI	2	74,125.000	148,250.000	
	ABB LTD-REG	48,300	17.770	858,291.000	
	ARYZTA AG	2,100	47.820	100,422.000	
	TRANSOCEAN LTD	8,450	12.930	109,258.500	
	SWISS RE AG	7,800	98.500	768,300.000	
	NESTLE SA-REG	69,150	73.550	5,085,982.500	
	PARTNERS GROUP J	350	361.750	126,612.500	
	SCHINDLER HLD-PC	1,000	167.500	167,500.000	
	CREDIT SUISS-REG	37,620	21.180	796,791.600	
	JULIUS BAER GROU	5,200	46.250	240,500.000	
	SULZER AG-REG	650	97.100	63,115.000	
	SGS SA-REG	130	1,869.000	242,970.000	
	SWATCH GROUP-BR	700	341.200	238,840.000	
	ZURICH INSURANCE	3,332	251.000	836,332.000	
	BALOISE HOL-REG	1,200	128.400	154,080.000	
	NOVARTIS AG-REG	49,650	85.200	4,230,180.000	

	CIE FINANCI-REG	11,450	71.950	823,827.500	
	SWISSCOM AG-REG	550	494.800	272,140.000	
	GEBERIT AG-REG	800	336.200	268,960.000	
	GIVAUDAN-REG	210	1,808.000	379,680.000	
	ACTELION LTD-REG	2,300	136.000	312,800.000	
	SYNGENTA AG-REG	2,012	371.300	747,055.600	
	SONOVA HOLDING A	1,300	125.200	162,760.000	
	LONZA GROUP -REG	1,300	159.200	206,960.000	
	SWATCH GROUP/THE	1,100	66.050	72,655.000	
	LAFARGEHOLCIM-RE	9,540	49.580	472,993.200	
	SWISS LIFE H AG	800	267.300	213,840.000	
	KUEHNE & NAGEL-R	1,250	135.600	169,500.000	
	SWISS PRIME -REG	1,400	76.400	106,960.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 24,654,583.400 (3,035,718,854)	
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	1,300	308.400	400,920.000	
	ERICSSON LM-B	65,530	78.900	5,170,317.000	
	VOLVO AB-B	32,400	78.900	2,556,360.000	
	MILLICOM INT-SDR	1,500	491.300	736,950.000	
	SKF AB- B SHARES	8,650	137.500	1,189,375.000	
	ELECTROLUX AB-B	5,450	204.900	1,116,705.000	
	NORDEA BANK AB	65,450	92.600	6,060,670.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,550	292.600	1,331,330.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	84.300	754,485.000	
	GETINGE AB-B SHS	4,700	214.400	1,007,680.000	
	SEB AB-A	32,050	88.000	2,820,400.000	
	SVENSKA HAN-A	32,100	112.500	3,611,250.000	
	SWEDBANK AB-A	19,900	186.800	3,717,320.000	
	HENNES & MAURI-B	20,800	301.500	6,271,200.000	
	SVENSKA CELL-B	12,400	246.500	3,056,600.000	
	SKANSKA AB-B	8,250	163.500	1,348,875.000	
	SANDVIK AB	22,350	75.200	1,680,720.000	
	INVESTOR AB-B	10,100	311.500	3,146,150.000	
	ATLAS COPCO-A	14,400	208.300	2,999,520.000	
	SECURITAS AB-B	9,200	128.900	1,185,880.000	
	TELIASONERA AB	55,800	42.540	2,373,732.000	

	ALFA LAVAL AB	7,000	154.100	1,078,700.000	
	ATLAS COPCO-B	8,300	196.100	1,627,630.000	
	ASSA ABLOY AB-B	21,100	180.500	3,808,550.000	
	LUNDIN PETROLEUM	6,400	124.300	795,520.000	
	BOLIDEN AB	6,000	136.700	820,200.000	
	HUSQVARNA-B SHS	12,550	56.950	714,722.500	
	KINNEVIK-B SHS	5,300	255.800	1,355,740.000	
	HEXAGON AB-B	5,550	314.100	1,743,255.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 64,480,756.500 (923,364,433)	
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-B	42,800	392.300	16,790,440.000	
	DANSKE BANK A/S	15,250	181.900	2,773,975.000	
	AP MOELLER-A	95	8,935.000	848,825.000	
	VESTAS WIND SYST	5,200	479.000	2,490,800.000	
	TDC A/S	19,300	34.490	665,657.000	
	CARLSBERG-B	2,450	608.000	1,489,600.000	
	NOVOZYMES-B SHS	5,500	331.500	1,823,250.000	
	COLOPLAST-B	2,500	538.000	1,345,000.000	
	DSV A/S	4,200	266.900	1,120,980.000	
	WILLIAM DEMANT	675	670.500	452,587.500	
	AP MOELLER-B	160	9,065.000	1,450,400.000	
	PANDORA A/S	2,500	853.500	2,133,750.000	
	CHR HANSEN HOLDI	2,000	415.800	831,600.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 34,216,864.500 (609,060,189)	
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	
	SPARK NEW ZEALAN	52,689	3.155	166,233.790	
	AUCKLAND AIRPORT	23,400	5.300	124,020.000	
	CONTACT ENERGY	13,000	4.710	61,230.000	
	FLETCHER BLDG	20,100	7.030	141,303.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 492,786.790 (40,393,733)	



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	29,900	30.050	898,495.000	
	DNB ASA	21,150	108.800	2,301,120.000	
	ORKLA ASA	19,050	69.700	1,327,785.000	
	TELENOR ASA	15,800	151.500	2,393,700.000	
	STATOIL ASA	24,173	122.500	2,961,192.500	
	SCHIBSTED ASA-A	1,500	291.600	437,400.000	
	YARA INTL ASA	3,760	389.400	1,464,144.000	
	GJENSIDIGE FORSI	3,950	141.700	559,715.000	
SCHIBSTED ASA-B	1,800	284.000	511,200.000		
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 12,854,751.500 (179,709,426)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	18,050	118.600	2,140,730.000	
	EVONIK INDUSTRIE	3,000	30.740	92,220.000	
	DEUTSCHE BANK-RG	29,950	21.875	655,156.250	
	COMMERZBANK	22,985	9.538	219,230.930	
	VOLKSWAGEN AG	800	139.150	111,320.000	
	VOLKSWAGEN-PREF	3,550	130.850	464,517.500	
	MAN SE	850	92.080	78,268.000	
	SIEMENS AG-REG	17,300	90.070	1,558,211.000	
	E.ON SE	44,500	8.596	382,522.000	
	BAYER MOTOREN WK	7,250	98.720	715,720.000	
	GEA GROUP AG	4,200	37.765	158,613.000	
	OSRAM LICHT AG	1,910	39.330	75,120.300	
	CONTINENTAL AG	2,450	223.150	546,717.500	
	BASF SE	20,100	71.380	1,434,738.000	
	LINDE AG	4,050	132.700	537,435.000	
	K+S AG-REG	4,400	23.565	103,686.000	
	ALLIANZ SE-VINK	9,850	163.150	1,607,027.500	
	THYSSENKRUPP AG	7,800	17.280	134,784.000	
	HENKEL AG -PFD	3,900	102.950	401,505.000	
	RWE AG	10,800	11.180	120,744.000	
	DEUTSCHE LUFT-RG	5,050	14.140	71,407.000	
	FRAPORT AG	900	58.940	53,046.000	
BRENTAG AG	3,400	48.975	166,515.000		
FRESENIUS SE & C	8,400	65.630	551,292.000		
UNITED INTERN-RE	2,700	51.100	137,970.000		

SAP SE	21,492	72.930	1,567,411.560	
MUENCHENER RUE-R	3,650	185.800	678,170.000	
HEIDELBERGCEMENT	3,100	72.410	224,471.000	
PORSCHE AUTO-PRF	3,400	48.810	165,954.000	
BEIERSDORF AG	2,150	84.830	182,384.500	
MERCK KGAA	2,900	89.010	258,129.000	
ADIDAS AG	4,570	91.050	416,098.500	
HENKEL AG & CO K	2,200	87.720	192,984.000	
METRO AG	3,700	29.200	108,040.000	
DEUTSCHE TELEKOM	69,400	16.705	1,159,327.000	
FRESENIUS MEDICA	4,850	78.500	380,725.000	
DAIMLER AG	21,050	78.560	1,653,688.000	
QIAGEN NV	4,850	24.920	120,862.000	
INFINEON TECH	24,750	13.535	334,991.250	
HANNOVER RUECK S	1,400	109.950	153,930.000	
DEUTSCHE POST-RG	21,200	26.010	551,412.000	
DEUTSCHE BOERSE	4,150	78.250	324,737.500	
PROSIEBENSAT.1 M	4,750	47.815	227,121.250	
LANXESS AG	1,950	43.250	84,337.500	
DEUTSCHE WOHN-BR	7,650	25.085	191,900.250	
SYMRISE AG	2,800	61.900	173,320.000	
KABEL DEUTSCHLAN	550	108.000	59,400.000	
TELEFONICA DEUTS	12,800	5.102	65,305.600	
HUGO BOSS -ORD	1,400	76.910	107,674.000	
RTL GROUP	1,000	76.940	76,940.000	
VONOVIA SE	10,400	28.245	293,748.000	
KONINKLIJKE PHIL	20,476	24.135	494,188.260	
NN GROUP	4,800	32.110	154,128.000	
ARCELORMITTAL	21,300	3.445	73,378.500	
UNILEVER NV-CVA	35,150	40.160	1,411,624.000	
HEINEKEN NV	5,100	79.620	406,062.000	
RELX NV	21,419	15.450	330,923.550	
AEGON NV	40,744	5.116	208,446.300	
AHOLD NV	19,293	19.870	383,351.910	
AKZO NOBEL	5,500	62.830	345,565.000	
DSM (KONIN)	3,800	46.290	175,902.000	
WOLTERS KLUWER	6,900	30.790	212,451.000	
BOSKALIS WESTMIN	2,100	37.190	78,099.000	
ING GROEP NV	84,750	12.490	1,058,527.500	

KPN (KONIN) NV	68,450	3.479	238,137.550
ASML HOLDING NV	7,430	81.740	607,328.200
TNT EXPRESS	10,195	7.720	78,705.400
VOPAK	2,000	37.000	74,000.000
RANDSTAD HOLDING	2,650	57.100	151,315.000
HEINEKEN HLDG	2,300	71.510	164,473.000
GEMALTO	1,700	53.430	90,831.000
OCI NV	2,300	22.795	52,428.500
ALTICE NV -A	5,700	13.045	74,356.500
ALTICE NV -B	1,900	13.270	25,213.000
NUMERICABLE-SFR	2,300	37.530	86,319.000
TOTAL SA	47,100	41.900	1,973,490.000
MICHELIN	4,000	88.040	352,160.000
AIR LIQUIDE SA	7,548	105.950	799,710.600
KERING	1,600	158.350	253,360.000
SCHNEIDER ELECTR	12,300	53.460	657,558.000
BOUYGUES SA	4,250	35.830	152,277.500
BNP PARIBAS	23,150	53.280	1,233,432.000
PEUGEOT SA	9,350	16.140	150,909.000
NATIXIS	20,150	5.253	105,847.950
THALES SA	2,250	70.950	159,637.500
DANONE	12,600	63.120	795,312.000
CARREFOUR SA	12,100	27.230	329,483.000
SUEZ ENVIRONNEME	6,375	17.605	112,231.870
VIVENDI	25,041	19.425	486,421.420
L'OREAL	5,500	160.850	884,675.000
SAINT GOBAIN	10,500	39.700	416,850.000
LEGRAND SA	5,717	52.550	300,428.350
ALCATEL-LUCENT	60,200	3.538	212,987.600
CASINO GUICHARD	1,300	43.335	56,335.500
PERNOD RICARD SA	4,717	105.950	499,766.150
BIC	600	153.850	92,310.000
EURAZEO	1,024	63.020	64,532.480
REXEL SA	6,050	11.855	71,722.750
SOC GENERALE SA	15,800	43.190	682,402.000
LVMH MOET HENNE	6,050	148.900	900,845.000
ACCOR SA	4,400	40.295	177,298.000
CAP GEMINI	3,500	86.420	302,470.000
VALEO SA	1,650	139.450	230,092.500

PUBLICIS GROUPE	4,100	60.360	247,476.000	
BUREAU VERITAS S	6,050	18.540	112,167.000	
SODEXO	2,050	91.900	188,395.000	
INGENICO GROUP	1,200	118.500	142,200.000	
ZODIAC AEROSPACE	4,200	22.350	93,870.000	
ESSILOR INTL	4,450	116.400	517,980.000	
AXA	42,900	25.115	1,077,433.500	
CHRISTIAN DIOR	1,200	161.650	193,980.000	
LAGARDERE SCA	2,650	27.115	71,854.750	
TECHNIP SA	2,200	46.050	101,310.000	
EDENRED	4,750	17.200	81,700.000	
RENAULT SA	4,150	91.420	379,393.000	
HERMES INTL	570	319.150	181,915.500	
STMICROELECTRONI	13,700	6.174	84,583.800	
ATOS SE	1,800	78.940	142,092.000	
DASSAULT SYSTEME	2,800	74.740	209,272.000	
WENDEL	600	108.400	65,040.000	
ORANGE	43,300	15.650	677,645.000	
ALSTOM	4,650	27.220	126,573.000	
CNP ASSURANCES	3,750	12.100	45,375.000	
SANOFI	25,425	79.400	2,018,745.000	
VINCI SA	10,350	59.160	612,306.000	
AIRBUS GROUP SE	12,800	65.130	833,664.000	
VEOLIA ENVIRONNE	9,350	22.090	206,541.500	
CREDIT AGRICOLE	22,100	10.650	235,365.000	
ENGIE	31,673	16.280	515,636.440	
IMERYS SA	900	61.810	55,629.000	
EDF	5,550	12.905	71,622.750	
SES	6,950	25.050	174,097.500	
SAFRAN SA	6,350	64.570	410,019.500	
ILIAD SA	600	216.200	129,720.000	
ARKEMA	1,550	65.330	101,261.500	
ADP	750	107.050	80,287.500	
EUTELSAT COMMUNI	4,050	28.080	113,724.000	
SCOR SE	3,400	34.895	118,643.000	
GROUPE EUROTUNNE	10,450	11.320	118,294.000	
BOLLORE	16,600	4.248	70,516.800	
UCB SA	2,750	82.270	226,242.500	
KBC GROEP	5,450	57.560	313,702.000	

