

**【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29年3月10日提出                            |
| 【計算期間】     | 第9計算期間<br>(自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19日) |
| 【ファンド名】    | D C ダイワ・ターゲットイヤー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 岩本 信之                             |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号                       |
| 【事務連絡者氏名】  | 山村 政                                    |
| 【連絡場所】     | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号                       |
| 【電話番号】     | 03-5555-3111                            |
| 【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<br>債券              |
| 追加型投信       | 海外     | 不動産投信<br>その他資産<br>( ) |
|             | 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<br>一般<br>大型株<br>中小型株                              | 年1回          | グローバル<br>(含む日本) |                  |           |
| 債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>( )      | 年2回          | 日本              | ファミリー<br>ファンド    | あり<br>( ) |
| 不動産投信  | 年4回          | 北米              |                  |           |
| その他資産<br>(投資信託証券<br>(資産複合 資産配分変更型)<br>(株式、債券、不動産投信)) | 年6回<br>(隔月)  | 欧州              |                  |           |
| 資産複合<br>( )  | 年12回<br>(毎月) | アジア             |                  |           |
| 資産配分固定型<br>資産配分変更型                                   | 日々           | オセアニア           | ファンド・オブ・<br>ファンズ | なし        |
|  | その他<br>( )   | 中南米             |                  |           |
|  |              | アフリカ            |                  |           |
|  |              | 中近東<br>(中東)     |                  |           |
|  |              | エマージング          |                  |           |

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

### < 信託金の限度額 >

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

### < ファンドの特色 >

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

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

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

## 〈2016年12月時点の基本配分比率〉

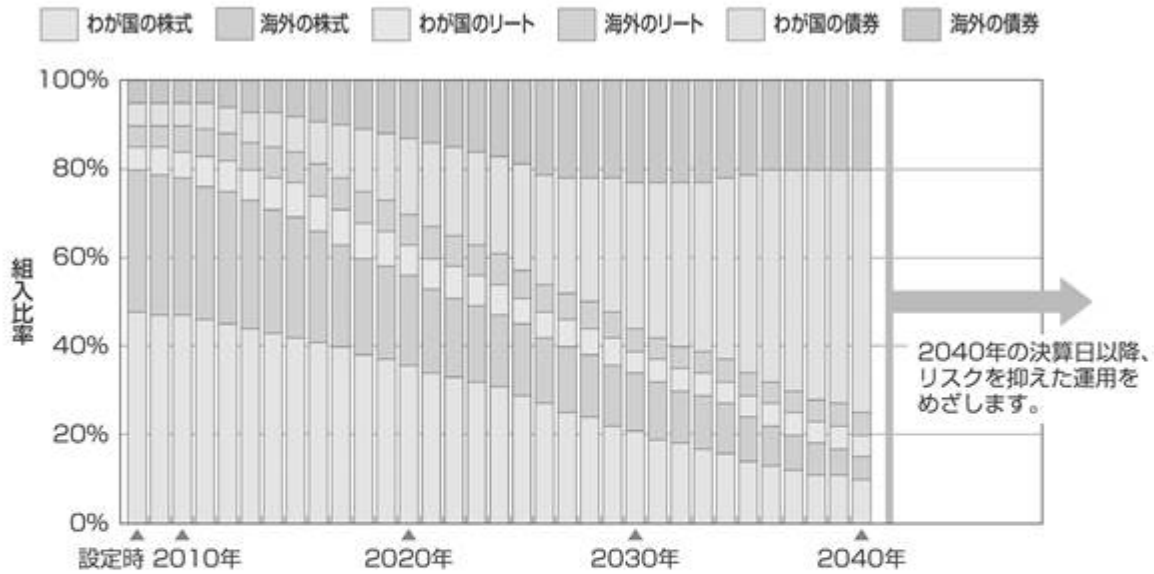
|                    | わが国の株式 | 海外の株式 | わが国のリート | 海外のリート | わが国の債券 | 海外の債券 |
|--------------------|--------|-------|---------|--------|--------|-------|
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040 | 41%    | 25%   | 8%      | 7%     | 10%    | 9%    |

## 〈当初設定時の基本配分比率〉

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

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

## ファンドの基本配分比率のイメージ



- (注1) 2016年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2015年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要性があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。

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

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

### 運用プロセス



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

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

### 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

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

#### 運用プロセス



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

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

#### MSC I コクサイ指数とは

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

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

## 4

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

## 運用プロセス



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

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

## 東証REIT指数とは

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

## 【算出方法の概要】

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

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

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

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



## 5

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

## 運用プロセス



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

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

## S&amp;P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

## 【特徴】

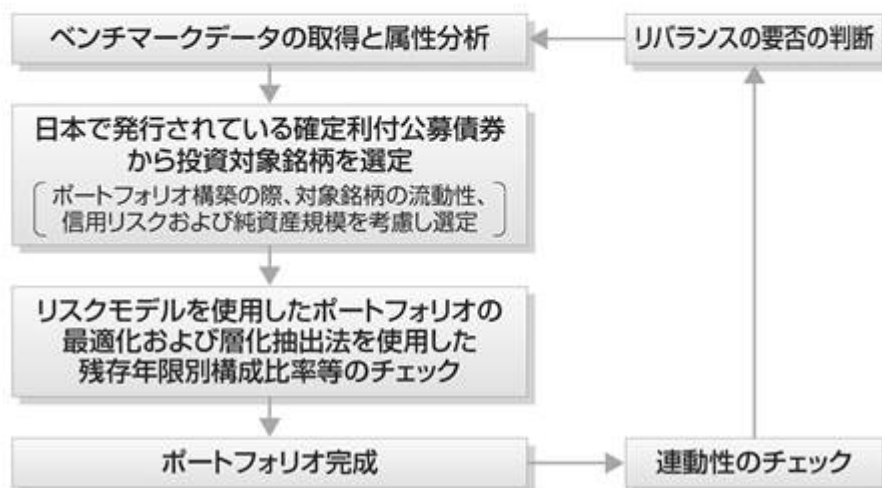
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

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

6

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

## 運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

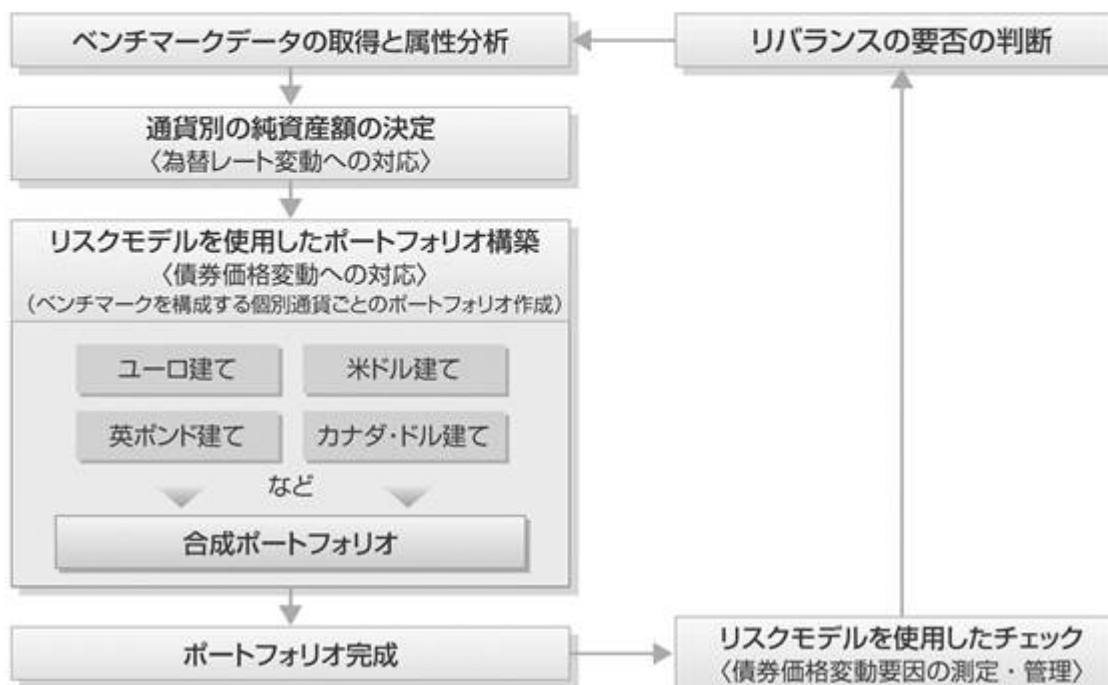
## NOMURA－BPI総合指数とは

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

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

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

### 運用プロセス



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

#### ①為替レート変動への対応

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

#### ②債券価格変動への対応

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

#### ③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

### 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いません。

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

9

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

10

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

〈分配方針〉

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成20年2月28日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

|       |  |
|-------|--|
| 受益者   | お申込者   |
|       | 収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）  |
| お取扱窓口 | 販売会社   |
|       | <p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い<br/>一部解約請求に関する事務<br/>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<br/>信託財産の運用指図<br/>信託財産の計算<br/>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<br>株式会社<br><br>再信託受託会社：<br>日本トラスティ・<br>サービス信託銀行株<br>式会社 | 信託契約( 2)の受託者であり、次の業務を行な<br>います。なお、信託事務の一部につき日本トラ<br>スティ・サービス信託銀行株式会社に委託するこ<br>とができます。また、外国における資産の保管は、<br>その業務を行なうに十分な能力を有すると認めら<br>れる外国の金融機関が行なう場合があります。<br><br>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分<br>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<br>（ファミリーファンド方式で運用を行ないます。） |
|------|---|