COLRUYT SA	2,000	48.000	96,000.000
DELHAIZE GROUP	2,300	91.150	209,645.000
GROUPE BRUX LAMB	1,700	76.250	129,625.000
SOLVAY SA-A	1,250	96.300	120,375.000
UMICORE	2,950	37.755	111,377.250
ANHEUSER-BUSCH I	17,400	116.100	2,020,140.000
AGEAS	4,790	42.840	205,203.600
PROXIMUS	3,500	30.000	105,000.000
UNIPOLSAI SPA	21,750	2.296	49,938.000
BANCO POPOLARE S	8,300	12.740	105,742.000
PRYSMIAN SPA	5,700	20.250	115,425.000
GENERALI ASSIC	25,343	17.120	433,872.160
SAIPEM SPA	6,100	7.440	45,384.000
MEDIOBANCA	14,615	8.810	128,758.150
TENARIS SA	10,550	10.780	113,729.000
UNICREDIT SPA	103,769	5.205	540,117.640
TELECOM ITALIA S	245,782	1.175	288,793.850
TELECOM ITAL-RSP	134,950	0.941	126,987.950
INTESA SANPAOLO	274,597	3.120	856,742.640
ATLANTIA SPA	8,907	24.490	218,132.430
ENI SPA	54,400	13.760	748,544.000
FINMECCANICA SPA	11,225	13.020	146,149.500
BANCA MONTE DEI	50,815	1.200	60,978.000
ENEL SPA	151,500	3.986	603,879.000
SNAM SPA	44,400	4.800	213,120.000
LUXOTTICA GROUP	3,700	60.400	223,480.000
UBI BANCA SPA	19,600	6.190	121,324.000
TERNA SPA	32,200	4.698	151,275.600
ENEL GREEN POWER	40,400	1.917	77,446.800
EXOR	2,100	41.470	87,087.000
CNH INDUSTRIAL N	20,900	6.420	134,178.000
FIAT CHRYSLER AU	19,350	12.880	249,228.000
TELEFONICA	96,927	10.745	1,041,480.610
ENDESA	6,850	18.835	129,019.750
BANCO POPULAR	40,473	3.242	131,213.460
BBVA	137,112	7.131	977,745.670
IBERDROLA SA	116,234	6.579	764,703.480
BANCO SABADELL	107,716	1.712	184,409.790
BANKINTER	13,100	6.762	88,582.200

REPSOL SA	22,300	10.755	239,836.500	
GRIFOLS SA	3,350	42.380	141,973.000	
BANCO SANTANDER	312,150	4.787	1,494,262.050	
ABERTIS	10,100	14.015	141,551.500	
AMADEUS IT HOLDI	9,600	39.795	382,032.000	
GAS NATURAL SDG	7,450	19.385	144,418.250	
MAPFRE SA	21,450	2.408	51,651.600	
CAIXABANK S.A	53,800	3.643	195,993.400	
ZARDOYA OTIS	4,550	10.800	49,140.000	
INTL CONS AIRLIN	18,000	8.247	148,446.000	
ACS	3,776	26.915	101,631.040	
AENA SA	1,450	110.100	159,645.000	
INDITEX	23,900	33.075	790,492.500	
ENAGAS SA	4,700	27.265	128,145.500	
RED ELECTRICA	2,500	79.470	198,675.000	
FERROVIAL SA	9,800	21.055	206,339.000	
DISTRIBUIDORA IN	18,700	5.530	103,411.000	
BANKIA SA	108,422	1.150	124,685.300	
UPM-KYMMENE OYJ	11,300	17.550	198,315.000	
NOKIA OYJ	77,650	6.495	504,336.750	
WARTSILA OYJ ABP	3,200	42.010	134,432.000	
STORA ENSO OYJ-R	13,100	8.600	112,660.000	
METSO OYJ	3,000	20.540	61,620.000	
ELISA OYJ	3,550	35.300	125,315.000	
SAMPO OYJ-A SHS	9,650	47.240	455,866.000	
FORTUM OYJ	9,450	13.320	125,874.000	
KONE OYJ-B	6,650	39.280	261,212.000	
NOKIAN RENKAAT	3,000	33.450	100,350.000	
NESTE OYJ	3,450	27.100	93,495.000	
ORION OYJ-CL B	2,050	31.600	64,780.000	
OMV AG	3,550	25.335	89,939.250	
ERSTE GROUP BANK	5,550	27.970	155,233.500	
VOESTALPINE AG	2,850	27.000	76,950.000	
RAIFFEISEN BANK	2,400	14.130	33,912.000	
ANDRITZ AG	1,600	45.595	72,952.000	
BANK IRELAND	661,800	0.336	222,364.800	
JERONIMO MARTINS	6,000	12.210	73,260.000	
EDP	49,500	3.159	156,370.500	
GALP ENERGIA	10,350	10.045	103,965.750	

	KERRY GROUP-A	3,400	76.100	258,740.000	
	CRH PLC	17,500	26.495	463,662.500	
ユーロ 小計				ユーロ 73,750,899.990 (9,796,332,045)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS	30,000	70.100	2,103,000.000	
	GALAXY ENTERTAIN	52,000	23.700	1,232,400.000	
	MTR CORP	32,000	37.100	1,187,200.000	
	SHK PPT	38,000	94.850	3,604,300.000	
	SINO LAND	88,000	11.360	999,680.000	
	CKH HOLDINGS	58,669	101.200	5,937,302.800	
	WHARF HLDG	29,000	42.550	1,233,950.000	
	SWIRE PACIFIC-A	12,500	84.450	1,055,625.000	
	CLP HOLDINGS	41,000	65.350	2,679,350.000	
	CATHAY PAC AIR	33,000	13.060	430,980.000	
	HENDERSON LAND D	25,806	47.450	1,224,494.700	
	HONG KG CHINA GS	149,493	14.980	2,239,405.140	
	HANG SENG BANK	16,800	147.200	2,472,960.000	
	WHEELLOCK & CO	25,000	31.750	793,750.000	
	NEW WORLD DEV	113,000	7.600	858,800.000	
	HKEX	24,500	200.800	4,919,600.000	
	LI & FUNG LTD	132,000	4.950	653,400.000	
	HANG LUNG PPT	52,000	17.600	915,200.000	
	ASM PACIFIC	6,500	58.550	380,575.000	
	YUE YUEN IND	21,000	25.500	535,500.000	
	NWS HOLDINGS	46,500	11.300	525,450.000	
	KERRY PPT	18,000	21.350	384,300.000	
	BANK EAST ASIA	29,040	27.450	797,148.000	
	SJM HOLDINGS LTD	47,000	5.480	257,560.000	
	SWIREPROPERTIES	30,000	22.850	685,500.000	
	CHEUNG KONG PROP	59,669	51.400	3,066,986.600	
	CKI HOLDINGS	15,000	70.350	1,055,250.000	
	AIA	262,800	47.100	12,377,880.000	
	SANDS CHINA LTD	54,000	26.300	1,420,200.000	
	SHANGRI-LA ASIA	30,000	6.960	208,800.000	
	TECHTRONIC IND	31,500	31.450	990,675.000	
	MGM CHINA	20,000	9.680	193,600.000	
	BOC HONG KONG HO	82,500	23.450	1,934,625.000	

	WYNN MACAU LTD	38,000	9.320	354,160.000	
	HKT-SS	57,000	9.810	559,170.000	
香港・ドル	小計			香港・ドル 60,268,777.240 (952,246,681)	
合計				74,579,327,005 [74,579,327,005]	

## (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 COMMUN	2,847	509,556.060	
		SIMON PROPERTY	6,587	1,274,386.890	
		BOSTON PROPERTIE	3,300	429,066.000	
		GENERAL GROWTH P	12,100	324,643.000	
		VORNADO RLTY TST	3,627	360,632.610	
		EQUITY RESIDENTI	7,900	636,582.000	
		EQUINIX INC	1,158	339,768.780	
		AMERICAN TOWER C	9,100	874,419.000	
		HOST HOTELS & RE	16,093	253,464.750	
		KIMCO REALTY	8,700	228,027.000	
		PLUM CREEK TIMBR	3,700	177,859.000	
		VENTAS INC	7,000	383,670.000	
		WEYERHAEUSER CO	11,094	339,920.160	
		AMERICAN CAPITAL	7,800	136,266.000	
		CROWN CASTLE INT	7,200	616,752.000	
		IRON MOUNTAIN	3,910	106,195.600	
		VEREIT INC	20,400	165,648.000	
		PROLOGIS INC	11,062	464,604.000	
		CAMDEN PROP TR	1,800	135,594.000	
		DUKE REALTY CORP	7,300	154,176.000	
		ESSEX PROPERTY	1,400	334,082.000	
		FED REALTY INVS	1,500	222,690.000	
		WELLTOWER INC	7,400	488,474.000	
		HCP INC	9,700	361,228.000	
		LIBERTY PROP	3,300	104,709.000	
		MACERICH CO	3,000	239,550.000	
		ANNALY CAPITAL M	19,800	186,912.000	
		REALTY INCOME	4,800	244,800.000	
		PUBLIC STORAGE	3,100	767,436.000	



	REGENCY CENTERS	2,100	142,233.000	
	SL GREEN REALTY	2,100	236,775.000	
	UDR INC	5,700	208,449.000	
	DIGITAL REALTY	2,800	206,836.000	
	EXTRA SPACE STOR	2,300	203,274.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 11,858,678.850 (1,452,569,572)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES	17,100	202,806.000	イギリス・ポンド
	SEGR0 PLC	16,750	71,757.000	
	HAMMERSON PLC	17,400	105,009.000	
	BRIT LAND CO PLC	20,900	166,050.500	
	INTU PROPERTIES	21,100	67,034.700	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 612,657.200 (111,877,332)	
オーストラリア・ドル	SCENTRE GROUP	116,322	476,920.200	オーストラリア・ドル
	DEXUS PROPERTY G	23,950	184,894.000	
	GPT GROUP	40,060	190,685.600	
	MIRVAC GROUP	93,400	185,866.000	
	STOCKLAND	51,500	216,300.000	
	WESTFIELD CORP	43,096	418,462.160	
	GOODMAN GROUP	38,200	239,514.000	
	VICINITY CENTRES	74,873	211,890.590	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 2,124,532.550 (185,344,220)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ES	48,000	108,000.000	シンガポール・ドル
	CAPITALAND MALL	63,200	121,976.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 229,976.000 (19,846,929)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO	2,150	504,390.000	ユーロ
	ICADE	750	45,892.500	
	GECINA SA	750	85,200.000	
	KLEPIERRE	4,150	171,519.500	

	FONCIERE DES REG	750	61,545.000	
ユーロ 小計			ユーロ 868,547.000 (115,369,098)	
香港・ドル	LINK REIT	49,500	香港・ドル 2,267,100.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 2,267,100.000 (35,820,180)	
投資証券 合計			1,920,827,331 [1,920,827,331]	
合計			1,920,827,331 [1,920,827,331]	

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 588銘柄 投資証券 34銘柄	97.0%	3.0%	64.3%
イギリス・ポンド	株式 108銘柄 投資証券 5銘柄	98.2%	1.8%	8.2%
イスラエル・シケル	株式 6銘柄	100%	-%	0.3%
オーストラリア・ドル	株式 55銘柄 投資証券 8銘柄	91.2%	8.8%	2.7%
カナダ・ドル	株式 86銘柄	100%	-%	3.4%
シンガポール・ドル	株式 21銘柄 投資証券 2銘柄	95.1%	4.9%	0.5%
スイス・フラン	株式 35銘柄	100%	-%	4.0%
スウェーデン・クローナ	株式 29銘柄	100%	-%	1.2%
デンマーク・クローネ	株式 13銘柄	100%	-%	0.8%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 222銘柄 投資証券 5銘柄	98.8%	1.2%	13.0%

香港・ドル	株式 投資証券	35銘柄 1銘柄	96.4%	3.6%	1.3%
-------	------------	-------------	-------	------	------

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	369,259,013	1,400,166,208
投資証券 2	170,023,126,500	203,884,987,250
派生商品評価勘定	-	10,569,554
未収入金	-	97,674,580
未収配当金	715,626,502	845,070,435
前払金	-	14,375,000
流動資産合計	171,108,012,015	206,252,843,027
資産合計	171,108,012,015	206,252,843,027
負債の部		
流動負債		
未払金	307,953,900	435,736,600
未払解約金	8,000	14,020,000
流動負債合計	307,961,900	449,756,600
負債合計	307,961,900	449,756,600
純資産の部		
元本等		
元本 1	73,244,127,617	89,610,737,405
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	97,555,922,498	116,192,349,022
元本等合計	170,800,050,115	205,803,086,427
純資産合計	170,800,050,115	205,803,086,427

負債純資産合計	171,108,012,015	206,252,843,027
---------	-----------------	-----------------

## 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26年12月19日 至 平成27年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1. 1期首	平成25年12月19日	平成26年12月19日
期首元本額	69,992,508,701円	73,244,127,617円
期中追加設定元本額	11,529,286,794円	20,981,162,237円
期中一部解約元本額	8,277,667,878円	4,614,552,449円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ - R E I Tオープン	8,479,749,838円	9,609,730,223円

ダイワJ - R E I Tオープン (毎月分配型)	62,217,826,982円	76,133,510,230円
ダイワJ - R E I Tオープン (年1回決算型)	245,075,420円	548,507,585円
DC・ダイワJ - R E I T オープン	1,855,855,042円	2,463,050,337円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,569,321円	3,361,662円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	3,361,031円	4,320,123円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	419,121円	783,940円
ダイワ・ノーロード J - R E I Tファンド	- 円	2,376,414円
ダイワ・インデックスセレク ト J - R E I T	439,270,862円	845,096,891円
計	73,244,127,617円	89,610,737,405円
2. 期末日における受益権の総数	73,244,127,617口	89,610,737,405口
3. 2 差入委託証拠金代用有価証券		先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 175,500,000円

## (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26年12月19日 至 平成27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であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における不動産投信指数先物取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 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27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 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26年12月18日現在	平成27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	18,702,365,406	17,644,873,811
合計	18,702,365,406	17,644,873,811

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成26年9月17日から平成26年12月18日まで、及び平成27年9月16日から平成27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26年12月18日 現在				平成27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	-	-	-	-	1,645,575,000	-	1,656,480,000	10,905,000
合計	-	-	-	-	1,645,575,000	-	1,656,480,000	10,905,000

## (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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.3319円	2.2966円
(1万口当たり純資産額)	(23,319円)	(22,966円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	9,387	3,961,314,000	
	MCUBS Mid City投資法人	5,154	1,909,557,000	
	森ヒルズリート	30,417	4,665,967,800	
	産業ファンド	6,830	3,940,910,000	

大和ハウスリート	6,794	3,267,914,000	
アドバンス・レジデンス	25,185	6,570,766,500	
ケネディクスレジデンシャル	6,763	2,021,460,700	
A P I 投資法人	11,536	6,021,792,000	
G L P 投資法人	50,250	5,773,725,000	
コンフォリア・レジデンシャル	9,179	2,076,289,800	
日本プロロジスリート	33,530	7,232,421,000	
星野リゾート・リート	1,488	1,819,824,000	
S I A 不動産投資	1,455	673,665,000	
イオンリート投資	21,121	2,923,146,400	
ヒューリックリート投資法	15,130	2,449,547,000	
日本リート投資法人	7,590	2,234,496,000	
インベスコ・オフィス・Jリート	10,504	1,076,660,000	
日本ヘルスケア投資法	1,413	244,731,600	
積水ハウス・リート投資	15,382	1,991,969,000	
トーセイ・リート投資法人	3,059	349,031,900	
ケネディクス商業リート	6,882	1,723,941,000	
ヘルスケア&メディカル投資	2,334	253,705,800	
サムティ・レジデンシャル	3,164	272,420,400	
ジャパン・シニアリビング	1,642	235,462,800	
野村不動産マスターF	72,106.5	10,751,079,150	
日本ビルファンド	27,355	16,002,675,000	
ジャパンリアルエステイト	25,365	14,660,970,000	
日本リテールファンド	49,444	11,574,840,400	
オリックス不動産投資	44,959	7,063,058,900	
日本プライムリアルティ	16,913	7,128,829,500	
プレミア投資法人	25,514	3,110,156,600	
東急リアル・エステート	18,939	2,884,409,700	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,755	1,627,792,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	53,303	8,581,783,000	
森トラスト総合リート	25,573	5,357,543,500	
インヴィンシブル投資法人	61,872	4,287,729,600	
フロンティア不動産投資	9,609	4,708,410,000	
平和不動産リート	19,534	1,640,856,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	17,048	3,905,696,800	
福岡リート投資法人	14,472	2,956,629,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	7,844	4,580,896,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	19,724	2,136,109,200	
いちごオフィスリート投資法人	27,439	2,304,876,000	
大和証券オフィス投資法人	9,377	5,963,772,000	



阪急リート投資法人	11,575	1,495,490,000	
スターツプロシード投資法人	3,367	566,329,400	
トップリート投資法人	3,410	1,573,715,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	14,486	3,575,144,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	60,913	5,713,639,400	
日本賃貸住宅投資法人	31,773	2,646,690,900	
ジャパンエクセレント投資法人	24,496	3,395,145,600	
投資証券 合計		203,884,987,250	
合計		203,884,987,250	

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

300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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	15,829,523	33,797,966
コール・ローン	24,865,522	23,257,211
株式	-	275,926
投資証券	2,055,905,282	2,753,587,911
未収入金	5,250	14,859
未収配当金	3,451,480	5,618,500
流動資産合計	2,100,057,057	2,816,552,373
資産合計	2,100,057,057	2,816,552,373
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	111	134
未払金	18,010,577	26,075,255
未払解約金	6,000	40,000
その他未払費用	13,581	-
流動負債合計	18,030,269	26,115,389
負債合計	18,030,269	26,115,389
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,288,622,228
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,079,120,427	1,501,814,756
元本等合計	2,082,026,788	2,790,436,984
純資産合計	2,082,026,788	2,790,436,984
負債純資産合計	2,100,057,057	2,816,552,373

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成26年12月19日 至 平成27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、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>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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1. 1期首期首元本額	平成25年12月19日 560,248,764円	平成26年12月19日 1,002,906,361円

期中追加設定元本額	498,128,275円	424,653,012円
期中一部解約元本額	55,470,678円	138,937,145円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
D - I ' s グローバル R E I T インデックス	3,174,666円	1,578,317円
D C ダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド	867,364,533円	1,046,671,568円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,906,582円	3,586,968円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2030	3,869,978円	4,599,958円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2040	474,979円	735,980円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバル R E I T	125,115,623円	231,449,437円
計	1,002,906,361円	1,288,622,228円
2. 期末日における受益権の総数	1,002,906,361口	1,288,622,228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26年12月19日 至 平成27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であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成27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 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26年12月18日現在	平成27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	-	18,776
投資証券	2,350,038	11,134,703
合計	2,350,038	11,115,927

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成26年12月2日から平成26年12月18日まで、及び平成27年12月1日から平成27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

	平成26年12月18日 現在	平成27年12月18日 現在
--	----------------	----------------

種 類	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	4,293,916	-	4,293,805	111	988,014	-	987,880	134
オーストラリア ・ドル	4,293,916	-	4,293,805	111	610,533	-	610,470	63
シンガポール ・ドル	-	-	-	-	172,590	-	172,560	30
ニュージーランド ・ドル	-	-	-	-	204,891	-	204,850	41
合計	4,293,916	-	4,293,805	111	988,014	-	987,880	134

## (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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.0760円	2.1654円
(1万口当たり純資産額)	(20,760円)	(21,654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	RMR GROUP-A	株 156	アメリカ・ドル 14.440	アメリカ・ドル 2,252.640	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 2,252.640 (275,926)	
合計				275,926 [275,926]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTE	1,600	45,280.000	
		NEW SENIOR INVES	2,000	20,220.000	
		URBAN EDGE P	2,082	47,677.800	
		XENIA HOTELS & R	2,500	39,275.000	
		AVALONBAY COMMUN	3,100	554,838.000	
		SIMON PROPERTY	7,047	1,363,383.090	
		GRAMERCY PROPERT	1,250	30,787.500	
		BOSTON PROPERTIE	3,500	455,070.000	
		BIOMED REALTY TR	4,600	108,514.000	
		APARTMENT INVEST	3,555	140,529.150	
		GENERAL GROWTH P	13,177	353,538.910	
		VORNADO RLTY TST	3,964	394,140.520	
		MONOGRAM RESIDEN	3,800	38,076.000	
		EASTERLY GOVERN	300	5,262.000	
		NATIONAL STORAGE	500	8,335.000	
		NEXPOINT RESI	500	6,370.000	
		ROUSE PROPER	861	12,742.800	
		CARE CAPITAL PRO	1,869	57,172.710	
		QTS REALTY TRU-A	900	38,979.000	
EQUITY RESIDENTI	8,200	660,756.000			
APPLE HOSPITALIT	3,500	72,380.000			
EPR PROPERTIES	1,400	80,374.000			
BLUEROCK RESIDEN	400	4,584.000			

CITY OFFICE REIT	300	3,498.000	
GLOBAL NET LEASE	3,800	32,794.000	
CHATHAM LODGING	900	18,837.000	
CHESAPEAKE LODGI	1,300	33,878.000	
RYMAN HOSPITALIT	1,200	63,456.000	
RETAIL OPPORTUNI	2,300	41,331.000	
ASHFORD HOSPITAL	613	8,968.190	
HOST HOTELS & RE	17,000	267,750.000	
AMERICAN HOMES-A	3,500	56,910.000	
CHAMBERS STREET	5,300	41,022.000	
DUPONT FABROS TE	1,500	48,030.000	
CORESITE REALTY	700	40,194.000	
HUDSON PACIFIC P	1,700	47,872.000	
CAMPUS CREST COM	1,300	8,788.000	
RLJ LODGING TRUS	2,900	66,381.000	
PHYSICIANS REALT	2,000	32,840.000	
AMERICAN RESIDEN	700	12,838.000	
ARMADA HOFFLER P	600	6,480.000	
CYRUSONE INC	1,500	54,075.000	
SILVER BAY REALT	800	12,488.000	
KIMCO REALTY	9,400	246,374.000	
HEALTHCARE TRU-A	2,850	76,437.000	
WHITESTONE REI	500	6,010.000	
GAMING AND LEISU	2,100	57,939.000	
PIEDMONT OFFIC-A	3,400	63,070.000	
STARWOOD WAYP	900	20,205.000	
WP GLIMCHER INC	4,060	42,914.200	
CORRECTIONS CORP	2,624	66,833.280	
STORE CAPITAL	1,500	34,425.000	
SUMMIT HOTEL PRO	1,900	23,085.000	
SOVRAN SELF STOR	800	84,368.000	
SELECT INCOME RE	1,400	27,468.000	
AMERICAN ASSETS	900	35,316.000	
INDEPENDENCE REA	582	4,458.120	
PREFERRED APAR-A	500	6,200.000	
EMPIRE STATE REA	2,700	49,329.000	
REXFORD INDUSTRI	1,300	21,255.000	
COLUMBIA PROPERT	2,800	65,072.000	
STAG INDUSTRIAL	1,500	28,515.000	



VENTAS INC	7,579	415,404.990	
CARETRUST REI	1,003	11,394.080	
NEW YORK REIT IN	3,600	41,364.000	
GEO GROUP INC/TH	1,700	45,883.000	
BRIXMOR PROPERTY	3,800	95,608.000	
GOVERNMENT PROPE	1,600	25,184.000	
SABRA HEALTH CAR	1,500	29,595.000	
UMH PROPERTIES I	600	6,138.000	
IRON MOUNTAIN	4,300	116,788.000	
TERRENO REALTY C	1,000	22,650.000	
VEREIT INC	20,508	166,524.960	
SPIRIT REALTY	9,900	99,297.000	
SUN COMMUNITIES	1,300	90,376.000	
ACADIA REALTY	1,611	53,920.170	
ALEXANDER'S INC	100	38,880.000	
PROLOGIS INC	11,846	497,532.000	
ALEXANDRIA REAL	1,600	145,376.000	
BRANDYWINE RLTY	4,000	52,160.000	
SAUL CENTERS INC	300	15,975.000	
CBL & ASSOC PROP	3,445	44,268.250	
MACK-CALI REALTY	2,000	46,080.000	
CAMDEN PROP TR	2,000	150,660.000	
COUSINS PROP	4,558	42,754.040	
DDR CORP	6,856	114,769.440	
DUKE REALTY CORP	7,800	164,736.000	
EASTGROUP PROP	700	39,186.000	
EQUITY ONE INC	1,700	45,305.000	
ESSEX PROPERTY	1,467	350,070.210	
FELCOR LODGING	2,900	21,489.000	
FIRST IND REALTY	2,500	55,000.000	
FED REALTY INVS	1,600	237,536.000	
GETTY REALTY	600	10,566.000	
WELLTOWER INC	8,000	528,080.000	
HCP INC	10,500	391,020.000	
HIGHWOODS PROP	2,200	94,908.000	
HOSPITALITY PROP	3,400	90,474.000	
HEALTHCARE RLTY	2,300	63,733.000	
EQUITY COMMONWEA	2,875	78,918.750	
KILROY REALTY	2,100	134,442.000	

LASALLE HOTEL PR	2,600	68,120.000	
LIBERTY PROP	3,400	107,882.000	
LTC PROPERTIES	800	33,848.000	
LEXINGTON REALTY	4,800	39,264.000	
MID-AMERICA APAR	1,724	155,763.400	
MACERICH CO	3,000	239,550.000	
EQUITY LIFESTYLE	1,800	118,224.000	
NATL HEALTH INV	800	48,696.000	
NATIONAL RETAIL	3,100	121,892.000	
REALTY INCOME	5,617	286,467.000	
CORP OFFICE PROP	2,100	46,536.000	
PENN REIT	1,600	35,120.000	
PARKWAY PPTYS/MD	1,800	28,692.000	
POST PROPERTIES	1,200	70,404.000	
PUBLIC STORAGE	3,300	816,948.000	
PS BUSINESS PARK	400	34,772.000	
REGENCY CENTERS	2,100	142,233.000	
RAMCO-GERSHENSON	1,800	29,808.000	
TANGER FACTORY	2,200	73,238.000	
SL GREEN REALTY	2,300	259,325.000	
SENIOR HOUSING	5,400	76,896.000	
TAUBMAN CENTERS	1,400	105,322.000	
URSTADT BIDDLE-A	600	11,946.000	
UDR INC	5,900	215,763.000	
UNIVERSAL HEALTH	300	15,060.000	
WP CAREY INC	2,200	134,134.000	
WASHINGTON REIT	1,500	41,715.000	
WEINGARTEN RLTY	2,600	89,830.000	
ASHFORD HOSPITAL	1,800	11,952.000	
AGREE REALTY	400	13,628.000	
OMEGA HEALTHCARE	3,750	129,075.000	
INLAND REAL ESTA	1,900	20,349.000	
CUBESMART	3,900	118,404.000	
SUNSTONE HOTEL	4,681	63,474.360	
DIGITAL REALTY	3,300	243,771.000	
CEDAR REALTY TRU	1,500	10,785.000	
EXTRA SPACE STOR	2,800	247,464.000	
FIRST POTOMAC RE	1,200	13,584.000	
WINTHROP REALTY	800	10,600.000	

	HERSHA HOSPITAL	1,075	24,284.250	
	INVESTORS REAL	2,800	20,832.000	
	KITE REALTY GROU	1,850	48,100.000	
	MONMOUTH REAL ES	1,400	14,854.000	
	ONE LIBERTY PROP	300	6,600.000	
	AMERICAN CAMPUS	2,500	102,250.000	
	EDUCATION REALTY	1,300	48,906.000	
	GLADSTONE COMMER	500	7,360.000	
	DIAMONDROCK HOSP	4,442	45,219.560	
	NORTHSTAR REALTY	4,250	71,782.500	
	NORTHSTAR REALTY	1,349	14,528.730	
	MEDICAL PROPERTI	5,400	61,506.000	
	FRANKLIN STREET	1,900	19,171.000	
	DOUGLAS EMMETT	3,200	96,960.000	
	DCT INDUSTRIAL T	2,000	75,400.000	
	RETAIL PROPRTIE	5,300	77,698.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 16,136,021.960 (1,976,501,330)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	36,100	19,746.700	
	EMPIRIC STUDENT	8,000	8,976.000	
	REDEFINE INTERNA	21,750	11,049.000	
	LAND SECURITIES	18,100	214,666.000	
	HANSTEEN HOLDING	16,000	18,560.000	
	SEGRO PLC	16,750	71,757.000	
	HAMMERSON PLC	17,700	106,819.500	
	BRIT LAND CO PLC	23,150	183,926.750	
	GREAT PORT EST	7,750	65,681.250	
	INTU PROPERTIES	18,450	58,615.650	
	DERWENT LONDON	2,500	92,175.000	
	PRIMARY HEALTH	9,400	9,823.000	
	WORKSPACE GROUP	2,650	25,493.000	
	SAFESTORE HOLDIN	4,500	15,912.000	
	SHAFTESBURY	6,300	57,582.000	
	MCKAY SECS-ORD	1,950	5,167.500	
	BIG YELLOW GROUP	3,300	26,548.500	
	LONDONMETRIC PRO	14,000	22,624.000	
	SCHRODER REAL ES	11,150	6,712.300	

	TRITAX BIG BOX R	15,300	19,568.700	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 1,041,403.850 (190,170,757)	
イスラエル・シケル	REIT 1 LTD	3,100	32,147.000	イスラエル・シケル
イスラエル・シケル 小計			イスラエル・シケル 32,147.000 (1,011,666)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	FOLKESTONE EDUCA	4,500	9,900.000	
	GALILEO JAPAN TR	2,500	4,700.000	
	CROMWELL PROPERT	27,500	28,600.000	
	SHOPPING CENTRES	16,500	35,475.000	
	GROWTHPOINT PROP	3,500	10,885.000	
	NATIONAL STORAGE	6,500	10,302.500	
	INDUSTRIA REIT	2,000	4,200.000	
	GDI PROPERTY GRO	10,000	8,900.000	
	360 CAPITAL OFFI	1,000	2,080.000	
	SCENTRE GROUP	120,500	494,050.000	
	ARENA REIT	4,500	7,650.000	
	HOTEL PROPERTY I	3,000	7,860.000	
	BWP TRUST	11,000	35,200.000	
	DEXUS PROPERTY G	21,509	166,049.480	
	GPT GROUP	40,500	192,780.000	
	INVESTA OFFICE F	14,000	56,980.000	
	CHARTER HALL RET	7,500	31,875.000	
	MIRVAC GROUP	82,500	164,175.000	
	STOCKLAND	54,000	226,800.000	
	WESTFIELD CORP	43,000	417,530.000	
	ABACUS PROPERTY	6,000	18,360.000	
	GOODMAN GROUP	35,500	222,585.000	
	VICINITY CENTRES	73,770	208,769.100	
	ASTRO JAPAN PROP	1,000	5,150.000	
	CHARTER HALL GRO	6,950	32,109.000	
	ALE PROPERTY GRP	4,000	15,320.000	
	ASPEN GROUP	1,500	1,890.000	
	INGENIA COMMUNIT	3,083	8,971.530	
	360 CAPITAL GROU	5,500	5,472.500	

オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 2,434,619.110 (212,396,172)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	ARTIS REAL ESTAT	1,500	19,185.000
	DREAM GLOBAL REA	1,200	10,056.000
	SLATE RETAIL REI	300	4,155.000
	NORTHWEST HEALTH	700	5,845.000
	BROOKFIELD CANAD	300	7,914.000
	GRANITE REAL EST	500	19,335.000
	DREAM INDUSTRIAL	600	4,230.000
	ONEREIT	1,000	3,230.000
	INTERRENT REAL E	800	5,200.000
	CHOICE PROPERTIE	900	10,539.000
	PURE INDUSTRIAL	1,900	8,037.000
	MORGUARD NORTH A	400	4,200.000
	MILESTONE APARTM	700	10,948.000
	CT REAL ESTATE I	700	9,163.000
	PLAZA RETAIL REI	1,000	4,650.000
	SMART REAL ESTAT	1,400	43,344.000
	CAN APARTMENT	1,400	38,108.000
	CAN REAL ESTATE	800	33,416.000
	COMINAR REA-TR U	1,790	26,295.100
	H&R REAL-REIT UT	3,066	62,117.160
	INNVEST REAL EST	1,400	7,308.000
	MORGUARD-TR UTS	700	9,310.000
RIOCAN REIT	3,600	89,856.000	
DREAM OFFICE REA	1,200	21,036.000	
BOARDWALK REAL E	500	24,070.000	
NORTHVIEW APARTM	500	8,340.000	
CROMBIE REAL EST	800	10,256.000	
ALLIED PROP REIT	900	29,376.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 529,519.260 (46,481,201)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	KEPPEL DC REIT	18,900	18,994.500
	FIRST REIT	11,800	13,924.000
	MAPLE TREE GREATE	39,700	36,325.500

	AIMS AMP CAPITAL	12,000	16,200.000	
	FRASERS HOSPITAL	12,300	9,102.000	
	CAPITALAND COMME	44,800	60,256.000	
	ASCENDAS REAL ES	46,200	103,950.000	
	CAPITALAND MALL	60,100	115,993.000	
	SUNTEC REIT	57,200	89,232.000	
	MAPLETREE LOG TR	33,600	34,104.000	
	KEPPEL REIT	39,000	36,270.000	
	FRASERS COMMERC	12,260	15,570.200	
	ASCOTT RESIDENCE	19,000	22,135.000	
	CAMBRIDGE REIT	23,579	13,675.820	
	CDL REIT	14,800	19,166.000	
	FRASERS CENTREPO	12,200	22,326.000	
	STARHILL GLOBAL	29,000	21,460.000	
	CAPITALAND RETAI	14,800	21,904.000	
	PARKWAYLIFE REIT	8,300	18,841.000	
	LIPPO MALLS	37,200	11,346.000	
	MAPLETREE INDUST	26,680	41,354.000	
	CACHE LOGISTICS	18,900	16,821.000	
	MAPLETREE COMMER	29,200	38,106.000	
	FAR EAST H TRUST	18,200	11,648.000	
	SPH REIT	17,100	16,330.500	
	SOILBBUILD BUSIN	14,300	10,367.500	
	SABANA SHARIAH	13,000	9,230.000	
	ASCENDAS HOSPITA	16,700	11,105.500	
	QUE HOSPITALITY	15,900	11,925.000	
	QUE COMM REIT	10,150	6,749.750	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 874,412.270 (75,461,779)	
	ニュージーランド・ドル		ニュージーランド・ド ル	
	STRIDE PROPERTY	8,000	17,200.000	
	ARGOSY PROPERTY	18,500	20,905.000	
	KIWI PROPERTY GR	28,500	38,475.000	
	PROP FOR INDUS	9,208	14,686.760	
	VITAL HEALTHCARE	6,000	11,220.000	
	GOODMAN PROPERTY	22,500	27,787.500	
	PRECINCT PROPERT	22,500	27,450.000	

ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 157,724.260 (12,928,658)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE	2,300	ユーロ 27,692.000
	HAMBORNER REIT	1,334	12,620.970
	WERELDHAVE NV	900	45,945.000
	UNIBAIL-RODAMCO	2,200	516,120.000
	EUROCOMMERCIAL -CVA	1,100	43,736.000
	NSI NV	2,904	11,383.680
	VASTNED RETAIL N	450	18,794.250
	ICADE	800	48,952.000
	ANF IMMOBILIER	200	4,284.000
	ALTAREA	50	8,900.000
	FONCIERE DES MUR	200	5,090.000
	GECINA SA	800	90,880.000
	KLEPIERRE	4,250	175,652.500
	FONCIERE DES REG	1,000	82,060.000
	AFFINE	150	2,410.500
	MERCIALYS	400	7,814.000
	AEDIFICA	306	18,332.460
	COFINIMMO	450	43,861.500
	BEFIMMO	450	24,669.000
	INTERVEST OFFICE	200	4,669.000
	RETAIL ESTATES	100	7,735.000
	WAREHOUSES DE PA	300	22,971.000
	WERELDHAVE BELGM	50	5,182.500
	BENI STABILI SPA	23,350	16,812.000
	IMMOBILIARE GRAN	6,650	5,951.750
	LAR ESPANA REAL	1,300	12,610.000
AXIARE PATRIMONI	1,250	16,500.000	
MERLIN PROPRIETIE	6,925	83,965.620	
IRISH RESIDENTIA	7,300	8,358.500	
GREEN REIT PLC	14,900	23,616.500	
HIBERNIA REIT PL	14,850	20,790.000	
ユーロ 小計			ユーロ 1,418,359.730 (188,400,722)
香港・ドル			香港・ドル

	YUEXIU REIT	24,000	99,120.000	
	SUNLIGHT REIT	22,000	82,940.000	
	FORTUNE REIT	31,000	237,770.000	
	PROSPERITY REIT	28,000	78,400.000	
	LINK REIT	52,000	2,381,600.000	
	NEW CENTURY REIT	10,000	28,500.000	
	SPRING REAL ESTA	15,000	44,400.000	
	REGAL REAL ESTAT	18,000	34,740.000	
	CHAMPION REIT	50,000	192,000.000	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 3,179,470.000 (50,235,626)	
投資証券	合計		2,753,587,911 [2,753,587,911]	
合計			2,753,587,911 [2,753,587,911]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 1銘柄 投資証券 156銘柄	100%	71.9%
イギリス・ポンド	投資証券 20銘柄	100%	6.9%
イスラエル・シュケル	投資証券 1銘柄	100%	0.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 29銘柄	100%	7.7%
カナダ・ドル	投資証券 28銘柄	100%	1.7%
シンガポール・ドル	投資証券 30銘柄	100%	2.7%
ニュージーランド・ドル	投資証券 7銘柄	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 31銘柄	100%	6.8%
香港・ドル	投資証券 9銘柄	100%	1.8%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。



## 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	77,648,369	250,562,351
国債証券	10,328,476,930	10,296,201,200
地方債証券	1,574,280,203	1,769,070,102
特殊債券	1,403,379,900	1,390,446,950
社債券	1,341,675,450	1,125,479,038
未収入金	2,380,620	-
未収利息	57,029,923	53,872,764
前払費用	3,430,098	2,074,447
流動資産合計	14,788,301,493	14,887,706,852
資産合計	14,788,301,493	14,887,706,852
負債の部		
流動負債		
未払解約金	41,579,000	39,655,000
流動負債合計	41,579,000	39,655,000
負債合計	41,579,000	39,655,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,150,667,512	12,066,650,337
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,596,054,981	2,781,401,515
元本等合計	14,746,722,493	14,848,051,852
純資産合計	14,746,722,493	14,848,051,852
負債純資産合計	14,788,301,493	14,887,706,852

## 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26年12月19日 至 平成27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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1. 1 期首	平成25年12月19日	平成26年12月19日
期首元本額	12,691,941,085円	12,150,667,512円
期中追加設定元本額	1,559,039,870円	2,076,977,956円
期中一部解約元本額	2,100,313,443円	2,160,995,131円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・ライフ・バランス30	3,608,693,904円	4,100,520,552円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,779,777,394円	2,089,147,275円
ダイワ・ライフ・バランス70	528,911,393円	653,033,981円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	445,053,924円	503,171,259円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	365,702,129円	401,470,589円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	90,920,694円	120,496,806円
DCダイワ・ターゲットイヤ-2020	40,998,036円	56,509,188円
DCダイワ・ターゲットイヤ-2030	20,766,084円	32,382,573円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	923,489円	1,488,031円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	3,756,808,871円	2,996,546,406円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	331,712,497円	268,839,442円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	375,245,921円	309,835,817円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	805,153,176円	533,208,418円
計	12,150,667,512円	12,066,650,337円
2. 期末日における受益権の総数	12,150,667,512口	12,066,650,337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26年12月19日 至 平成27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27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 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26年12月18日現在	平成27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	81,487,220	75,549,370
地方債証券	2,002,633	275,274
特殊債券	1,223,200	510,500
社債券	1,263,840	50,946
合計	85,976,893	74,712,650

（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26年12月2日から平成26年12月18日まで、及び平成27年12月1日から平成27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26年12月18日現在	平成27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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.2137円	1.2305円
（1万口当たり純資産額）	（12,137円）	（12,305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 5 7 2年国債	45,000,000	45,126,450	

1 1 4	5年国債	62,000,000	62,553,040	
1 1 5	5年国債	55,000,000	55,339,900	
1 1 6	5年国債	133,000,000	133,856,520	
1 1 7	5年国債	99,000,000	99,690,030	
1 1 9	5年国債	31,000,000	31,113,460	
1 2 0	5年国債	10,000,000	10,074,900	
1 2 1	5年国債	25,000,000	25,093,500	
1 2 2	5年国債	50,000,000	50,179,500	
1 2 3	5年国債	90,000,000	90,305,100	
1 2 4	5年国債	185,000,000	185,621,600	
1 2 5	5年国債	290,000,000	290,959,900	
1	40年国債	24,000,000	30,874,560	
2	40年国債	23,000,000	28,397,870	
3	40年国債	19,000,000	23,468,610	
4	40年国債	30,000,000	37,108,200	
5	40年国債	35,000,000	41,340,950	
6	40年国債	19,000,000	21,888,000	
7	40年国債	31,000,000	33,864,400	
8	40年国債	30,000,000	29,961,900	
2 9 6	10年国債	35,000,000	36,466,150	
2 9 7	10年国債	20,000,000	20,850,800	
2 9 8	10年国債	61,000,000	63,412,550	
2 9 9	10年国債	10,000,000	10,426,400	
3 0 0	10年国債	8,000,000	8,392,960	
3 0 1	10年国債	35,000,000	36,840,300	
3 0 2	10年国債	54,000,000	56,650,320	
3 0 3	10年国債	44,000,000	46,298,120	
3 0 4	10年国債	50,000,000	52,424,500	
3 0 5	10年国債	100,000,000	105,129,000	
3 0 6	10年国債	10,000,000	10,582,500	
3 0 7	10年国債	5,000,000	5,270,050	
3 0 8	10年国債	100,000,000	105,698,000	
3 0 9	10年国債	103,000,000	107,945,030	
3 1 0	10年国債	30,000,000	31,378,800	
3 1 1	10年国債	42,000,000	43,532,160	
3 1 2	10年国債	89,000,000	94,169,120	
3 1 3	10年国債	75,000,000	79,962,750	
3 1 4	10年国債	77,000,000	81,289,670	
3 1 5	10年国債	90,000,000	95,748,300	

3 1 6	1 0 年国債	59,000,000	62,444,420
3 1 7	1 0 年国債	35,000,000	37,137,100
3 1 8	1 0 年国債	10,000,000	10,553,200
3 1 9	1 0 年国債	129,000,000	137,217,300
3 2 0	1 0 年国債	35,000,000	37,020,200
3 2 1	1 0 年国債	65,000,000	68,905,850
3 2 2	1 0 年国債	75,000,000	79,039,500
3 2 3	1 0 年国債	60,000,000	63,341,400
3 2 4	1 0 年国債	96,000,000	100,725,120
3 2 5	1 0 年国債	102,000,000	107,141,820
3 2 8	1 0 年国債	30,000,000	31,134,300
3 2 9	1 0 年国債	56,000,000	58,959,040
3 3 0	1 0 年国債	81,000,000	85,324,590
3 3 1	1 0 年国債	75,000,000	77,851,500
3 3 2	1 0 年国債	135,000,000	140,130,000
3 3 3	1 0 年国債	155,000,000	160,872,950
3 3 4	1 0 年国債	166,000,000	172,191,800
3 3 5	1 0 年国債	130,000,000	133,695,900
3 3 6	1 0 年国債	48,000,000	49,337,280
3 3 7	1 0 年国債	96,000,000	96,976,320
3 3 8	1 0 年国債	145,000,000	147,563,600
3 3 9	1 0 年国債	154,000,000	156,504,040
3 4 0	1 0 年国債	248,000,000	251,658,000
2	3 0 年国債	9,000,000	11,269,350
3	3 0 年国債	4,000,000	4,957,680
4	3 0 年国債	8,000,000	10,620,240
5	3 0 年国債	8,000,000	9,826,080
6	3 0 年国債	9,000,000	11,336,580
7	3 0 年国債	12,000,000	14,946,720
8	3 0 年国債	5,000,000	5,831,950
9	3 0 年国債	11,000,000	12,114,190
1 0	3 0 年国債	15,000,000	15,753,300
1 1	3 0 年国債	9,000,000	10,314,180
1 2	3 0 年国債	11,000,000	13,325,620
1 3	3 0 年国債	11,000,000	13,127,950
1 4	3 0 年国債	22,000,000	27,713,400
1 5	3 0 年国債	21,000,000	26,794,320
1 6	3 0 年国債	17,000,000	21,693,190
1 7	3 0 年国債	17,000,000	21,396,710