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（平成28年12月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

|             |  |
|-------------|--|
| 昭和34年12月12日 | 設立登記   |
| 昭和35年 2月17日 | 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得  |
| 昭和35年 4月 1日 | 営業開始   |
| 昭和60年11月 8日 | 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。   |
| 平成 7年 5月31日 | 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。                                    |
| 平成 7年 9月14日 | 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。                             |
| 平成19年 9月30日 | 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。<br><br>(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<br>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<br>2,608,525 | %<br>100.00 |

## 2 【投資方針】

## (1) 【投資方針】

## 主要投資対象

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

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

## 投資態度

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

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

## 当初設定時の基本配分比率

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

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

ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券 .....信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券  
.....信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）の受益証券  
.....信託財産の純資産総額の 5%

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

## (2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。



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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

- イ．為替手形

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

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

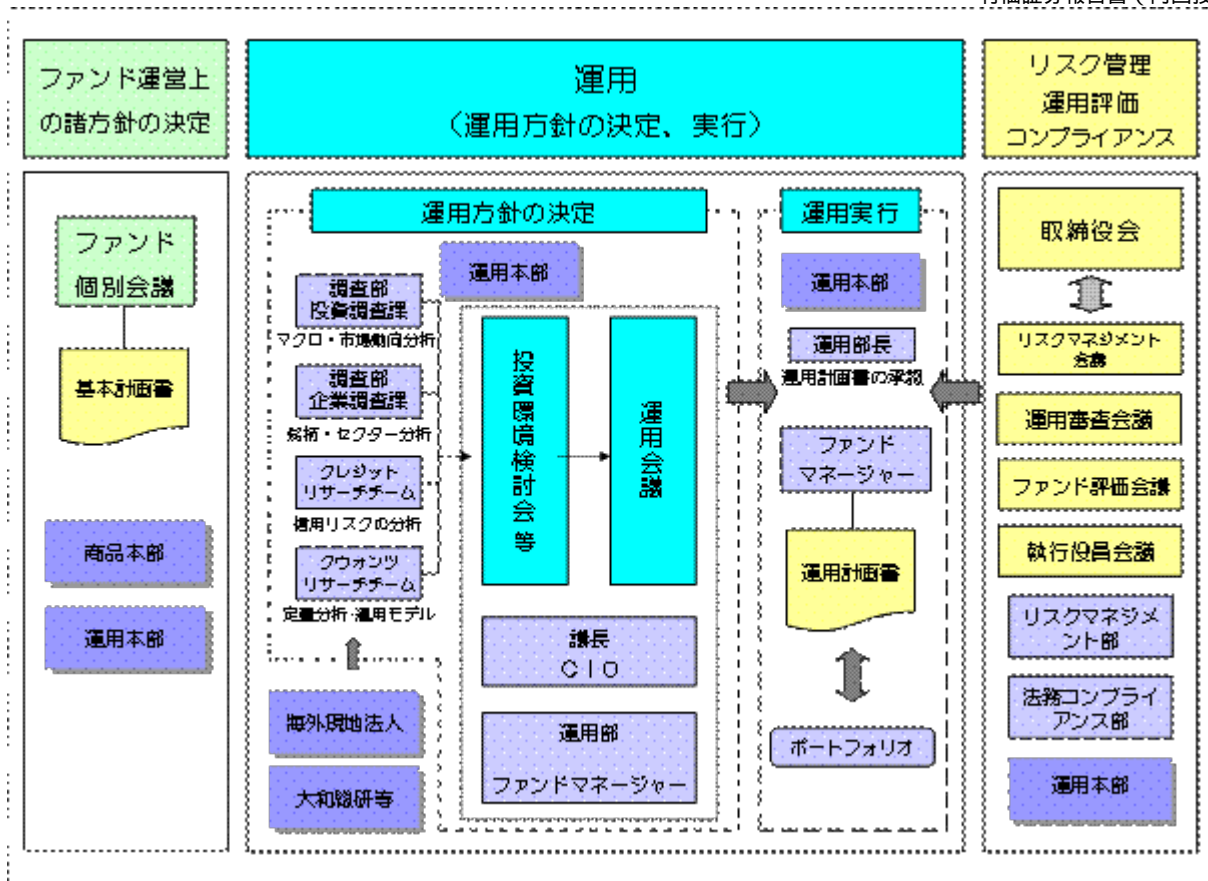
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

### (3) 【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．投資環境の検討

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

#### ハ．基本的な運用方針の決定

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

#### ニ．運用計画書の作成・承認

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

### 職務権限

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

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

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

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

受託会社に対する管理体制

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

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

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## <参考> 各マザーファンドの概要

### 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

## (2) 投資対象

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

## (3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

（注）東証株価指数（TOPIX）とは

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

## 3. ダイワJ-REITマザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

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

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

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

#### 投資態度

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

#### (2) 投資対象

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

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

#### イ．為替手形

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

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

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

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

#### (3) 主な投資制限



## 株式

株式への直接投資は、行ないません。

## 投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

## 同一銘柄の投資信託証券

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

## 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

## 先物取引

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

## （注）東証REIT指数とは

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

## [ 算出方法の概要 ]

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## (1) 投資方針

## 主要投資対象

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

## 投資態度

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

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

ハ．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なわず、S & P 先進国 REIT 指数 ( 除く日本 ) の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

## 5 . ダイワ日本債券インデックスマザーファンド ( 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ま

す。株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引

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

(注) NOMURA - B P I 総合指数とは

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

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

## 6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

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

### (2) 投資対象

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

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

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

#### ハ．約束手形

二．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの  
2．次に掲げる特定資産以外の資産

#### イ．為替手形

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

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

スワップ取引

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



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

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

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

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

#### 金利先渡取引

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

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

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

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

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

#### (注) NOMURA - B P I 総合短期指数とは

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

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

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

## 7. 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資方針

### 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

### 投資態度

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

## (2) 投資対象

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

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

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

## 3 【投資リスク】

## 〈基準価額の主な変動要因〉

|                     |       |       |      |
|---------------------|-------|-------|------|
| 株価変動リスク             | 株式市況  | 株 価   | 基準価額 |
|                     | 改 善   | →     | 上昇要因 |
|                     | 悪 化   | ↘     | 下落要因 |
| 公社債の<br>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<br>の<br>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<br>為替リスク     | 為替相場  | 円換算価値 | 基準価額 |
|                     | 円 安   | →     | 上昇要因 |
|                     | 円 高   | ↘     | 下落要因 |

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

## (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

## 〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなるが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともありま  
す。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込む  
ことがあります。

#### リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク



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

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

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

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

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

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ．カンントリー・リスク

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

その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

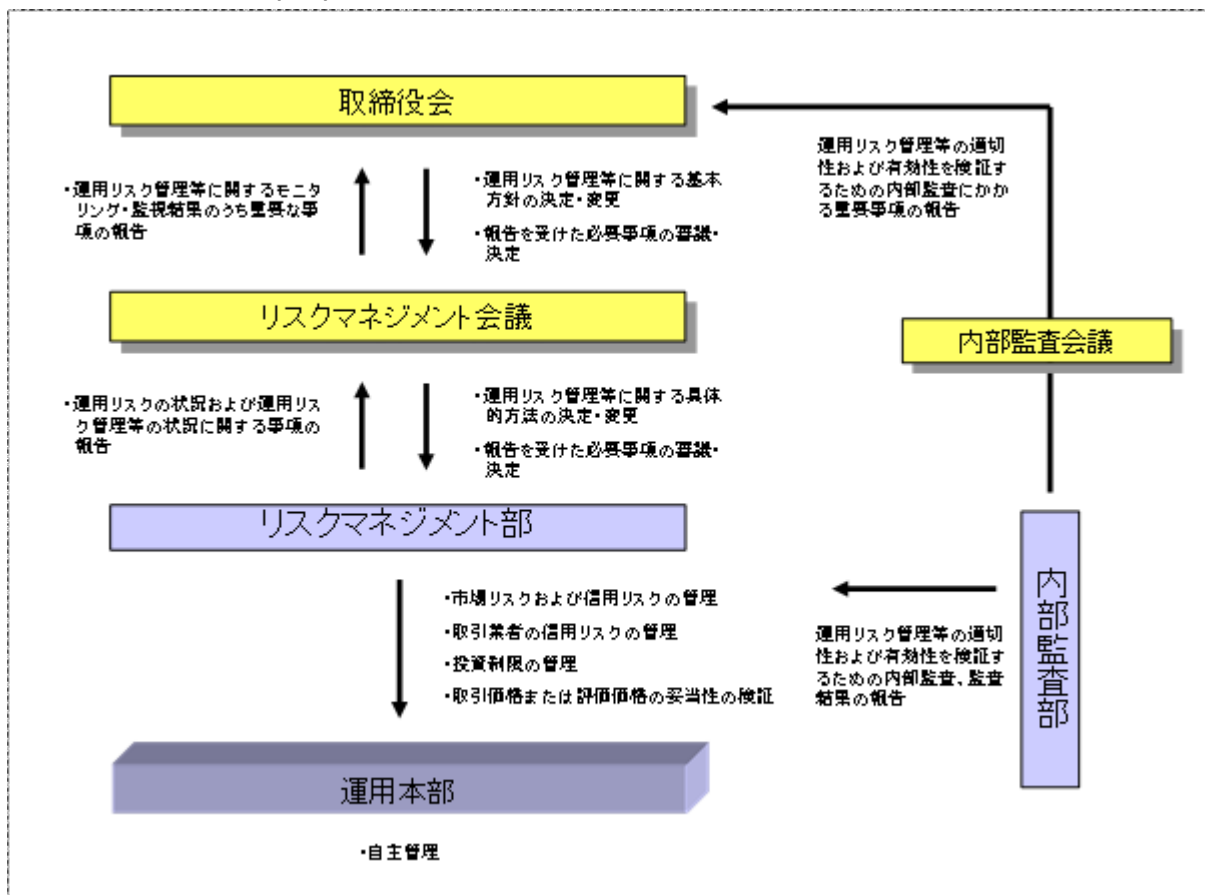
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者のご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

### (3) その他の留意点

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

### (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

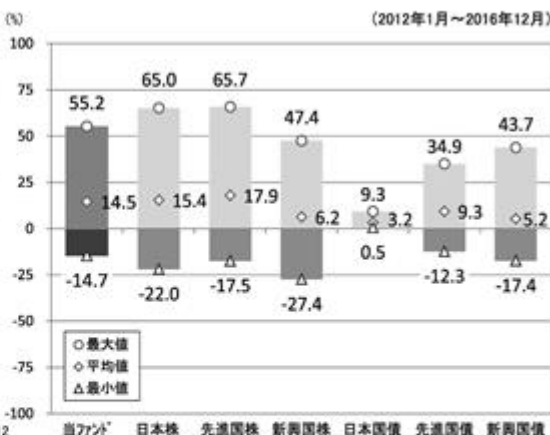
## 参 考 情 報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村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、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

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



- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

## (2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

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

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

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

< 第1計算期間から2016年3月11日まで >

| 委託会社             | 販売会社             | 受託会社            |
|------------------|------------------|-----------------|
| 年率0.300%<br>（税抜） | 年率0.300%<br>（税抜） | 年率0.05%<br>（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%<br>（税抜） | 年率0.165%<br>（税抜） | 年率0.03%<br>（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%<br>（税抜） | 年率0.155%<br>（税抜） | 年率0.03%<br>（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%<br>（税抜） | 年率0.125%<br>（税抜） | 年率0.03%<br>（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%<br>(税抜) | 年率0.095%<br>(税抜) | 年率0.03%<br>(税抜) |

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

#### < マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

#### イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

#### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

#### ハ．損益通算について

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

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

#### <注1> 個別元本について

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

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

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

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

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

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

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



## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成28年12月30日現在）

## 投資状況

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

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

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

## (2) 【投資資産】（平成28年12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                             | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)    | 評価単価<br>時価<br>(円)    | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|---------------------------------|----|-------------------|-----------------|----------------------|----------------------|-----------------|
|   |                                 |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                      |                      |                 |
| 1 | トピックス・インデックス・マザーファンド            | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 12,841,097      | 0.9419<br>12,095,530 | 0.9248<br>11,875,446 | 40.51           |
| 2 | 外国株式インデックスマザーファンド               | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 3,587,335       | 2.0918<br>7,504,346  | 2.0719<br>7,432,599  | 25.36           |
| 3 | ダイワ日本債券インデックスマザーファ<br>ンド(BPI)   | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 2,282,858       | 1.2651<br>2,888,089  | 1.2677<br>2,893,979  | 9.87            |
| 4 | 外国債券インデックスマザーファンド               | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 967,368         | 2.7053<br>2,617,091  | 2.7085<br>2,620,116  | 8.94            |
| 5 | ダイワJ-REITマザーファンド                | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 937,785         | 2.4435<br>2,291,560  | 2.5380<br>2,380,098  | 8.12            |
| 6 | ダイワ・グローバルREITインデックス・<br>マザーファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 950,718         | 2.1601<br>2,053,715  | 2.1569<br>2,050,603  | 7.00            |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

|                          | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(平成20年12月18日) | 681,848               | 681,848               | 0.6054                     | 0.6054                     |
| 第2計算期間末<br>(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<br>(平成22年12月20日) | 952,605               | 952,605               | 0.7319                     | 0.7319                     |
| 第4計算期間末<br>(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<br>(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<br>(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<br>(平成26年12月18日) | 13,831,791            | 13,831,791            | 1.2972                     | 1.2972                     |
| 第8計算期間末<br>(平成27年12月18日) | 22,270,544            | 22,270,544            | 1.3817                     | 1.3817                     |
| 平成27年12月末日               | 22,864,160            | -                     | 1.3873                     | -                          |

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

## 【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |
| 第5計算期間 | 0.0000      |
| 第6計算期間 | 0.0000      |
| 第7計算期間 | 0.0000      |
| 第8計算期間 | 0.0000      |
| 第9計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

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

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

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

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況（平成28年12月30日現在）

## 投資状況

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

## その他の資産の投資状況

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

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

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



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

(2) 投資資産(平成28年12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 株式        | 99.35% |
| 合計        | 99.35% |

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類           | 地域 | 資産名             | 買建/<br>売建 | 数量 | 簿価          | 時価          | 投資<br>比率 |
|--------------|----|-----------------|-----------|----|-------------|-------------|----------|
| 株価指数先物<br>取引 | 日本 | TOPIX先物 2017年3月 | 買建        | 48 | 740,110,920 | 728,640,000 | 0.58%    |

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

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

## 外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（平成28年12月30日現在）

## 投資状況

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

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

## その他の資産の投資状況

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

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

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

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

## (2) 投資資産(平成28年12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

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

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

#### 八 . 投資株式の業種別投資比率

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類           | 地域   | 資産名            | 買建/<br>売建 | 数量 | 簿価          | 時価          | 投資<br>比率 |
|--------------|------|----------------|-----------|----|-------------|-------------|----------|
| 株価指数先物<br>取引 | アメリカ | S&P500 2017年3月 | 買建        | 12 | 787,940,224 | 784,595,097 | 0.95%    |

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

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

#### ダイワJ-REITマザーファンド

#### (1) 投資状況（平成28年12月30日現在）

##### 投資状況

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



|                       |                 |        |
|-----------------------|-----------------|--------|
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 3,011,408,924   | 1.08   |
| 純資産総額                 | 279,126,547,924 | 100.00 |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類         | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------|---------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引(買建) | 2,973,075,000 | 1.07    |
| 内 日本            | 2,973,075,000 | 1.07    |

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

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

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

## (2) 投資資産（平成28年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名             | 地域 | 種類   | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)            | 評価単価<br>時価<br>(円)            | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|-----------------|----|------|--------------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------|
| 1 | 日本ビルファンド        | 日本 | 投資証券 | 32,293                   | 639,610.40<br>20,654,938,902 | 647,000.00<br>20,893,571,000 | 7.49            |
| 2 | ジャパンリアルエステイト    | 日本 | 投資証券 | 29,944                   | 617,786.16<br>18,498,989,055 | 637,000.00<br>19,074,328,000 | 6.83            |
| 3 | 野村不動産マスターF      | 日本 | 投資証券 | 95,670                   | 169,316.45<br>16,198,505,262 | 176,800.00<br>16,914,456,000 | 6.06            |
| 4 | 日本リテールファンド      | 日本 | 投資証券 | 58,370                   | 246,357.44<br>14,379,883,832 | 236,600.00<br>13,810,342,000 | 4.95            |
| 5 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 日本 | 投資証券 | 69,595                   | 183,399.32<br>12,763,675,872 | 177,900.00<br>12,380,950,500 | 4.44            |
| 6 | オリックス不動産投資      | 日本 | 投資証券 | 57,739                   | 181,066.52<br>10,454,600,321 | 184,500.00<br>10,652,845,500 | 3.82            |
| 7 | 日本プロロジスリート      | 日本 | 投資証券 | 43,529                   | 247,733.54<br>10,783,593,547 | 238,900.00<br>10,399,078,100 | 3.73            |
| 8 | 大和ハウスリート投資法人    | 日本 | 投資証券 | 34,747                   | 281,824.34<br>9,792,550,558  | 295,600.00<br>10,271,213,200 | 3.68            |
| 9 | アドバンス・レジデンス     | 日本 | 投資証券 | 30,875                   | 271,492.44<br>8,382,329,282  | 309,000.00<br>9,540,375,000  | 3.42            |