1 8	3 0 年国債	20,000,000	24,795,600	
1 9	3 0 年国債	15,000,000	18,574,950	
2 0	3 0 年国債	16,000,000	20,377,440	
2 1	3 0 年国債	16,000,000	19,795,680	
2 2	3 0 年国債	17,000,000	21,638,620	
2 3	3 0 年国債	20,000,000	25,470,400	
2 4	3 0 年国債	15,000,000	19,111,950	
2 5	3 0 年国債	17,000,000	21,016,930	
2 6	3 0 年国債	32,000,000	40,165,440	
2 7	3 0 年国債	31,000,000	39,552,590	
2 8	3 0 年国債	35,000,000	44,796,500	
2 9	3 0 年国債	34,000,000	42,899,840	
3 0	3 0 年国債	40,000,000	49,712,400	
3 1	3 0 年国債	38,000,000	46,482,360	
3 2	3 0 年国債	47,000,000	58,521,580	
3 3	3 0 年国債	57,000,000	67,305,030	
3 4	3 0 年国債	55,000,000	67,351,350	
3 5	3 0 年国債	53,000,000	62,569,680	
3 6	3 0 年国債	53,000,000	62,521,980	
3 7	3 0 年国債	59,000,000	68,260,050	
3 8	3 0 年国債	35,000,000	39,636,450	
3 9	3 0 年国債	36,000,000	41,596,200	
4 0	3 0 年国債	31,000,000	35,053,870	
4 1	3 0 年国債	27,000,000	29,891,430	
4 2	3 0 年国債	33,000,000	36,518,790	
4 3	3 0 年国債	37,000,000	40,927,920	
4 4	3 0 年国債	35,000,000	38,698,800	
4 5	3 0 年国債	38,000,000	40,106,720	
4 6	3 0 年国債	40,000,000	42,186,400	
4 7	3 0 年国債	44,000,000	47,471,600	
4 8	3 0 年国債	65,000,000	66,823,900	
4 0	2 0 年国債	51,000,000	54,249,720	
4 1	2 0 年国債	40,000,000	41,964,800	
4 2	2 0 年国債	22,000,000	23,865,380	
4 3	2 0 年国債	14,000,000	15,520,540	
4 4	2 0 年国債	32,000,000	35,362,880	
4 5	2 0 年国債	20,000,000	22,017,000	
4 6	2 0 年国債	19,000,000	20,852,120	
4 7	2 0 年国債	23,000,000	25,366,240	

48	20年国債	9,000,000	10,109,160
49	20年国債	4,000,000	4,434,880
50	20年国債	30,000,000	32,947,200
51	20年国債	25,000,000	27,702,250
52	20年国債	19,000,000	21,250,550
53	20年国債	13,000,000	14,610,180
54	20年国債	14,000,000	15,817,760
55	20年国債	41,000,000	46,019,220
56	20年国債	12,000,000	13,527,600
57	20年国債	24,000,000	26,890,800
58	20年国債	35,000,000	39,365,900
59	20年国債	3,000,000	3,342,690
60	20年国債	16,000,000	17,493,280
61	20年国債	40,000,000	42,680,000
62	20年国債	16,000,000	16,851,680
63	20年国債	30,000,000	33,843,300
64	20年国債	35,000,000	39,841,900
65	20年国債	42,000,000	47,938,800
66	20年国債	30,000,000	34,004,400
67	20年国債	19,000,000	21,742,080
68	20年国債	25,000,000	29,219,500
69	20年国債	12,000,000	13,927,440
70	20年国債	18,000,000	21,405,420
71	20年国債	17,000,000	19,930,970
72	20年国債	53,000,000	61,867,430
73	20年国債	30,000,000	34,863,600
74	20年国債	22,000,000	25,761,340
75	20年国債	14,000,000	16,428,300
76	20年国債	25,000,000	28,882,250
78	20年国債	17,000,000	19,673,930
79	20年国債	14,000,000	16,332,400
80	20年国債	20,000,000	23,518,200
81	20年国債	18,000,000	21,036,600
82	20年国債	28,000,000	33,006,400
83	20年国債	25,000,000	29,538,500
84	20年国債	27,000,000	31,638,060
85	20年国債	31,000,000	36,708,030
86	20年国債	6,000,000	7,224,600
87	20年国債	20,000,000	23,882,200



8 8	2 0 年国債	33,000,000	39,835,620	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	17,953,950	
9 0	2 0 年国債	37,000,000	44,387,050	
9 1	2 0 年国債	18,000,000	21,781,440	
9 2	2 0 年国債	45,000,000	53,621,100	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	21,292,740	
9 4	2 0 年国債	36,000,000	42,976,440	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	36,564,300	
9 6	2 0 年国債	23,000,000	27,507,770	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	30,234,500	
9 8	2 0 年国債	29,000,000	34,725,180	
9 9	2 0 年国債	43,000,000	51,572,910	
1 0 0	2 0 年国債	35,000,000	42,450,800	
1 0 1	2 0 年国債	20,000,000	24,740,000	
1 0 2	2 0 年国債	10,000,000	12,394,400	
1 0 3	2 0 年国債	21,000,000	25,762,800	
1 0 4	2 0 年国債	24,000,000	28,871,760	
1 0 5	2 0 年国債	38,000,000	45,750,480	
1 0 6	2 0 年国債	21,000,000	25,552,800	
1 0 7	2 0 年国債	45,000,000	54,281,700	
1 0 8	2 0 年国債	18,000,000	21,256,380	
1 0 9	2 0 年国債	35,000,000	41,367,550	
1 1 0	2 0 年国債	26,000,000	31,400,200	
1 1 1	2 0 年国債	35,000,000	42,764,050	
1 1 2	2 0 年国債	34,000,000	41,083,900	
1 1 3	2 0 年国債	66,000,000	79,838,220	
1 1 4	2 0 年国債	45,000,000	54,488,250	
1 1 5	2 0 年国債	22,000,000	26,926,680	
1 1 6	2 0 年国債	27,000,000	33,057,990	
1 1 7	2 0 年国債	37,000,000	44,810,700	
1 1 8	2 0 年国債	33,000,000	39,529,050	
1 1 9	2 0 年国債	13,000,000	15,211,820	
1 2 0	2 0 年国債	37,000,000	42,242,900	
1 2 1	2 0 年国債	56,000,000	66,310,720	
1 2 2	2 0 年国債	14,000,000	16,375,660	
1 2 3	2 0 年国債	42,000,000	50,946,840	
1 2 4	2 0 年国債	30,000,000	35,950,800	
1 2 5	2 0 年国債	25,000,000	30,714,250	
1 2 6	2 0 年国債	21,000,000	25,175,640	

1 2 7	2 0 年国債	24,000,000	28,436,160	
1 2 8	2 0 年国債	27,000,000	31,975,560	
1 2 9	2 0 年国債	28,000,000	32,739,560	
1 3 0	2 0 年国債	28,000,000	32,739,280	
1 3 1	2 0 年国債	40,000,000	46,163,600	
1 3 2	2 0 年国債	25,000,000	28,824,000	
1 3 3	2 0 年国債	40,000,000	46,732,000	
1 3 4	2 0 年国債	25,000,000	29,180,500	
1 3 5	2 0 年国債	24,000,000	27,641,040	
1 3 6	2 0 年国債	20,000,000	22,741,000	
1 3 7	2 0 年国債	18,000,000	20,722,680	
1 3 8	2 0 年国債	24,000,000	26,878,560	
1 3 9	2 0 年国債	30,000,000	34,067,700	
1 4 0	2 0 年国債	67,000,000	77,099,580	
1 4 1	2 0 年国債	48,000,000	55,164,000	
1 4 2	2 0 年国債	27,000,000	31,462,830	
1 4 3	2 0 年国債	48,000,000	54,311,520	
1 4 4	2 0 年国債	14,000,000	15,614,900	
1 4 5	2 0 年国債	72,000,000	82,513,440	
1 4 6	2 0 年国債	67,000,000	76,667,430	
1 4 7	2 0 年国債	73,000,000	82,186,320	
1 4 8	2 0 年国債	64,000,000	70,849,280	
1 4 9	2 0 年国債	60,000,000	66,285,000	
1 5 0	2 0 年国債	73,000,000	79,234,930	
1 5 1	2 0 年国債	65,000,000	68,107,650	
1 5 2	2 0 年国債	61,000,000	63,739,510	
1 5 3	2 0 年国債	69,000,000	73,152,420	
1 5 4	2 0 年国債	124,000,000	128,938,920	
国債証券 合計			10,296,201,200	
地方債証券	6 4 8	東京都公債	100,000,000	102,645,500
	6 5 3	東京都公債	100,000,000	102,927,400
	6 6 0	東京都公債	100,000,000	103,769,400
	2 0 - 6	北海道公債	100,000,000	104,330,600
	2 1 - 3 5	兵庫県公債	100,000,000	105,448,700
	1 9 - 2	静岡県公債	100,000,000	102,815,000
	2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	104,049,200
	1 9 - 1	広島県公債	110,800,000	113,490,002
	2 1 - 2	埼玉県公債	100,000,000	105,117,700
	2 4 - 7	福岡県 5 年	100,000,000	100,211,300

	4 7 共同発行地方	100,000,000	102,042,100	
	7 6 共同発行地方	100,000,000	104,730,800	
	1 1 6 共同発行地方	100,000,000	104,362,200	
	1 1 7 共同発行地方	100,000,000	103,810,600	
	2 1 - 6 大阪市公債	100,000,000	105,756,300	
	2 4 - 6 京都市5年	100,000,000	100,112,100	
	2 0 - 1 千葉市公債	100,000,000	103,451,200	
地方債証券 合計			1,769,070,102	
特殊債券	1 6 政保政策投資B	100,000,000	102,071,900	
	5 日本政策投資CO	100,000,000	105,249,700	
	2 7 政保道路機構	50,000,000	51,035,950	
	5 6 政保道路機構	100,000,000	103,102,100	
	9 8 政保道路機構	100,000,000	104,950,200	
	1 2 2 政保道路機構	100,000,000	103,905,200	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	103,285,700	
	2 政保地方公営機	100,000,000	104,446,700	
	3 政保地方公共6年	100,000,000	100,689,300	
	2 6 公営企業	100,000,000	102,122,600	
	2 8 公営企業	100,000,000	103,295,600	
	2 7 国際協力銀行	100,000,000	102,072,000	
	3 0 国際協力銀行	100,000,000	103,937,400	
	い744 利付商工債	100,000,000	100,282,600	
特殊債券 合計			1,390,446,950	
社債券	1 0 首都高速道路	100,000,000	100,369,700	
	4 成田国際空港	100,000,000	103,136,200	
	2 7 東日本高速道	100,000,000	100,327,600	
	3 3 中日本高速道	100,000,000	104,950,600	
	2 8 みずほコーポレート	100,000,000	100,425,500	
	1 3 7 三菱東京UFJBK	100,000,000	100,180,300	
	3 5 みずほBK	100,000,000	100,239,600	
	6 2 トヨタファイナンス	100,000,000	100,143,200	
	1 6 4 オリックス	100,000,000	103,088,100	
	7 0 東日本旅客鉄道	100,000,000	104,833,900	
	1 5 NTTドコモ	100,000,000	104,638,100	
	2 6 1 北海道電力	3,000,000	3,146,238	
社債券 合計			1,125,479,038	
合計			14,581,197,290	

## 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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	-	67,296,408
コール・ローン	1,393,450,117	908,819,874
国債証券	167,711,973,324	161,356,997,118
派生商品評価勘定	3,286,694	6,356,867
未収入金	330,603,769	-
未収利息	1,577,604,580	1,339,970,331
前払費用	35,146,802	32,904,500
流動資産合計	171,052,065,286	163,712,345,098
資産合計	171,052,065,286	163,712,345,098
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,807,230	6,352,798
前受金	323,424,760	-
未払金	2,428,994	-
未払解約金	275,972,000	157,445,000
流動負債合計	605,632,984	163,797,798
負債合計	605,632,984	163,797,798
純資産の部		
元本等		
元本	1 58,254,679,882	57,214,334,756
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	112,191,752,420	106,334,212,544
元本等合計	170,446,432,302	163,548,547,300
純資産合計	170,446,432,302	163,548,547,300

負債純資産合計	171,052,065,286	163,712,345,098
---------	-----------------	-----------------

## 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26年12月19日 至 平成27年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<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	平成26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1. 1 期首	平成25年12月19日	平成26年12月19日
期首元本額	60,054,118,108円	58,254,679,882円
期中追加設定元本額	4,857,376,486円	4,817,133,621円
期中一部解約元本額	6,656,814,712円	5,857,478,747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	2,257,226,543円	1,684,686,820円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	70,806,460円	64,449,788円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	519,882,604円	411,121,336円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	127,652,861円	93,436,539円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,666,504,098円	1,331,954,560円
D-I's 外国債券インデッ クス	479,462円	468,424円
DCダイワ外国債券インデッ クス	34,564,449,956円	35,840,656,309円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	409,660,113円	476,769,144円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	191,399,099円	223,596,823円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	109,356,466円	139,390,945円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	187,229,796円	214,016,661円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	150,595,289円	171,481,074円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	37,167,376円	51,558,075円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	8,991,257円	11,210,231円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,645,252円	10,883,303円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	335,422円	637,363円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	2,174,142,605円	1,797,466,923円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	228,683,867円	191,978,114円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	8,552,380,920円	7,618,903,923円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	615,247,592円	530,924,035円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	492,148,765円	340,825,040円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	447,009,986円	407,666,172円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	41,674,967円	72,906,868円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,315,895,721円	5,435,216,798円
ダイワライフスタイル25	25,786,212円	30,315,983円
ダイワライフスタイル50	42,280,879円	48,927,240円
ダイワライフスタイル75	11,046,314円	12,886,265円
計	58,254,679,882円	57,214,334,756円
2. 期末日における受益権の総数	58,254,679,882口	57,214,334,756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26年12月19日 至 平成27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27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 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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
--	---------------	---------------



種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	555,739,190	972,980,918
合計	555,739,190	972,980,918

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成26年12月2日から平成26年12月18日まで、及び平成27年12月1日から平成27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26年12月18日 現在				平成27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	1,030,239,595	-	1,029,719,059	520,536	827,870,541	-	827,874,610	4,069
アメリカ・ドル	337,344,788	-	340,161,450	2,816,662	279,397,830	-	278,337,600	1,060,230
イギリス・ポンド	149,877,653	-	149,841,900	35,753	129,731,121	-	128,122,020	1,609,101
オーストラリア ・ドル	25,305,249	-	24,272,640	1,032,609	24,936,156	-	24,385,200	550,956
カナダ・ドル	60,949,695	-	60,774,120	175,575	47,120,801	-	45,000,360	2,120,441
シンガポール ・ドル	5,798,086	-	5,779,840	18,246	5,128,268	-	5,084,620	43,648
スイス・フラン	5,141,486	-	5,123,580	17,906	4,060,768	-	4,187,100	126,332
スウェーデン ・クローナ	7,651,852	-	7,456,540	195,312	10,658,979	-	10,682,720	23,741
デンマーク ・クローネ	11,140,187	-	11,099,520	40,667	8,549,961	-	8,722,000	172,039
ノルウェー ・クローネ	4,300,598	-	4,064,700	235,898	3,997,406	-	3,936,720	60,686
ポーランド・ズロチ	9,829,685	-	9,671,200	158,485	7,668,259	-	7,771,680	103,421
メキシコ・ペソ	17,365,706	-	16,560,809	804,897	15,288,813	-	14,813,220	475,593
ユーロ	387,195,424	-	386,947,320	248,104	284,583,615	-	290,455,470	5,871,855
南アフリカ・ランド	8,339,186	-	7,965,440	373,746	6,748,564	-	6,375,900	372,664

合計	1,030,239,595	-	1,029,719,059	520,536	827,870,541	-	827,874,610	4,069
----	---------------	---	---------------	---------	-------------	---	-------------	-------

## (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26年12月18日現在	平成27年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.9259円	2.8585円
(1万口当たり純資産額)	(29,259円)	(28,585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	4.625% United States Treasury Note/Bond 20170215	アメリカ・ドル 2,039,000.000	アメリカ・ドル 2,128,124.690	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20170515	1,795,000.000	1,885,234.650	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20170815	2,401,000.000	2,551,326.610	

4.25% United States Treasury Note/Bond 20171115	1,686,000.000	1,788,660.540	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20180215	3,839,000.000	4,034,366.710	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,960,000.000	3,153,643.200	
4% United States Treasury Note/Bond 20180815	3,173,000.000	3,407,865.460	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,488,000.000	2,666,240.320	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	3,161,000.000	3,297,302.320	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,096,000.000	3,269,902.320	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,621,000.000	2,820,641.570	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,302,003.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20161130	1,134,000.000	1,155,171.780	
3.25% United States Treasury Note/Bond 20161231	3,154,000.000	3,234,300.840	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20170131	2,884,000.000	2,957,888.080	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	5,630,000.000	6,084,791.400	
3% United States Treasury Note/Bond 20170228	2,687,000.000	2,755,625.980	
3.25% United States Treasury Note/Bond 20170331	4,635,000.000	4,774,559.850	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20170430	1,653,000.000	1,702,639.590	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,308,729.830	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20170531	2,835,000.000	2,908,851.750	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20170630	3,468,000.000	3,548,596.320	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20170731	1,773,000.000	1,812,945.690	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,969,701.160	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20170831	2,903,000.000	2,945,964.400	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20170930	2,831,000.000	2,873,465.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20171031	2,372,000.000	2,408,766.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,691,118.510	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20171130	883,000.000	903,141.230	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	924,000.000	955,360.560	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20180131	255,000.000	263,205.900	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,439,334.640	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	1,234,000.000	1,277,905.720	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20180331	1,300,000.000	1,350,921.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	260,000.000	268,925.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,417,000.000	3,640,676.820	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20180531	1,322,000.000	1,360,047.160	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,065,000.000	1,096,864.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,341,000.000	1,377,247.230	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,568,639.780	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20180831	3,444,000.000	3,466,868.160	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180930	2,835,000.000	2,843,845.200	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	1,320,000.000	1,337,991.600	

2% United States Treasury Note/Bond 20211115	1,353,000.000	1,359,440.280	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20161130	223,000.000	223,225.230	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,165,000.000	2,169,394.950	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20161231	3,410,000.000	3,412,898.500	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,861,000.000	1,862,805.170	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170131	2,970,000.000	2,972,197.800	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,426,000.000	1,421,094.560	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,235,187.280	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170228	2,408,000.000	2,409,204.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190228	1,843,000.000	1,841,691.470	
1% United States Treasury Note/Bond 20170331	3,856,000.000	3,861,861.120	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190331	300,000.000	300,900.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170430	2,375,000.000	2,374,145.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190430	559,000.000	555,724.260	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,423,737.940	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170531	3,485,000.000	3,469,317.500	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,358,335.700	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20170630	3,906,000.000	3,893,617.980	
1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,346,029.920	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170731	5,660,000.000	5,617,719.800	

0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,784,000.000	1,744,966.080	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,482,400.310	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170831	6,410,000.000	6,368,655.500	
1% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,872,000.000	1,837,910.880	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170930	4,974,000.000	4,939,977.840	
1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,170,611.400	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20171031	2,648,000.000	2,634,442.240	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	874,258.320	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,082,844.160	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20171130	2,336,000.000	2,316,541.120	
1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,323,288.120	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	1,913,000.000	1,900,661.150	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	894,000.000	877,756.020	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180131	2,153,000.000	2,142,816.310	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,352,968.360	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	3,850,000.000	3,835,832.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	3,447,000.000	3,419,113.770	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,937,397.600	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180331	2,315,000.000	2,294,651.150	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,134,712.000	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,574,059.200	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	4,218,000.000	4,163,925.240	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,418,686.230	
1% United States Treasury Note/Bond 20180531	3,407,000.000	3,389,965.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,427,161.250	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,693,000.000	1,700,601.570	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,148,218.480	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,862,111.340	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,697,000.000	1,704,025.580	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,468,000.000	4,595,740.120	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	2,027,399.180	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,908,411.700	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181031	3,611,000.000	3,606,486.250	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,343,522.650	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	3,821,000.000	3,999,478.910	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,638,000.000	2,633,357.120	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,528,335.930	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20161215	144,000.000	143,814.240	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20181231	2,026,000.000	2,035,643.760	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,064,294.360	

0.75% United States Treasury Note/Bond 20170115	2,168,000.000	2,166,894.320	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,464,305.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190131	2,185,000.000	2,194,045.900	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,673,236.710	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170215	2,190,000.000	2,184,765.900	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,373,000.000	2,381,139.390	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,750,108.860	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20170315	1,182,000.000	1,180,380.660	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190331	2,383,000.000	2,398,632.480	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,881,595.080	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170415	1,485,000.000	1,484,584.200	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,412,000.000	5,546,434.080	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190430	2,975,000.000	2,992,641.750	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170515	2,237,000.000	2,235,859.130	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,458,509.800	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,241,000.000	2,244,316.680	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,754,402.400	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170615	753,000.000	752,141.580	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2,885,000.000	2,900,550.150	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,534,800.650	



8.75% United States Treasury Note/Bond 20170515	1,527,000.000	1,694,908.920	
8.875% United States Treasury Note/Bond 20190215	904,000.000	1,115,725.840	
8.125% United States Treasury Note/Bond 20190815	724,000.000	895,211.520	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	844,230.000	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,823,008.760	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	847,335.480	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,146,366.900	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	885,887.100	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	987,112.340	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	937,125.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	438,000.000	576,000.660	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	624,024.170	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,409,464.400	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,241,000.000	1,699,003.460	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,926,000.000	2,507,401.620	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	761,139.560	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	701,867.440	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	1,019,000.000	1,328,042.320	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	255,000.000	286,574.100	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	694,000.000	870,151.080	

4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	760,000.000	987,103.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	810,000.000	1,033,697.700	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,307,000.000	1,727,579.530	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,888,145.000	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,888,437.450	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,677,000.000	2,104,635.000	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,366,584.500	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,748,797.050	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,594,687.520	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,521,253.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,377,000.000	2,491,000.920	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	2,353,000.000	2,403,918.920	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,680,004.740	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	3,984,000.000	3,857,627.520	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,026,000.000	2,109,248.340	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,998,000.000	3,962,377.820	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,314,000.000	3,792,972.420	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,191,990.220	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,136,365.030	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	2,993,000.000	3,263,746.780	

0.875% United States Treasury Note/Bond 20170715	2,583,000.000	2,579,048.010	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,341,831.760	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,893,315.620	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,662,000.000	5,738,493.620	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	3,872,603.790	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170815	1,818,000.000	1,814,364.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,189,000.000	1,193,637.100	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,309,027.170	
1% United States Treasury Note/Bond 20170915	2,187,000.000	2,186,912.520	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,430,312.920	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,668,862.500	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20171015	1,466,000.000	1,461,704.620	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,182,025.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,172,798.390	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,935,802.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,227,000.000	3,266,304.860	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20171115	1,593,000.000	1,588,077.630	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,879,333.340	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,312,630.500	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20161130	444,000.000	442,938.840	

1% United States Treasury Note/Bond 20171215	717,000.000	716,239.980	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,201,418.870	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,206,402.360	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20161231	1,544,000.000	1,541,514.160	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180115	1,547,000.000	1,540,286.020	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,904,149.450	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170131	2,386,000.000	2,377,601.280	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,362,150.560	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	6,275,000.000	6,151,947.250	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,430,501.320	
1% United States Treasury Note/Bond 20180215	1,961,000.000	1,956,019.060	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,758,809.640	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170228	970,000.000	966,090.900	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,785,808.620	
1% United States Treasury Note/Bond 20180315	2,081,000.000	2,074,902.670	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,759,696.560	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170331	2,159,000.000	2,148,960.650	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180415	2,083,000.000	2,063,044.860	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,851,682.400	
1% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,180,000.000	2,169,863.000	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	6,188,000.000	6,126,553.160	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	4,035,000.000	4,080,070.950	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,574,203.940	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,574,648.400	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170430	2,323,000.000	2,310,920.400	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,804,352.840	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,990,854.450	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20180615	2,196,000.000	2,191,432.320	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,992,087.030	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170630	2,313,000.000	2,301,504.390	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,021,000.000	2,035,349.100	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180715	2,189,000.000	2,169,758.690	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,123,964.800	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170731	1,374,000.000	1,366,539.180	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,177,126.060	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	6,143,000.000	6,011,478.370	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,525,800.670	
1% United States Treasury Note/Bond 20180815	14,000.000	13,907.460	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,420,916.750	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,825,639.640	

	1% United States Treasury Note/Bond 20180915	2,179,000.000	2,163,245.830	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,427,182.640	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,830,156.560	
	0.875% United States Treasury Note/Bond 20181015	2,057,000.000	2,033,920.460	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	2,002,000.000	2,004,342.340	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,064,118.600	
	3% United States Treasury Note/Bond 20451115	1,401,000.000	1,418,946.810	
	1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,530,399.180	
	1.25% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,138,000.000	2,134,237.120	
	0.875% United States Treasury Note/Bond 20171130	2,277,000.000	2,271,375.810	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 569,247,220.370 (69,727,092,023)	
イギリス・ボ ンド		イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	
	2% United Kingdom Gilt 20200722	2,380,000.000	2,461,396.000	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,844,855.100	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	554,000.000	558,321.200	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	412,000.000	418,180.000	
	8.75% United Kingdom Gilt 20170825	595,000.000	678,478.500	
	8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,491,997.800	
	6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,381,079.700	
	4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,325,760.000	

5% United Kingdom Gilt 20250307	1,662,000.000	2,124,036.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,912,000.000	2,445,830.400	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,018,236.400	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,986,048.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,495,900.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,666,000.000	2,271,424.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,527,433.600	
5% United Kingdom Gilt 20180307	1,604,000.000	1,759,748.400	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,666,000.000	2,292,249.400	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,800,000.000	2,380,320.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,773,000.000	2,479,363.200	
4.5% United Kingdom Gilt 20190307	1,820,000.000	2,030,756.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,619,177.000	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,391,000.000	1,608,830.600	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,870,000.000	2,453,440.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,428,000.000	1,571,085.600	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,144,000.000	1,625,852.800	
3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	2,006,989.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,657,000.000	2,171,001.400	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	1,843,000.000	2,087,750.400	

	1.75% United Kingdom Gilt 20170122	1,010,000.000	1,024,443.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,182,000.000	1,540,146.000	
	1% United Kingdom Gilt 20170907	2,392,000.000	2,408,504.800	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,276,078.400	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,012,000.000	2,275,773.200	
	1.25% United Kingdom Gilt 20180722	2,854,000.000	2,887,106.400	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	2,167,000.000	2,261,914.600	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,506,000.000	1,975,269.600	
	1.75% United Kingdom Gilt 20190722	1,781,000.000	1,825,168.800	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	2,012,000.000	2,172,758.800	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,106,000.000	1,311,052.400	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 74,073,757.800 (13,526,608,911)	
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	
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	1,737,000.000	1,815,078.150	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	2,506,000.000	2,748,906.580	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,050,000.000	2,399,197.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,459,000.000	2,689,408.300	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,882,000.000	2,245,865.880	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	2,063,000.000	2,206,069.050	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,918,000.000	2,279,964.960	



	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170721	1,385,000.000	1,432,297.750	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,662,000.000	1,944,340.560	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,173,000.000	2,167,828.260	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	964,000.000	975,886.120	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,148,000.000	2,219,592.840	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	958,000.000	1,108,655.080	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20181021	671,000.000	691,962.040	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,956,000.000	2,189,722.440	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	1,029,000.000	1,050,341.460	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	763,000.000	796,770.380	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	354,000.000	319,750.500	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	654,000.000	636,969.840	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	402,000.000	385,771.260	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 32,304,378.450 (2,818,233,976)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 285,000.000	カナダ・ドル 337,189.200	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	641,161.440	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,441,559.670	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,017,000.000	1,573,044.750	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,386,000.000	2,066,678.460	

4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	1,747,000.000	1,834,594.580	
4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	969,000.000	1,056,064.650	
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	2,199,000.000	2,433,061.560	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,413,000.000	1,915,618.230	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,476,000.000	1,655,599.680	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	1,074,601.360	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,461,000.000	1,612,155.060	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,491,000.000	1,927,863.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170301	1,327,000.000	1,342,804.570	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170901	780,000.000	792,823.200	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,625,000.000	1,656,427.500	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180301	1,265,000.000	1,285,024.950	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180901	1,021,000.000	1,039,857.870	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,105,000.000	1,207,289.850	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170201	1,463,000.000	1,479,210.040	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190301	853,000.000	883,955.370	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	827,000.000	859,989.030	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170801	975,000.000	986,388.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	455,000.000	514,363.850	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,047,000.000	1,121,808.150	

	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	829,000.000	856,763.210	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180201	98,000.000	99,486.660	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170501	1,018,000.000	1,014,447.180	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	649,000.000	648,058.950	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	505,000.000	501,646.800	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20171101	36,000.000	35,815.680	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	363,000.000	360,371.880	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 36,255,724.380 (3,182,527,486)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	391,000.000	420,637.800	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	739,987.200	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	442,000.000	481,117.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	463,185.000	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	599,000.000	621,163.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	768,000.000	804,096.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	580,000.000	591,542.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	279,000.000	281,723.040	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	307,000.000	310,070.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	370,000.000	359,614.100	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20180401	272,000.000	268,545.600	

	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	151,000.000	155,379.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	173,000.000	186,149.730	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	435,000.000	443,265.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	70,000.000	70,245.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	224,000.000	221,746.560	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	225,744.960	
	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20171001	190,000.000	191,324.300	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 6,835,535.290 (589,906,696)	
スイス・フラン	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	スイス・フラン 420,000.000	スイス・フラン 554,542.800	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	506,000.000	751,652.880	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	495,000.000	532,758.600	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	568,000.000	614,326.080	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	527,000.000	597,312.340	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	457,000.000	520,066.000	
	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	370,000.000	423,231.900	
	スイス・フラン 小計		スイス・フラン 3,993,890.600 (491,767,750)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	スウェーデン・クローナ 6,055,000.000	スウェーデン・クローナ 7,466,420.500	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,534,921.250	

	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	10,220,000.000	11,675,634.600	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,475,000.000	5,621,405.500	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	7,555,000.000	8,955,319.250	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	6,725,000.000	7,094,807.750	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	4,760,000.000	5,410,168.400	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 51,758,677.250 (741,184,259)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	1,864,000.000	2,906,181.040	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	6,576,000.000	7,132,724.160	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,932,000.000	19,388,068.160	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	9,981,890.550	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	6,150,000.000	7,149,559.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	5,846,000.000	6,287,606.840	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	3,309,000.000	3,588,875.220	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 56,434,905.470 (1,004,541,317)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	5,755,000.000	6,046,951.150	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	5,075,000.000	5,724,295.500	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,698,000.000	7,660,904.480	