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 投資証券      | 98.92% |
| 合計        | 98.92% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類          | 地域 | 資産名                | 買建/<br>売建 | 数量    | 簿価            | 時価            | 投資<br>比率 |
|-------------|----|--------------------|-----------|-------|---------------|---------------|----------|
| 不動産投信指数先物取引 | 日本 | 東証REIT指数先物 2017年3月 | 買建        | 1,618 | 2,848,537,944 | 2,973,075,000 | 1.07%    |

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

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

#### ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

#### (1) 投資状況 (平成28年12月30日現在)

##### 投資状況

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

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

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

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

## (2) 投資資産 (平成28年12月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                       | 地域   | 種類   | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)        | 評価単価<br>時価<br>(円)        | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|---------------------------|------|------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|
| 1 | SIMON PROPERTY GROUP INC  | アメリカ | 投資証券 | 16,347                   | 21,236.35<br>347,151,162 | 20,499.91<br>335,112,032 | 5.29            |
| 2 | PUBLIC STORAGE            | アメリカ | 投資証券 | 7,700                    | 24,561.91<br>189,127,223 | 25,674.39<br>197,692,849 | 3.12            |
| 3 | PROLOGIS INC              | アメリカ | 投資証券 | 27,446                   | 6,002.49<br>164,744,613  | 6,088.93<br>167,116,836  | 2.64            |
| 4 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | アメリカ | 投資証券 | 7,000                    | 19,292.95<br>135,050,701 | 20,455.64<br>143,189,508 | 2.26            |
| 5 | WELLTOWER INC             | アメリカ | 投資証券 | 18,500                   | 7,483.43<br>138,444,171  | 7,661.54<br>141,738,625  | 2.24            |
| 6 | UNIBAIL-RODAMCO SE        | フランス | 投資証券 | 5,150                    | 25,936.69<br>133,574,338 | 27,386.64<br>141,041,196 | 2.23            |

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 投資証券      | 98.40% |
| 合計        | 98.40% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ダイワ日本債券インデックスマザーファンド( B P I )

#### (1) 投資状況(平成28年12月30日現在)

##### 投資状況

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

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

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

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

## (2) 投資資産（平成28年12月30日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

|    | 銘柄名       | 地域 | 種類   | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)     | 評価単価<br>時価<br>(円)     | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-----------|----|------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------|
| 1  | 125 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 180,000,000              | 100.84<br>181,521,540 | 100.85<br>181,540,800 | 0.100000<br>2020/09/20   | 1.19            |
| 2  | 344 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 180,000,000              | 100.82<br>181,478,700 | 100.67<br>181,218,600 | 0.100000<br>2026/09/20   | 1.19            |
| 3  | 116 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 163,000,000              | 100.77<br>164,256,730 | 100.77<br>164,263,250 | 0.200000<br>2018/12/20   | 1.08            |
| 4  | 334 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 156,000,000              | 104.84<br>163,558,200 | 104.74<br>163,403,760 | 0.600000<br>2024/06/20   | 1.07            |
| 5  | 341 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 158,000,000              | 102.74<br>162,344,120 | 102.64<br>162,171,200 | 0.300000<br>2025/12/20   | 1.06            |
| 6  | 127 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 159,000,000              | 100.90<br>160,440,540 | 100.92<br>160,477,110 | 0.100000<br>2021/03/20   | 1.05            |
| 7  | 333 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 153,000,000              | 104.75<br>160,281,270 | 104.66<br>160,129,800 | 0.600000<br>2024/03/20   | 1.05            |
| 8  | 338 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 152,000,000              | 103.51<br>157,343,560 | 103.40<br>157,180,160 | 0.400000<br>2025/03/20   | 1.03            |
| 9  | 126 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 154,000,000              | 100.87<br>155,349,860 | 100.89<br>155,376,760 | 0.100000<br>2020/12/20   | 1.02            |
| 10 | 343 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 152,000,000              | 100.90<br>153,377,120 | 100.75<br>153,146,080 | 0.100000<br>2026/06/20   | 1.00            |
| 11 | 339 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 145,000,000              | 103.53<br>150,120,150 | 103.42<br>149,966,250 | 0.400000<br>2025/06/20   | 0.98            |
| 12 | 128 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 147,000,000              | 100.93<br>148,375,920 | 100.96<br>148,414,140 | 0.100000<br>2021/06/20   | 0.97            |

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率



| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 国債証券      | 78.10% |
| 地方債証券     | 8.11%  |
| 特殊債券      | 6.10%  |
| 社債券       | 6.01%  |
| 合計        | 98.32% |

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 外国債券インデックスマザーファンド

#### (1) 投資状況（平成28年12月30日現在）

##### 投資状況

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

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

## その他の資産の投資状況

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

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

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

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

## (2) 投資資産（平成28年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

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

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 国債証券      | 98.61% |
| 合計        | 98.61% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

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

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

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

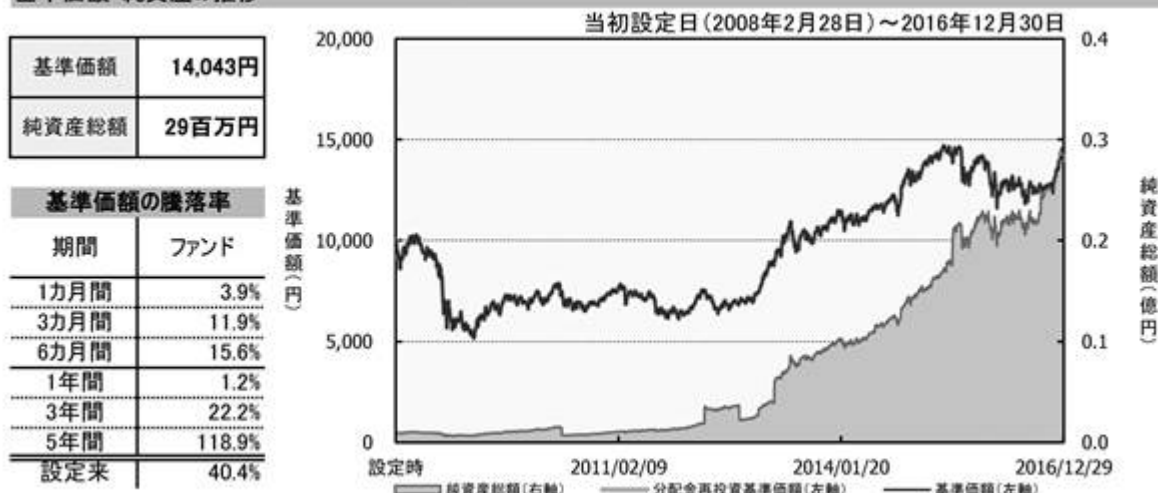
(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

### (参考情報) 運用実績

2016年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

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



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 第1期    | 第2期    | 第3期    | 第4期    | 第5期    | 第6期    | 第7期    | 第8期    | 第9期    |  |  |
|-----|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--|--|
|     | 08年12月 | 09年12月 | 10年12月 | 11年12月 | 12年12月 | 13年12月 | 14年12月 | 15年12月 | 16年12月 |  |  |
| 分配金 | 0円     | 0円     | 0円     | 0円     | 0円     | 0円     | 0円     | 0円     | 0円     |  |  |

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

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

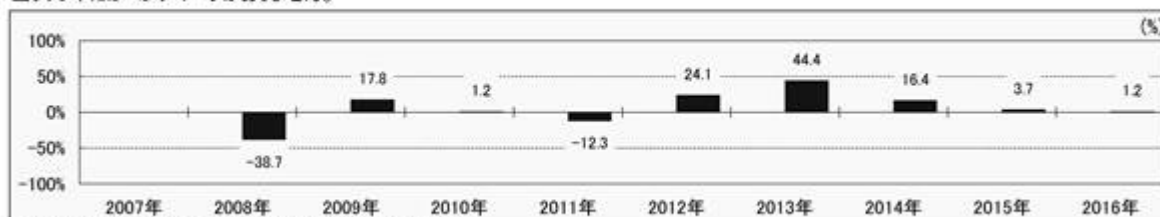
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.8%保有しております。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

##### （注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

##### （注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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



### 3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

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

#### (4) 【計算期間】

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

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

#### (5) 【その他】

信託の終了

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

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

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

#### 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1. の事項(前1. の変更事項にあっては、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9期計算期間（平成27年12月19日から平成28年12月19日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