	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,149,000.000	5,413,607.110	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,606,137.900	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	2,690,000.000	2,750,928.500	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 32,202,824.640 (450,195,489)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,742,168.400	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,029,000.000	2,155,508.150	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	1,912,000.000	2,143,925.600	
	Poland Government Bond 20170725	812,000.000	790,019.160	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	782,000.000	754,653.460	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	601,000.000	568,696.250	
	2% Poland Government Bond 20210425	1,227,000.000	1,197,809.670	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290425	627,000.000	794,308.680	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20201025	2,256,000.000	2,545,354.560	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20211025	2,284,000.000	2,685,984.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20170425	1,177,000.000	1,224,138.850	
	4% POLAND GOVERNMENT BOND 20231025	3,083,000.000	3,335,035.250	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20180425	1,720,000.000	1,794,132.000	
	2.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20180725	2,099,000.000	2,132,248.160	
	3.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20190725	1,840,000.000	1,908,852.800	

	3.25% Poland Government Bond 20250725	1,891,000.000	1,940,203.820	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 28,713,038.810 (886,658,638)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	1,210,000.000	1,234,805.000	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	1,417,000.000	1,512,477.460	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,031,524.200	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	518,358.720	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	783,866.700	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,647,851.940	
	4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	1,427,000.000	1,454,227.160	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	578,000.000	571,532.180	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,926,538.000	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,517,966.680	
	3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	1,595,000.000	1,606,643.500	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	834,120.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	693,558.180	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	581,902.620	
	3.314% MALAYSIAN GOVERNMENT 20171031	399,000.000	403,189.500	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	444,000.000	439,742.040	
	3.26% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180301	533,000.000	533,810.160	

	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	401,000.000	382,157.010	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	477,000.000	428,202.900	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	541,053.800	
	3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	658,512.480	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	400,000.000	407,588.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,048,544.000	
	3.394% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170315	340,000.000	343,522.400	
	4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	857,145.690	
	3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	648,000.000	648,259.200	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	404,000.000	392,821.320	
	3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	697,333.000	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,138,476.600	
	3.759% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190315	768,000.000	776,125.440	
	マレーシア・リングgit 小計		マレーシア・リングgit 25,611,855.880 (725,583,877)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5% Mexican Bonos 20191211	8,802,000.000	8,756,405.640	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	2,298,000.000	2,204,425.440	
	8% Mexican Bonos 20231207	8,233,000.000	9,229,851.640	
	10% Mexican Bonos 20241205	20,222,000.000	25,572,741.200	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	8,568,000.000	9,280,686.240	
	7.25% Mexican Bonos 20161215	12,639,000.000	13,103,356.860	
	7.75% Mexican Bonos 20171214	13,756,000.000	14,753,585.120	
	10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	9,223,533.200	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	10,304,851.920	
	8.5% Mexican Bonos 20181213	18,570,000.000	20,497,380.300	



	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	11,389,286.720	
	8% Mexican Bonos 20200611	12,728,000.000	14,160,536.400	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	13,441,000.000	14,020,038.280	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	17,015,000.000	18,698,974.550	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	14,299,000.000	14,743,841.890	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	9,654,000.000	10,574,605.440	
	5% Mexican Bonos 20170615	9,290,000.000	9,459,263.800	
	4.75% Mexican Bonos 20180614	13,133,000.000	13,213,373.960	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	2,875,000.000	3,157,325.000	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 232,344,063.600 (1,670,553,817)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	232,000.000	236,234.000	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	248,000.000	228,398.080	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	278,687.520	
	0.25% Austria Government Bond 20191018	347,000.000	352,499.950	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	462,000.000	477,042.720	
	0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,163,000.000	1,150,451.230	
	1% Belgium Government Bond 20310622	349,000.000	323,044.870	
	1.9% Belgium Government Bond 20380622	358,000.000	361,830.600	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	774,000.000	1,136,804.760	
	6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,750,317.470	
	5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,119,054.080	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,113,000.000	1,634,395.980	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,622,111.190	

5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,304,000.000	2,122,938.080	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,841,402.250	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,121,680.430	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,278,998.700	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	1,962,878.750	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,248,029.000	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	1,958,219.780	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	2,211,000.000	2,469,488.010	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,414,562.080	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	3,012,663.780	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,810,923.380	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,363,342.000	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	2,247,000.000	2,565,422.370	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	1,968,873.300	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,604,327.320	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,633,747.030	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,975,018.680	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,595,582.300	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,707,000.000	1,906,753.140	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,458,420.800	

2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,376,000.000	1,757,784.960	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,793,390.280	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,538,451.000	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,983,437.200	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,707,000.000	1,929,234.330	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,291,000.000	1,435,772.740	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,204,000.000	1,542,095.240	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,705,000.000	1,861,416.700	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,142,000.000	2,243,016.720	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,379,000.000	1,374,145.920	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	1,549,000.000	1,606,390.450	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20161216	485,000.000	486,775.100	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20170310	492,000.000	493,992.600	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20170616	795,000.000	799,038.600	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20170915	307,000.000	308,842.000	
0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170224	1,717,000.000	1,738,840.240	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170407	1,848,000.000	1,867,866.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20171013	1,811,000.000	1,838,581.530	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180223	890,000.000	906,206.900	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180413	1,392,000.000	1,410,736.320	

1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20181012	1,209,000.000	1,253,733.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190222	1,674,000.000	1,742,282.460	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190412	1,113,000.000	1,141,437.150	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,171,959.710	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,742,199.570	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	966,000.000	980,857.080	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	869,717.640	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	2,035,568.500	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,225,000.000	3,311,779.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	3,981,268.090	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,507,000.000	4,092,827.920	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,113,000.000	3,204,618.060	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,075,000.000	3,530,561.250	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,721,000.000	2,639,996.790	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,855,489.500	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,222,000.000	3,156,728.740	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	3,288,000.000	3,468,609.840	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,397,000.000	4,362,529.310	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	3,148,000.000	3,413,691.200	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,931,000.000	3,225,712.050	

4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	2,467,000.000	2,781,937.220	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,365,000.000	3,655,722.400	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	3,263,000.000	3,746,413.450	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,590,000.000	4,138,587.900	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,017,000.000	1,582,665.570	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,930,612.400	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,478,777.500	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,760,000.000	4,425,369.600	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,480,000.000	4,072,713.600	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,099,000.000	3,637,234.320	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	1,940,000.000	2,184,828.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180525	2,114,000.000	2,178,413.580	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	788,000.000	1,023,541.080	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	2,747,000.000	2,995,713.380	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181125	2,659,000.000	2,753,367.910	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	2,486,000.000	2,807,439.800	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190525	1,764,000.000	1,832,249.160	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,186,516.450	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,799,000.000	3,037,362.840	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2,322,000.000	2,373,501.960	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2,792,000.000	2,702,488.480	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	1,870,000.000	1,868,541.400	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20180225	113,000.000	113,674.610	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	1,099,000.000	1,105,154.400	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	729,000.000	735,021.540	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	602,000.000	603,113.700	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170225	2,315,000.000	2,371,648.050	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170725	1,868,000.000	1,907,508.200	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	214,000.000	321,716.900	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,881,842.760	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,195,000.000	1,778,614.100	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	991,000.000	1,228,879.640	
4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	1,405,000.000	1,511,737.850	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,323,836.970	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,347,000.000	1,549,238.580	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,332,270.840	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,349,000.000	2,043,424.730	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,720,692.820	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170115	1,465,000.000	1,509,858.300	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,627,499.640	

2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	968,000.000	1,153,401.040	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180115	1,477,000.000	1,524,470.780	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,523,042.950	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115	575,000.000	601,530.500	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170415	317,000.000	320,547.230	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	955,000.000	1,249,159.100	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,620,000.000	1,810,528.200	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,395,077.160	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180415	749,000.000	753,875.990	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	943,000.000	898,462.110	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,741,983.180	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,718,102.400	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,722,000.000	4,063,374.380	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,965,124.340	
0.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180115	1,743,000.000	1,765,571.850	
1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,478,148.300	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,129,000.000	1,273,173.300	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,229,000.000	1,256,849.140	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,193,000.000	1,190,673.650	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	577,000.000	547,884.580	

0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180515	128,000.000	128,222.720	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,211,000.000	1,219,089.480	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	357,000.000	369,562.830	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	964,000.000	988,514.520	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20181015	371,000.000	372,183.490	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	374,000.000	373,951.380	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,654,000.000	3,693,757.580	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	3,118,000.000	4,708,616.520	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,455,000.000	2,187,330.600	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170801	2,528,000.000	2,739,163.840	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190201	2,074,000.000	2,329,579.020	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,236,351.360	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,908,000.000	2,684,994.840	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,390,000.000	2,999,641.200	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	3,170,893.200	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170201	1,413,000.000	1,475,525.250	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180201	2,480,000.000	2,707,465.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,674,000.000	2,404,701.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	1,953,000.000	2,452,284.450	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180801	2,187,000.000	2,433,212.460	



4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190301	2,708,000.000	3,069,734.640	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	2,531,000.000	2,887,187.630	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,747,363.700	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	1,893,000.000	2,718,026.190	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,960,870.400	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,562,527.880	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,626,188.300	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,474,840.640	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,774,175.010	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,499,769.160	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170501	2,315,000.000	2,462,419.200	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	2,131,084.270	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170601	1,490,000.000	1,590,560.100	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,462,257.400	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20171101	1,295,000.000	1,377,012.350	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,810,000.000	2,387,408.100	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,594,000.000	1,964,078.980	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180601	2,341,000.000	2,531,908.550	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,434,000.000	2,041,428.060	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,723,938.760	

3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20181201	2,111,000.000	2,314,373.740	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,095,000.000	1,266,433.200	
1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20161215	318,000.000	322,954.440	
2.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190501	1,100,000.000	1,179,409.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	1,901,000.000	2,253,084.210	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,066,000.000	1,262,591.720	
1.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170515	905,000.000	919,932.500	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,706,326.020	
1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	446,000.000	463,715.120	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,706,000.000	2,537,180.260	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	894,005.100	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,704,000.000	2,641,148.880	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	1,377,000.000	1,696,023.360	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	209,000.000	220,603.680	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	966,000.000	1,060,948.140	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,121,000.000	1,276,359.390	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,636,000.000	1,927,551.560	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	1,396,000.000	2,083,390.400	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20210928	1,656,000.000	2,044,033.920	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170628	1,202,000.000	1,272,160.740	

4.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20260328	801,000.000	1,076,664.150	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220928	1,316,000.000	1,657,146.680	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320328	777,000.000	1,052,135.700	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190928	1,123,000.000	1,255,839.670	
2.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20230622	1,338,000.000	1,506,373.920	
1.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180622	1,052,000.000	1,092,859.680	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20450622	753,000.000	1,062,098.970	
2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20240622	1,505,000.000	1,738,576.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20340622	497,000.000	603,278.480	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	759,000.000	857,548.560	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	684,000.000	789,363.360	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	570,000.000	697,366.500	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,556,380.410	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	941,485.500	
5.5% IRISH TREASURY 20171018	169,000.000	186,609.800	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	618,332.400	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	847,000.000	1,013,427.030	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	837,997.980	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	372,000.000	380,317.920	
2% IRISH TREASURY 20450218	391,000.000	381,123.340	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,035,000.000	1,230,201.000	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	985,000.000	1,550,133.900	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,066,000.000	1,175,115.760	
3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	1,248,000.000	1,474,836.480	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	1,212,000.000	1,448,000.640	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	1,218,000.000	1,800,788.640	

4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	711,000.000	767,922.660	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	989,000.000	1,135,273.100	
4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	675,000.000	937,696.500	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	907,000.000	944,223.280	
3.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20220420	797,000.000	969,136.060	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20221122	872,000.000	1,055,294.400	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20620126	318,000.000	522,629.820	
1.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190618	738,000.000	793,866.600	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20440620	563,000.000	756,953.500	
1.75% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20231020	675,000.000	740,812.500	
2.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340523	301,000.000	347,516.540	
1.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20181019	307,000.000	319,237.020	
1.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20241021	932,000.000	1,008,992.520	
3.875% Finland Government Bond 20170915	474,000.000	508,720.500	
4.375% Finland Government Bond 20190704	447,000.000	519,177.090	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	863,044.640	
3.375% Finland Government Bond 20200415	527,000.000	605,486.110	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	542,652.750	
1.875% Finland Government Bond 20170415	163,000.000	167,823.170	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	464,419.320	

1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	666,437.400	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	479,873.700	
2.625% Finland Government Bond 20420704	387,000.000	486,729.900	
1.125% Finland Government Bond 20180915	425,000.000	441,124.500	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	588,279.740	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,108,000.000	3,044,268.200	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20171031	1,735,000.000	1,747,578.750	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,737,985.100	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	527,000.000	508,265.150	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180430	12,000.000	12,010.200	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,642,000.000	1,703,394.380	
1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	609,000.000	621,533.220	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,679,000.000	2,460,809.560	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,797,501.040	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,494,000.000	1,869,696.180	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	2,135,000.000	2,224,349.750	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,228,000.000	1,695,425.920	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	2,206,000.000	2,427,350.040	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,777,000.000	2,229,353.120	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,737,203.840	

4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	2,032,889.750	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,173,000.000	1,581,626.280	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,403,123.800	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,789,000.000	2,256,125.790	
4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	2,008,946.290	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	3,128,031.250	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,265,000.000	1,759,033.100	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,543,945.360	
4.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180131	2,000,000.000	2,182,120.000	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,758,000.000	2,251,576.080	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,350,000.000	1,650,226.500	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,270,000.000	1,703,666.900	
3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20181031	1,564,000.000	1,719,539.800	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,049,000.000	1,520,200.310	
2.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170430	1,488,000.000	1,528,830.720	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190430	1,836,000.000	1,981,044.000	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,315,735.000	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	1,849,000.000	2,019,995.520	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,964,125.000	
ユーロ 小計		ユーロ 488,367,314.860 (64,869,830,433)	

南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20170915	5,462,000.000	5,469,482.940	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20181221	4,178,000.000	4,118,338.160	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,459,296.640	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	13,703,000.000	14,722,503.200	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	5,133,152.200	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	7,086,000.000	6,419,703.420	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	9,804,000.000	6,670,151.400	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	6,976,474.750	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	2,839,000.000	2,615,002.900	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	8,752,000.000	7,633,056.800	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	6,321,000.000	5,456,223.990	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	3,801,000.000	3,281,973.450	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	2,902,000.000	2,530,253.800	
8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	4,943,000.000	4,228,093.910		
8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	3,166,000.000	2,803,366.360		
南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 83,517,073.920 (672,312,446)		
国債証券 合計		161,356,997,118 [161,356,997,118]		
合計		161,356,997,118 [161,356,997,118]		

（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 233銘柄	100%	43.3%
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	100%	8.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	100%	1.7%
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券 7銘柄	100%	0.3%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100%	0.5%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.6%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券 30銘柄	100%	0.4%
メキシコ・ペソ	国債証券 19銘柄	100%	1.0%
ユーロ	国債証券 278銘柄	100%	40.2%
南アフリカ・ランド	国債証券 15銘柄	100%	0.4%

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。



## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成28年1月29日

資産総額	21,601,222円
負債総額	17,607円
純資産総額（ - ）	21,583,615円
発行済数量	16,481,633口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3096円

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年1月29日

資産総額	125,072,873,733円
負債総額	2,769,083,058円
純資産総額（ - ）	122,303,790,675円
発行済数量	143,234,388,364口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.8539円

## (参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年1月29日

資産総額	72,080,810,333円
負債総額	401,523,488円
純資産総額（ - ）	71,679,286,845円
発行済数量	39,174,437,766口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.8297円