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

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 第8期                            |           | 第9期                            |           |
|---|--------------------------------|-----------|--------------------------------|-----------|
|   | 自 平成26年12月19日<br>至 平成27年12月18日 |           | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日 |           |
| 営業収益                                      |                                |           |                                |           |
| 有価証券売買等損益                                 |                                | 958,087   |                                | 1,222,479 |
| 営業収益合計                                    |                                | 958,087   |                                | 1,222,479 |
| 営業費用                                      |                                |           |                                |           |
| 受託者報酬                                     |                                | 9,768     |                                | 8,403     |
| 委託者報酬                                     |                                | 118,090   |                                | 96,159    |
| その他費用                                     |                                | 1,264     |                                | 1,627     |
| 営業費用合計                                    |                                | 129,122   |                                | 106,189   |
| 営業利益                                      |                                | 828,965   |                                | 1,116,290 |
| 経常利益                                      |                                | 828,965   |                                | 1,116,290 |
| 当期純利益                                     |                                | 828,965   |                                | 1,116,290 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） |                                | 38,178    |                                | 97,792    |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           |                                | 3,168,844 |                                | 6,151,952 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |                                | 2,472,709 |                                | 1,526,445 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                                | 2,472,709 |                                | 1,526,445 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |                                | 280,388   |                                | 409,715   |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |                                | 280,388   |                                | 409,715   |
| 分配金                                       |                                | 1 -       |                                | 1 -       |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           |                                | 6,151,952 |                                | 8,482,764 |

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                        | 第9期   |               |
|----------------------------|---|---------------|
|                            | 自 平成27年12月19日   | 至 平成28年12月19日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。  |               |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>平成28年12月18日が休日のため、当計算期間末日を平成28年12月19日としております。このため、当計算期間は367日となっております。 |               |

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第8期                            | 第9期                            |
|-----|--------------------------------|--------------------------------|
|     | 自 平成26年12月19日<br>至 平成27年12月18日 | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19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(790,787円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,403,170円)及び分配準備積立金(3,701,963円)より分配可能額は7,895,920円(1万口当たり4,898.64円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,214,082円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,815,582円)及び分配準備積立金(4,218,891円)より分配可能額は11,248,555円(1万口当たり5,491.34円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。</p> |
|-------------------|--|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分               | 第9期<br>自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日  |
|-------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。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。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。   |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                          | 第9期   |
|------------------------------|---|
|                              | 平成28年12月19日現在   |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>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<br>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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第8期                      | 第9期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 平成27年12月18日現在            | 平成28年12月19日現在            |
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 872,349                  | 1,463,924                |
| 合計        | 872,349                  | 1,463,924                |

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 第8期           | 第9期           |
|---------------|---------------|
| 平成27年12月18日現在 | 平成28年12月19日現在 |
| 該当事項はありません。   | 該当事項はありません。   |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第9期   |
|---|
| 自 平成27年12月19日   |
| 至 平成28年12月19日   |
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行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8期<br>平成27年12月18日現在 | 第9期<br>平成28年12月19日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.3817円<br>(13,817円) | 1.4141円<br>(14,141円) |

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類           | 銘 柄                             | 券面総額       | 評価額<br>(円) | 備考 |
|---------------|---------------------------------|------------|------------|----|
| 親投資信託受益<br>証券 | トピックス・インデックス・マザー<br>ファンド        | 12,636,946 | 11,906,530 |    |
|               | 外国株式インデックスマザーファンド               | 3,621,406  | 7,575,619  |    |
|               | 外国債券インデックスマザーファンド               | 932,613    | 2,523,091  |    |
|               | ダイワJ-REITマザーファンド                | 900,684    | 2,199,560  |    |
|               | ダイワ・グローバルREITインデッ<br>クス・マザーファンド | 946,555    | 2,044,748  |    |
|               | ダイワ日本債券インデックスマザー<br>ファンド(BPI)   | 2,109,162  | 2,668,089  |    |
| 親投資信託受益証券 合計  |                                 |            | 28,917,637 |    |
| 合計            |                                 |            | 28,917,637 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

#### 「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

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

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

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                    | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日   |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | <p>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。<br/>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。<br/>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | <p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>  |
| 3. 収益及び費用の計上基準         | <p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>  |

## (貸借対照表に関する注記)

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

|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| 適格機関投資家専用投信1号                            | 1,616,982,752円  | - 円             |
| トピックス・インデックス<br>ファンド                     | 5,766,841,215円  | 5,497,265,486円  |
| ダイワ・トピックス・イン<br>デックスファンドVA               | 16,565,398,041円 | 13,563,265,198円 |
| 適格機関投資家専用・ダイ<br>ワ・トピックスインデックス<br>ファンドVA2 | 135,236,221円    | 126,601,870円    |
| ダイワ国内重視バランスファ<br>ンド30VA(一般投資家私<br>募)     | 194,101,497円    | 141,686,038円    |
| ダイワ国内重視バランスファ<br>ンド50VA(一般投資家私<br>募)     | 2,983,968,923円  | 2,316,749,433円  |
| ダイワ国際分散バランスファ<br>ンド30VA(一般投資家私<br>募)     | 120,484,753円    | 96,793,829円     |
| ダイワ国際分散バランスファ<br>ンド50VA(一般投資家私<br>募)     | 4,114,870,417円  | 3,260,080,900円  |
| D-I's TOPIXイン<br>デックス                    | 33,518,296円     | 22,437,751円     |
| 為替ヘッジ付米国国債プラス<br>日本株式ファンド                | - 円             | 27,594,657円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050                   | - 円             | 593,766円        |
| iFree TOPIXイン<br>デックス                    | - 円             | 123,752,399円    |
| iFree 8資産バランス                            | - 円             | 117,889,334円    |
| DCダイワ日本株式インデッ<br>クス                      | 61,188,349,174円 | 62,984,417,547円 |
| ダイワ・ライフ・バランス3<br>0                       | 1,968,640,569円  | 2,349,453,806円  |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0                       | 2,029,305,717円  | 2,364,986,060円  |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0                       | 1,919,810,266円  | 2,111,458,667円  |
| 年金ダイワ日本株式インデッ<br>クス                      | 3,488,114,265円  | 3,809,681,060円  |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2020                   | 23,279,953円     | 22,874,733円     |

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

|    |                                   |   |   |
|----|-----------------------------------|---|---|
|    | ダイワライフスタイル5 0                     | 597,732,716円  | 673,841,558円  |
|    | ダイワライフスタイル7 5                     | 467,121,755円  | 509,571,158円  |
|    | DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド) | 15,916,963,209円   | 15,909,343,740円   |
|    | 計                                 | 140,729,416,146円  | 138,207,285,313円  |
| 2. | 期末日における受益権の総数                     | 140,729,416,146口  | 138,207,285,313口  |
| 3. | 2 元本の欠損                           | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は11,935,123,513円であります。          | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,995,060,131円であります。           |
| 4. | 3 貸付有価証券                          | 株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。<br>株式 2,711,570,200円     | 株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。<br>株式 3,737,943,250円     |
| 5. | 4 差入委託証拠金代用有価証券                   | 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。<br>株式 765,800,000円 | 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。<br>株式 714,400,000円 |
| 6. | 5 その他未収収益                         | 貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分1,258,350円が含まれております。                    | 貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分1,709,350円が含まれております。                    |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分             | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日   |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |



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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

|  |               |               |
|--|---------------|---------------|
|  | 平成27年12月18日現在 | 平成28年12月19日現在 |
|--|---------------|---------------|

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 株式関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

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

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

(注) 1. 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

トヨタ自動車 100,000株

2. 貸付株式数のうち（括弧書）の数字は、委託者の利害関係人である大和証券株式会社に対する貸付であります。

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

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

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

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日  |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> |

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



## (貸借対照表に関する注記)

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

|    |                             |                 |                 |
|----|-----------------------------|-----------------|-----------------|
|    | ダイワ・ライフ・バランス50              | 623,597,529円    | 725,810,195円    |
|    | ダイワ・ライフ・バランス70              | 491,420,954円    | 538,721,875円    |
|    | 大和DC海外株式インデックスファンド          | 1,406,631,036円  | 1,464,751,026円  |
|    | DCダイワ・ターゲットイヤー2020          | 7,648,234円      | 7,245,662円      |
|    | DCダイワ・ターゲットイヤー2030          | 13,014,049円     | 14,997,798円     |
|    | DCダイワ・ターゲットイヤー2040          | 2,985,761円      | 3,621,406円      |
|    | ダイワ世界分散バランスファンド15VA         | 207,864円        | 100,000円        |
|    | ダイワ世界分散バランスファンド20VA         | 1,203,627円      | 197,107円        |
|    | ダイワ世界分散バランスファンド25VA         | 18,503,727円     | 19,292,523円     |
|    | ダイワ世界分散バランスファンド30VA         | 163,351,857円    | 150,605,980円    |
|    | ダイワ世界バランスファンド40VA           | 2,140,275,783円  | 1,943,779,185円  |
|    | ダイワ世界バランスファンド60VA           | 533,285,293円    | 521,063,437円    |
|    | ダイワ・バランスファンド35VA            | 5,345,204,620円  | 4,894,517,852円  |
|    | ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用) | 244,716,827円    | 227,433,106円    |
|    | ダイワ・インデックスセレクト 外国株式         | 269,990,197円    | 391,241,366円    |
|    | ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド          | - 円             | 23,106,461円     |
|    | ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス          | 2,980,922,871円  | 3,000,082,219円  |
|    | ダイワライフスタイル25                | 21,630,820円     | 23,116,958円     |
|    | ダイワライフスタイル50                | 68,685,540円     | 77,484,135円     |
|    | ダイワライフスタイル75                | 54,127,675円     | 58,775,327円     |
| 計  |                             | 38,798,220,086円 | 40,367,016,462円 |
| 2. | 期末日における受益権の総数               | 38,798,220,086口 | 40,367,016,462口 |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                            | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日   |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク                | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>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。<br>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<br>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。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                          | 平成28年12月19日現在  |
|------------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引 |