## (参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年1月29日

資産総額	215,873,351,044円
負債総額	291,226,800円
純資産総額（ - ）	215,582,124,244円
発行済数量	91,377,371,952口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.3593円

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

## 純資産額計算書

平成28年1月29日

資産総額	2,727,573,600円
負債総額	18,533,286円
純資産総額（ - ）	2,709,040,314円
発行済数量	1,326,083,516口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.0429円

## (参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

## 純資産額計算書

平成28年1月29日

資産総額	14,613,210,355円
負債総額	283,486,000円
純資産総額（ - ）	14,329,724,355円
発行済数量	11,494,706,327口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.2466円

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年1月29日

資産総額	163,856,797,901円
負債総額	361,739,208円
純資産総額（ - ）	163,495,058,693円
発行済数量	57,167,196,780口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.8599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。

## 第二部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成28年1月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

###### ・ファンド評価会議

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

- ・運用審査会議

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

- ・リスクマネジメント会議

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

- ・執行役員会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28年1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	34	161,172
追加型株式投資信託	603	11,468,320
株式投資信託 合計	637	11,629,492
単位型公社債投資信託	4	31,253
追加型公社債投資信託	17	2,877,159
公社債投資信託 合計	21	2,908,412
総合計	658	14,537,905

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第57期事業年度に係る中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	15,186	31,438
有価証券	15,003	4,878
前払費用	157	139
未収委託者報酬	8,265	10,295
未収収益	103	110
繰延税金資産	674	585
その他	15	153
流動資産計	39,406	47,600
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	1
建物	23	21
器具備品	228	234
無形固定資産	2,991	2,759
ソフトウェア	2,910	2,758
ソフトウェア仮勘定	68	1
電話加入権	11	-



投資その他の資産	15,077		12,979
投資有価証券	8,338		6,667
関係会社株式	5,141		5,129
出資金	129		124
長期差入保証金	997		996
投資不動産	1	398	1
その他		74	
貸倒引当金		3	
固定資産計		18,320	
資産合計		57,727	
			63,596

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
<b>負債の部</b>				
<b>流動負債</b>				
預り金		53		64
未払金		8,998		9,172
未払収益分配金		7		5
未払償還金		77		72
未払手数料		4,277		4,965
その他未払金	2	4,635	2	4,127
未払費用		3,463		4,162
未払法人税等		1,530		1,133
未払消費税等		530		1,429
賞与引当金		955		1,092
その他		1		747
流動負債計		15,534		17,801
<b>固定負債</b>				
退職給付引当金		1,959		2,072
役員退職慰労引当金		80		101
繰延税金負債		1,789		1,745
その他		3		2
固定負債計		3,832		3,920
負債合計		19,366		21,722
<b>純資産の部</b>				
<b>株主資本</b>				
資本金		15,174		15,174
資本剰余金				
資本準備金		11,495		11,495

資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	10,821	14,126
利益剰余金合計	11,196	14,501
株主資本合計	37,866	41,171
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	494	702
評価・換算差額等合計	494	702
純資産合計	38,360	41,873
負債・純資産合計	57,727	63,596

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,771	90,924
その他営業収益	788	933
営業収益計	85,560	91,858
営業費用		
支払手数料	47,520	49,978
広告宣伝費	668	670
調査費	8,246	9,013
調査費	741	867
委託調査費	7,505	8,146
委託計算費	735	756
営業雑経費	1,323	1,289
通信費	249	252
印刷費	477	481
協会費	54	53
諸会費	11	13
その他営業雑経費	531	488
営業費用計	58,494	61,709
一般管理費		
給料	5,708	5,881
役員報酬	243	289
給料・手当	3,785	3,803
賞与	724	695
賞与引当金繰入額	955	1,092

福利厚生費	793	831
交際費	37	45
旅費交通費	191	176
租税公課	222	259
不動産賃借料	1,182	1,180
退職給付費用	373	383
役員退職慰労引当金繰入額	33	38
固定資産減価償却費	963	1,032
諸経費	1,354	1,372
一般管理費計	10,862	11,201
営業利益	16,203	18,948

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	144	1	1,226
受取利息		9		20
その他		220		372
営業外収益計		374		1,620
営業外費用				
投資有価証券売却損		3		84
その他		71		67
営業外費用計		74		152
経常利益		16,503		20,416
特別利益				
固定資産売却益		-		7
特別利益計		-		7
特別損失				
外国税関連費用		-		746
その他		0		26
特別損失計		0		772
税引前当期純利益		16,502		19,651
法人税、住民税及び事業税		6,525		6,238
法人税等調整額		150		17
法人税等合計		6,375		6,220
当期純利益		10,126		13,431

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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		
当期首残高	15,174	11,495	374	7,722	8,097	34,767
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027	△7,027	△7,027
当期純利益	-	-	-	10,126	10,126	10,126
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099	3,099	3,099
当期末残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866

	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	464	464	35,231
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△7,027
当期純利益	-	-	10,126
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	30	30	30
当期変動額合計	30	30	3,129
当期末残高	494	494	38,360

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

## 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) 子会社及び関連会社株式

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) 有形固定資産及び投資不動産

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	8～47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) 貸倒引当金

債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

### (2) 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。

### (3) 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。

### (4) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

### (貸借対照表)

前事業年度において、「流動資産」に独立掲記しておりました「貯蔵品」、「前払金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動資産」の「その他」として表示しております。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、「流動資産」に表示していた「貯蔵品」14百万円、「前払金」0百万円、「その他」0百万円は、「その他」15百万円として組替えております。

前事業年度において、「有形固定資産」に独立掲記しておりました「リース資産」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「有形固定資産」の「器具備品」として表示しております。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、「有形固定資産」に表示していた「リース資産」4百万円、「器具備品」224百万円は、「器具備品」228百万円として組替えております。

前事業年度において、「投資その他の資産」に独立掲記しておりました「従業員に対する長期貸付金」、「長期前払費用」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」として表示しております。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、「投資その他の資産」に表示していた「従業員に対する長期貸付金」68百万円、「長期前払費用」6百万円は、「その他」74百万円として組替えております。

前事業年度において、「流動負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動負債」の「その他」として表示しております。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、「流動負債」に表示していた「リース債務」1百万円は、「その他」1百万円として組替えております。

前事業年度において、「固定負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「固定負債」の「その他」として表示しております。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、「固定負債」に表示していた「リース債務」3百万円は、「その他」3百万円として組替えております。

#### (損益計算書)

前事業年度において、「営業費用」に独立掲記しておりました「公告費」、「受益証券発行費」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業費用」の「その他営業雑経費」として表示しております。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、「営業費用」に表示していた「公告費」0百万円、「受益証券発行費」0百万円、「その他営業雑経費」530百万円は、「その他営業雑経費」531百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「有価証券利息」、「投資有価証券売却益」、「有価証券償還益」、「時効成立分配金・償還金」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「有価証券利息」13百万円、「投資有価証券売却益」64百万円、「有価証券償還益」63百万円、「時効成立分配金・償還金」44百万円、「その他」34百万円は、「その他」220百万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」に独立掲記しておりました「有価証券償還損」、「時効成立後支払分配金・償還金」、「投資不動産管理費用」、「貯蔵品廃棄損」は、金額的重要性が乏し

いため、当事業年度より「営業外費用」の「その他」として表示しております。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」に表示していた「有価証券償還損」18百万円、「時効成立後支払分配金・償還金」16百万円、「投資不動産管理費用」16百万円、「貯蔵品廃棄損」9百万円、「その他」9百万円は、「その他」71百万円として組替えております。

前事業年度において、「特別損失」に独立掲記しておりました「固定資産除却損」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「特別損失」の「その他」として表示しております。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、「特別損失」に表示していた「固定資産除却損」0百万円は、「その他」0百万円として組替えております。

### (貸借対照表関係)

#### 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	18百万円	20百万円
器具備品	251百万円	275百万円
投資建物	729百万円	-
投資器具備品	24百万円	-

#### 2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
未払金	4,508百万円	4,084百万円

#### 3 保証債務

前事業年度(平成26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。

当事業年度(平成27年3月31日)

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

### (損益計算書関係)

#### 1 関係会社項目



関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)	当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)
受取配当金	-	1,065百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年 6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

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

平成26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	10,126百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,882円
基準日	平成26年 3月31日
効力発生日	平成26年 6月26日

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日

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

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

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

## (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、「証券投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

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

## ( ) 価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	15,186	15,186	-
(2) 未収委託者報酬	8,265	8,265	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	22,283	22,283	-
資産計	45,735	45,735	-
(1) 未払手数料	4,277	4,277	-
(2) その他未払金	4,635	4,635	-
(3) 未払費用(*)	2,678	2,678	-
負債計	11,591	11,591	-

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

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

## 負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,059	1,025
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,141	5,129
(3) 長期差入保証金	997	996

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26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	15,186	-	-	-
未収委託者報酬	8,265	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,498	3,978	97
合計	23,452	1,498	3,978	97

当事業年度（平成27年3月31日）

(単位：百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成26年3月31日）

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(平成26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	113	55	58
(2) その他 証券投資信託	5,625	4,873	751
小計	5,738	4,928	809
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	16,544	16,586	41
小計	16,544	16,586	41
合計	22,283	21,514	768

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,059百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

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

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

## 3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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)
その他 証券投資信託	24,501	64	3
合計	24,501	64	3

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

## 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、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。

## (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 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,935百万円	1,959百万円
勤務費用	201	212
退職給付の支払額	217	118
その他	39	18
退職給付債務の期末残高	1,959	2,072

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,959百万円	2,072百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072
退職給付引当金	1,959	2,072
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
勤務費用	201百万円	212百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	201	212

## 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172百万円、当事業年度170百万円であります。

## (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 of の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
繰延税金資産		
減損損失	833	-
退職給付引当金	698	670
賞与引当金	287	305
外国税関連費用	-	241
未払事業税	335	231
連結法人間取引(譲渡損)	141	128
投資有価証券評価損	128	105
出資金評価損	116	103
その他	246	206
繰延税金資産小計	2,789	1,992
評価性引当額	1,200	613
繰延税金資産合計	1,588	1,379
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428	2,203

その他有価証券評価差額金	273	335
その他	1	-
繰延税金負債合計	2,704	2,539
繰延税金負債の純額	1,115	1,159

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	-	35.64%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	1.14%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	2.02%
評価性引当額の増減額	-	2.67%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	0.51%
その他	-	0.07%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	31.65%

(注) 前事業年度においては、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以下であるため記載を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が44百万円、繰延税金負債（長期）が180百万円、法人税等調整額が100百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が34百万円増加しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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



## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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)	1,719	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-------------------	-------	---------------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,834	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	--------------	------	---------	-------	---	---

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

## 前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,994	未払手数料	3,216
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	678	未払費用	393
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	978	長期差入保証金	971

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

## (1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,705.91円	1株当たり純資産額	16,052.69円
1株当たり当期純利益	3,882.07円	1株当たり当期純利益	5,148.94円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,126	13,431
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(平成27年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金・預金

22,998

有価証券		4,461
未収委託者報酬		10,719
繰延税金資産		504
その他		334
流動資産合計		39,018
固定資産		
有形固定資産	1	247
無形固定資産		
ソフトウェア		2,432
その他		135
無形固定資産合計		2,568
投資その他の資産		
投資有価証券		5,468
関係会社株式		5,129
その他		1,231
投資その他の資産合計		11,830
固定資産合計		14,646
資産合計		53,664

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(平成27年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

未払金		7,124
未払費用		4,744
未払法人税等		1,085
賞与引当金		903
その他	3	643

流動負債合計 14,500

## 固定負債

退職給付引当金		2,142
役員退職慰労引当金		111
繰延税金負債		1,497
その他		2

固定負債合計 3,754

負債合計	18,255
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	8,096
利益剰余金合計	8,471
株主資本合計	35,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	267
評価・換算差額等合計	267
純資産合計	35,409
負債・純資産合計	53,664

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間	
	(自 平成27年4月1日	
	至 平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		46,714
その他営業収益		435
営業収益合計		47,150
営業費用		
支払手数料		24,499
その他営業費用		6,487
営業費用合計		30,987
一般管理費	1	5,812
営業利益		10,350
営業外収益	2	378
営業外費用	3	29
経常利益		10,699
税引前中間純利益		10,699
法人税、住民税及び事業税		3,260
法人税等調整額		39
中間純利益		7,398

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,428	△ 13,428	△ 13,428
中間純利益	-	-	-	7,398	7,398	7,398
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 6,029	△ 6,029	△ 6,029
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,096	8,471	35,141

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,428
中間純利益	-	-	7,398
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 434	△ 434	△ 434
当中間期変動額合計	△ 434	△ 434	△ 6,464
当中間期末残高	267	267	35,409

## 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) 子会社及び関連会社株式

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

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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）に基づいております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間未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ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間未要支給額を計上しております。

## (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (中間貸借対照表関係)

## 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成27年9月30日現在)
有形固定資産	239百万円

## 2 保証債務

当中間会計期間（平成27年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,765百万円に対して保証を行っております。

### 3 消費税等の取扱い

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

#### (中間損益計算書関係)

##### 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
有形固定資産	15百万円
無形固定資産	532百万円

##### 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
外国税関連費用引当金戻入益	171百万円
投資有価証券売却益	99百万円
受取配当金	69百万円

##### 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
為替差損	13百万円
貯蔵品廃棄損	5百万円
投資有価証券売却損	2百万円

#### (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

##### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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



## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

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

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成27年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,998	22,998	-
(2) 未収委託者報酬	10,719	10,719	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	8,908	8,908	-
資産合計	42,626	42,626	-
(1) 未払金	7,124	7,124	-
(2) 未払費用(*)	3,702	3,702	-
負債合計	10,827	10,827	-

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払金及び(2) 未払費用

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,052

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成27年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	161	55	106
（2）その他			
証券投資信託	3,455	3,002	453
小計	3,617	3,058	559
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	5,290	5,453	163
小計	5,290	5,453	163
合計	8,908	8,511	396

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

（セグメント情報等）

[ セグメント情報 ]

当中間会計期間（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日）

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

[ 関連情報 ]

当中間会計期間（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日）

該当事項はありません。

（1 株当たり情報）

当中間会計期間 （自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日）
--

1株当たり純資産額	13,574.37円
1株当たり中間純利益金額	2,836.44円

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

(注) 2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
中間純利益(百万円)	7,398
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,398
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成27年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 代表取締役の人数の変更（4名以内に変更）

平成27年6月26日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 取締役（業務執行取締役等であるものを除く。）の責任を法令の定める限度に制限する契約を締結できる旨の規定の新設

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成27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 大和証券株式会社

資本金の額 100,000百万円（平成27年3月末日現在）

事業の内容 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。

### 2 【関係業務の概要】

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

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

### 3 【資本関係】

該当事項はありません。

#### <再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成27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 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
平成27年3月11日	有価証券届出書、有価証券報告書（第7期）
平成27年9月11日	半期報告書（第8期中）、有価証券届出書の訂正届出書
平成27年12月8日	有価証券届出書の訂正届出書



**独立監査人の監査報告書**

平成27年 5月28日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成26年12月19日から平成27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27年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成27年11月25日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。