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種 類  | 平成27年12月18日現在          | 平成28年12月19日現在          |
|------|------------------------|------------------------|
|      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 株式   | 2,283,954,721          | 2,314,032,757          |
| 投資証券 | 6,553,724              | 26,449,973             |
| 合計   | 2,290,508,445          | 2,340,482,730          |

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 株式関連

| 種 類          | 平成27年12月18日 現在 |           |             |             | 平成28年12月19日 現在 |           |               |             |
|--------------|----------------|-----------|-------------|-------------|----------------|-----------|---------------|-------------|
|              | 契約額等           |           | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) | 契約額等           |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|              | (円)            | うち<br>1年超 |             |             | (円)            | うち<br>1年超 |               |             |
| 市場取引         |                |           |             |             |                |           |               |             |
| 株価指数<br>先物取引 |                |           |             |             |                |           |               |             |
| 買 建          | 980,507,952    | -         | 992,022,012 | 11,514,060  | 1,060,857,918  | -         | 1,061,163,756 | 305,838     |
| 合計           | 980,507,952    | -         | 992,022,012 | 11,514,060  | 1,060,857,918  | -         | 1,061,163,756 | 305,838     |

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

| 種 類       | 平成27年12月18日 現在 |           |           |             | 平成28年12月19日 現在 |           |             |             |
|-----------|----------------|-----------|-----------|-------------|----------------|-----------|-------------|-------------|
|           | 契約額等           |           | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) | 契約額等           |           | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) |
|           | (円)            | うち<br>1年超 |           |             | (円)            | うち<br>1年超 |             |             |
| 市場取引以外の取引 |                |           |           |             |                |           |             |             |
| 為替予約取引    |                |           |           |             |                |           |             |             |
| 売 建       | -              | -         | -         | -           | 135,974,736    | -         | 135,535,800 | 438,936     |
| アメリカ・ドル   | -              | -         | -         | -           | 111,079,800    | -         | 110,562,800 | 517,000     |
| イギリス・ポンド  | -              | -         | -         | -           | 24,894,936     | -         | 24,973,000  | 78,064      |
| 合計        | -              | -         | -         | -           | 135,974,736    | -         | 135,535,800 | 438,936     |

### (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## （1口当たり情報）

|                           | 平成27年12月18日現在        | 平成28年12月19日現在        |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.9983円<br>(19,983円) | 2.0919円<br>(20,919円) |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

| 通貨                              | 銘柄                               | 株式数     | 評価額           |               | 備考 |
|---------------------------------|----------------------------------|---------|---------------|---------------|----|
|                                 |                                  |         | 単価            | 金額            |    |
| アメリカ・ドル                         |                                  | 株       | アメリカ・ドル       | アメリカ・ドル       |    |
|                                 | BROADRIDGE FINANCIAL<br>SOLUTION | 2,700   | 65.480        | 176,796.000   |    |
|                                 | PALO ALTO NETWORKS INC           | 2,100   | 129.320       | 271,572.000   |    |
|                                 | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC         | 1,450   | 105.390       | 152,815.500   |    |
|                                 | SYNCHRONY FINANCIAL              | 19,600  | 36.630        | 717,948.000   |    |
|                                 | ABBOTT LABORATORIES              | 34,100  | 38.100        | 1,299,210.000 |    |
|                                 | ARCONIC INC                      | 10,333  | 20.260        | 209,346.580   |    |
|                                 | VERISK ANALYTICS INC             | 3,750   | 81.780        | 306,675.000   |    |
|                                 | LAS VEGAS SANDS CORP             | 10,100  | 57.010        | 575,801.000   |    |
|                                 | AMPHENOL CORP-CL A               | 7,200   | 67.400        | 485,280.000   |    |
|                                 | FIDELITY NATIONAL INFO SERV      | 7,179   | 76.640        | 550,198.560   |    |
|                                 | QORVO INC                        | 3,200   | 54.690        | 175,008.000   |    |
|                                 | AFLAC INC                        | 9,300   | 69.410        | 645,513.000   |    |
|                                 | DARDEN RESTAURANTS INC           | 2,750   | 75.530        | 207,707.500   |    |
|                                 | ADOBE SYSTEMS INC                | 11,450  | 103.550       | 1,185,647.500 |    |
|                                 | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC       | 5,000   | 29.480        | 147,400.000   |    |
|                                 | LULULEMON ATHLETICA INC          | 2,500   | 66.420        | 166,050.000   |    |
|                                 | PEOPLE'S UNITED FINANCIAL        | 6,800   | 19.110        | 129,948.000   |    |
|                                 | GARMIN LTD                       | 2,600   | 48.990        | 127,374.000   |    |
|                                 | AETNA INC                        | 8,079   | 126.810       | 1,024,497.990 |    |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS<br>INC | 4,750                            | 147.430 | 700,292.500   |               |    |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC     | 16,600                           | 116.380 | 1,931,908.000 |               |    |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC       | 3,751                            | 50.090  | 187,887.590   |               |    |
| WR BERKLEY CORP                 | 2,100                            | 65.710  | 137,991.000   |               |    |
| AUTOZONE INC                    | 670                              | 794.720 | 532,462.400   |               |    |

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

|                 |                                  |        |                 |  |  |
|-----------------|----------------------------------|--------|-----------------|--|--|
| スウェーデン・<br>クローナ |                                  | 株      | スウェーデン・クロー<br>ナ | スウェーデン・クロー<br>ナ                                    |  |
|                 | ICA GRUPPEN AB                   | 1,900  | 271.200         | 515,280.000  |  |
|                 | ERICSSON LM-B SHS                | 72,230 | 55.850          | 4,034,045.500                                      |  |
|                 | VOLVO AB-B SHS                   | 34,500 | 108.500         | 3,743,250.000                                      |  |
|                 | MILLICOM INTL CELLULAR-SDR       | 1,500  | 390.000         | 585,000.000  |  |
|                 | SKF AB-B SHARES                  | 8,650  | 170.000         | 1,470,500.000                                      |  |
|                 | ELECTROLUX AB-SER B              | 5,450  | 226.900         | 1,236,605.000                                      |  |
|                 | NORDEA BANK AB                   | 70,650 | 103.500         | 7,312,275.000                                      |  |
|                 | SWEDISH MATCH AB                 | 4,550  | 298.000         | 1,355,900.000                                      |  |
|                 | TELE2 AB-B SHS                   | 8,950  | 72.400          | 647,980.000  |  |
|                 | GETINGE AB-B SHS                 | 4,700  | 147.800         | 694,660.000  |  |
|                 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-<br>A | 34,150 | 98.900          | 3,377,435.000                                      |  |
|                 | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS      | 35,200 | 131.200         | 4,618,240.000                                      |  |
|                 | SWEDBANK AB - A SHARES           | 21,300 | 227.000         | 4,835,100.000                                      |  |
|                 | HENNES & MAURITZ AB-B SHS        | 21,700 | 258.300         | 5,605,110.000                                      |  |
|                 | SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B       | 14,100 | 254.500         | 3,588,450.000                                      |  |
|                 | SKANSKA AB-B SHS                 | 8,250  | 217.700         | 1,796,025.000                                      |  |
|                 | SANDVIK AB                       | 24,450 | 116.200         | 2,841,090.000                                      |  |
|                 | INVESTOR AB-B SHS                | 10,800 | 342.200         | 3,695,760.000                                      |  |
|                 | ATLAS COPCO AB-A SHS             | 15,700 | 286.200         | 4,493,340.000                                      |  |
|                 | SECURITAS AB-B SHS               | 9,200  | 138.200         | 1,271,440.000                                      |  |
|                 | TELIA CO AB                      | 60,000 | 36.750          | 2,205,000.000                                      |  |
|                 | ALFA LAVAL AB                    | 7,000  | 149.100         | 1,043,700.000                                      |  |
|                 | ATLAS COPCO AB-B SHS             | 9,100  | 256.300         | 2,332,330.000                                      |  |
|                 | ASSA ABLOY AB-B                  | 23,300 | 171.700         | 4,000,610.000                                      |  |
|                 | LUNDBERGS AB-B SHS               | 900    | 548.500         | 493,650.000  |  |
|                 | LUNDIN PETROLEUM AB              | 5,000  | 194.000         | 970,000.000  |  |
|                 | BOLIDEN AB                       | 6,000  | 251.600         | 1,509,600.000                                      |  |
|                 | HUSQVARNA AB-B SHS               | 9,750  | 69.350          | 676,162.500  |  |
|                 | KINNEVIK AB - B                  | 5,300  | 227.500         | 1,205,750.000                                      |  |
|                 | HEXAGON AB-B SHS                 | 6,200  | 329.100         | 2,040,420.000                                      |  |
|                 | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS          | 3,500  | 169.500         | 593,250.000  |  |
| スウェーデン・クローナ 小計  |                                  |        |                 | スウェーデン・クロー<br>ナ<br>74,787,958.000<br>(940,832,512) |  |
| デンマーク・ク<br>ローネ  |                                  | 株      | デンマーク・クローネ      | デンマーク・クローネ   |  |



|             |                           |        |             |   |  |
|-------------|---------------------------|--------|-------------|---|--|
|             | NOVO NORDISK A/S-B        | 44,500 | 255.300     | 11,360,850.000                                |  |
|             | DANSKE BANK A/S           | 16,350 | 214.400     | 3,505,440.000                                 |  |
|             | ISS A/S                   | 3,900  | 241.500     | 941,850.000                                   |  |
|             | AP MOELLER-MAERSK A/S-A   | 95     | 10,940.000  | 1,039,300.000                                 |  |
|             | VESTAS WIND SYSTEMS A/S   | 5,200  | 432.500     | 2,249,000.000                                 |  |
|             | TDC A/S                   | 19,300 | 35.420      | 683,606.000                                   |  |
|             | CARLSBERG AS-B            | 2,450  | 599.500     | 1,468,775.000                                 |  |
|             | NOVOZYMES A/S-B SHARES    | 5,500  | 242.800     | 1,335,400.000                                 |  |
|             | COLOPLAST-B               | 2,800  | 470.000     | 1,316,000.000                                 |  |
|             | DSV A/S                   | 4,600  | 311.000     | 1,430,600.000                                 |  |
|             | WILLIAM DEMANT HOLDING    | 3,375  | 124.500     | 420,187.500                                   |  |
|             | AP MOLLER-MAERSK A/S-B    | 150    | 11,520.000  | 1,728,000.000                                 |  |
|             | PANDORA A/S               | 2,650  | 860.000     | 2,279,000.000                                 |  |
|             | CHR HANSEN HOLDING A/S    | 2,350  | 386.900     | 909,215.000                                   |  |
|             | GENMAB A/S                | 1,300  | 1,139.000   | 1,480,700.000                                 |  |
|             | DONG ENERGY A/S           | 2,000  | 246.000     | 492,000.000                                   |  |
|             | デンマーク・クローネ 小計             |        |             | デンマーク・クローネ<br>32,639,923.500<br>(540,190,734) |  |
| ニュージーランド・ドル |                           | 株      | ニュージーランド・ドル | ニュージーランド・ドル                                   |  |
|             | MERIDIAN ENERGY LTD       | 26,000 | 2.520       | 65,520.000                                    |  |
|             | SPARK NEW ZEALAND LTD     | 52,689 | 3.400       | 179,142.600                                   |  |
|             | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 23,400 | 6.350       | 148,590.000                                   |  |
|             | CONTACT ENERGY LTD        | 13,000 | 4.700       | 61,100.000                                    |  |
|             | FLETCHER BUILDING LTD     | 20,100 | 10.320      | 207,432.000                                   |  |
|             | RYMAN HEALTHCARE LTD      | 5,300  | 8.100       | 42,930.000                                    |  |
|             | ニュージーランド・ドル 小計            |        |             | ニュージーランド・ドル<br>704,714.600<br>(57,835,927)    |  |
| ノルウェー・クローネ  |                           | 株      | ノルウェー・クローネ  | ノルウェー・クローネ                                    |  |
|             | NORSK HYDRO ASA           | 30,600 | 41.530      | 1,270,818.000                                 |  |
|             | DNB ASA                   | 22,550 | 131.200     | 2,958,560.000                                 |  |
|             | ORKLA ASA                 | 19,050 | 76.500      | 1,457,325.000                                 |  |
|             | TELENOR ASA               | 17,800 | 130.000     | 2,314,000.000                                 |  |
|             | STATOIL ASA               | 26,173 | 158.000     | 4,135,334.000                                 |  |
|             | SCHIBSTED ASA-CL A        | 1,500  | 187.500     | 281,250.000                                   |  |
|             | YARA INTERNATIONAL ASA    | 4,160  | 327.000     | 1,360,320.000                                 |  |

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

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

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

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

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

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

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



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

## (2) 株式以外の有価証券

| 種類   | 通貨      | 銘柄                        | 券面総額   | 評価額           | 備考 |
|------|---------|---------------------------|--------|---------------|----|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 3,197  | 552,857.210   |    |
|      |         | SIMON PROPERTY GROUP INC  | 7,187  | 1,302,931.230 |    |
|      |         | BOSTON PROPERTIES INC     | 3,600  | 447,624.000   |    |
|      |         | GENERAL GROWTH PROPERTIES | 13,600 | 354,824.000   |    |

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

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

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

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

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

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

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

|    |                             |   |   |
|----|-----------------------------|---|---|
|    | ダイワJ-REITオープン<br>(年1回決算型)   | 548,507,585円  | 426,116,567円  |
|    | DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050      | - 円   | 18,797円   |
|    | iFree J-REITイ<br>ンデックス      | - 円   | 33,242,209円   |
|    | iFree 8資産バランス               | - 円   | 45,191,617円   |
|    | DC・ダイワJ-REIT<br>オープン        | 2,463,050,337円  | 3,226,297,529円  |
|    | DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2020      | 3,361,662円  | 3,357,905円  |
|    | DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2030      | 4,320,123円  | 4,855,028円  |
|    | DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2040      | 783,940円  | 900,684円  |
|    | ダイワ・ノーロード J-R<br>EITファンド    | 2,376,414円  | 51,513,007円   |
|    | ダイワファンドラップ J-<br>REITインデックス | - 円   | 188,297,819円  |
|    | ダイワ・インデックスセク<br>ト J-REIT    | 845,096,891円  | 1,235,003,836円  |
|    | 計                           | 89,610,737,405円   | 105,872,694,601円  |
| 2. | 期末日における受益権の総数               | 89,610,737,405口   | 105,872,694,601口  |
| 3. | 2 差入委託証拠金代用有価証券             | 先物取引に係る差入委託証拠<br>金代用有価証券として以下の<br>とおり差入を行っております。<br>投資証券 175,500,000円 | 先物取引に係る差入委託証拠<br>金代用有価証券として以下の<br>とおり差入を行っております。<br>投資証券 377,400,000円 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分             | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日   |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4<br>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<br>の基本方針」に従っております。 |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類 | 平成27年12月18日現在      | 平成28年12月19日現在      |
|-----|--------------------|--------------------|
|     | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|     |                    |                    |



|      |                |               |
|------|----------------|---------------|
| 投資証券 | 17,644,873,811 | 2,912,964,927 |
| 合計   | 17,644,873,811 | 2,912,964,927 |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成27年9月16日から平成27年12月18日まで、及び平成28年9月16日から平成28年12月19日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 不動産投信関連

| 種 類             | 平成27年12月18日 現在 |           |               |             | 平成28年12月19日 現在 |           |               |             |
|-----------------|----------------|-----------|---------------|-------------|----------------|-----------|---------------|-------------|
|                 | 契約額等           |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等           |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|                 | (円)            | うち<br>1年超 |               |             | (円)            | うち<br>1年超 |               |             |
| 市場取引            |                |           |               |             |                |           |               |             |
| 不動産投信<br>指数先物取引 |                |           |               |             |                |           |               |             |
| 買 建             | 1,645,575,000  | -         | 1,656,480,000 | 10,905,000  | 2,667,788,200  | -         | 2,688,378,000 | 20,589,800  |
| 合計              | 1,645,575,000  | -         | 1,656,480,000 | 10,905,000  | 2,667,788,200  | -         | 2,688,378,000 | 20,589,800  |

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

|              | 平成27年12月18日現在 | 平成28年12月19日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.2966円       | 2.4421円       |
| (1万口当たり純資産額) | (22,966円)     | (24,421円)     |

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

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

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

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注) 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

日本ビルファンド

600口

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分                | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日 |
|--------------------|--------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | (1) 株式                         |

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
|                                   | <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |
| <p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>     | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>  |
| <p>3. 収益及び費用の計上基準</p>             | <p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>  |
| <p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> | <p>外貨建取引等の処理基準</p>   |

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                                      | 平成27年12月18日現在  | 平成28年12月19日現在  |
|--|----------------|----------------|
| 1. 1 期首                                  | 平成26年12月19日    | 平成27年12月19日    |
| 期首元本額                                    | 1,002,906,361円 | 1,288,622,228円 |
| 期中追加設定元本額                                | 424,653,012円   | 1,695,507,019円 |
| 期中一部解約元本額                                | 138,937,145円   | 122,769,305円   |
| 期末元本額の内訳                                 |                |                |
| ファンド名                                    |                |                |
| ダイワファンドラップ 外国<br>REITインデックス(為替<br>ヘッジあり) | - 円            | 1,071,680,040円 |
| ダイワファンドラップ 外国<br>REITインデックス(為替<br>ヘッジなし) | - 円            | 109,360,983円   |
| D-I's グローバルREIT<br>インデックス                | 1,578,317円     | 1,488,344円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050                   | - 円            | 23,511円        |
| iFree 外国REITイ<br>ンデックス                   | - 円            | 45,690,995円    |
| iFree 8資産バランス                            | - 円            | 51,307,248円    |
| DCダイワ・グローバルRE<br>ITインデックスファンド            | 1,046,671,568円 | 1,275,948,091円 |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2020                   | 3,586,968円     | 3,847,988円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2030                   | 4,599,958円     | 5,708,895円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2040                   | 735,980円       | 946,555円       |

|                             |                |                |
|-----------------------------|----------------|----------------|
| ダイワ・インデックスセレクト<br>グローバルREIT | 231,449,437円   | 278,156,453円   |
| ダイワ・ノーロード<br>グローバルREITファンド  | - 円            | 17,200,839円    |
| 計                           | 1,288,622,228円 | 2,861,359,942円 |
| 2. 期末日における受益権の総数            | 1,288,622,228口 | 2,861,359,942口 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                            | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日   |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク                | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>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。<br>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<br>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。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。                   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                          | 平成28年12月19日現在                               |
|------------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>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<br/>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<br/>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
|-----------------|--|

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 平成27年12月18日現在          | 平成28年12月19日現在          |
|------|------------------------|------------------------|
|      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 株式   | 18,776                 | -                      |
| 投資証券 | 11,134,703             | 78,564,867             |
| 合計   | 11,115,927             | 78,564,867             |

## （注）

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

| 種 類       | 平成27年12月18日 現在 |           |           |             | 平成28年12月19日 現在 |           |            |             |
|-----------|----------------|-----------|-----------|-------------|----------------|-----------|------------|-------------|
|           | 契約額等           |           | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) | 契約額等           |           | 時価<br>(円)  | 評価損益<br>(円) |
|           | (円)            | うち<br>1年超 |           |             | (円)            | うち<br>1年超 |            |             |
| 市場取引以外の取引 |                |           |           |             |                |           |            |             |
| 為替予約取引    |                |           |           |             |                |           |            |             |
| 買 建       | 988,014        | -         | 987,880   | 134         | 78,779,958     | -         | 78,773,858 | 6,100       |
| アメリカ・ドル   | -              | -         | -         | -           | 52,932,825     | -         | 52,929,000 | 3,825       |



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

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|    |                                |
|----|--------------------------------|
| 区分 | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日 |
|----|--------------------------------|

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

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分           | 平成27年12月18日現在   | 平成28年12月19日現在   |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首       | 平成26年12月19日     | 平成27年12月19日     |
| 期首元本額         | 12,150,667,512円 | 12,066,650,337円 |
| 期中追加設定元本額     | 2,076,977,956円  | 1,822,199,066円  |
| 期中一部解約元本額     | 2,160,995,131円  | 2,112,530,721円  |
| 期末元本額の内訳      |                 |                 |
| ファンド名         |                 |                 |
| DCダイワ・ターゲットイ  | - 円             | 34,845円         |
| ヤー2050        |                 |                 |
| iFree 日本債券イン  | - 円             | 43,708,353円     |
| デックス          |                 |                 |
| iFree 8資産バランス | - 円             | 87,248,594円     |
| ダイワ・ライフ・バランス3 | 4,100,520,552円  | 4,310,465,771円  |
| 0             |                 |                 |
| ダイワ・ライフ・バランス5 | 2,089,147,275円  | 2,079,954,504円  |
| 0             |                 |                 |
| ダイワ・ライフ・バランス7 | 653,033,981円    | 662,333,867円    |
| 0             |                 |                 |
| DCダイワ・ワールドアセッ | 503,171,259円    | 508,103,224円    |
| ト（六つの羽ノ安定コース） |                 |                 |
| DCダイワ・ワールドアセッ | 401,470,589円    | 413,870,204円    |
| ト（六つの羽ノ6分散コー  |                 |                 |
| ス）            |                 |                 |
| DCダイワ・ワールドアセッ | 120,496,806円    | 120,775,083円    |
| ト（六つの羽ノ成長コース） |                 |                 |
| DCダイワ・ターゲットイ  | 56,509,188円     | 62,143,213円     |
| ヤー2020        |                 |                 |

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

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                            | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日   |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク                | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。<br>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<br>についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

## 金融商品の時価等に関する事項

|     |               |
|-----|---------------|
| 区 分 | 平成28年12月19日現在 |
|-----|---------------|

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類   | 平成27年12月18日現在          | 平成28年12月19日現在          |
|-------|------------------------|------------------------|
|       | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
| 国債証券  | 75,549,370             | 120,367,060            |
| 地方債証券 | 275,274                | 2,089,500              |
| 特殊債券  | 510,500                | 1,477,700              |
| 社債券   | 50,946                 | 482,300                |
| 合計    | 74,712,650             | 124,416,560            |

## (注)

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

## (1口当たり情報)

|              | 平成27年12月18日現在 | 平成28年12月19日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.2305円       | 1.2650円       |
| (1万口当たり純資産額) | (12,305円)     | (12,650円)     |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類         | 銘 柄         | 券面総額<br>(円) | 評価額<br>(円)  | 備考 |
|-------------|-------------|-------------|-------------|----|
| 国債証券        | 3 6 2 2年国債  | 124,000,000 | 124,534,440 |    |
|             | 3 6 4 2年国債  | 20,000,000  | 20,093,800  |    |
|             | 3 6 5 2年国債  | 53,000,000  | 53,248,040  |    |
|             | 3 6 6 2年国債  | 80,000,000  | 80,388,800  |    |
|             | 3 6 8 2年国債  | 133,000,000 | 133,694,260 |    |
|             | 3 7 0 2年国債  | 10,000,000  | 10,056,200  |    |
|             | 1 1 4 5年国債  | 62,000,000  | 62,548,700  |    |
|             | 1 1 6 5年国債  | 163,000,000 | 164,240,430 |    |
|             | 1 1 9 5年国債  | 21,000,000  | 21,139,440  |    |
|             | 1 2 0 5年国債  | 10,000,000  | 10,096,500  |    |
|             | 1 2 1 5年国債  | 35,000,000  | 35,241,150  |    |
|             | 1 2 2 5年国債  | 15,000,000  | 15,106,050  |    |
|             | 1 2 3 5年国債  | 80,000,000  | 80,572,800  |    |
|             | 1 2 4 5年国債  | 110,000,000 | 110,790,900 |    |
|             | 1 2 5 5年国債  | 180,000,000 | 181,353,600 |    |
|             | 1 2 6 5年国債  | 124,000,000 | 124,969,680 |    |
|             | 1 2 7 5年国債  | 159,000,000 | 160,286,310 |    |
|             | 1 2 8 5年国債  | 147,000,000 | 148,193,640 |    |
|             | 1 2 9 5年国債  | 135,000,000 | 136,124,550 |    |
|             | 1 4 0年国債    | 24,000,000  | 35,459,760  |    |
|             | 2 4 0年国債    | 23,000,000  | 32,897,820  |    |
|             | 3 4 0年国債    | 19,000,000  | 27,311,930  |    |
|             | 4 4 0年国債    | 30,000,000  | 43,450,200  |    |
|             | 5 4 0年国債    | 35,000,000  | 48,758,500  |    |
|             | 6 4 0年国債    | 28,000,000  | 38,322,760  |    |
|             | 7 4 0年国債    | 31,000,000  | 40,577,450  |    |
|             | 8 4 0年国債    | 23,000,000  | 27,899,000  |    |
|             | 9 4 0年国債    | 35,000,000  | 30,726,500  |    |
|             | 2 9 6 10年国債 | 35,000,000  | 36,040,200  |    |
|             | 2 9 7 10年国債 | 20,000,000  | 20,633,400  |    |
|             | 2 9 8 10年国債 | 61,000,000  | 62,809,260  |    |
|             | 3 0 0 10年国債 | 8,000,000   | 8,299,920   |    |
|             | 3 0 1 10年国債 | 35,000,000  | 36,446,550  |    |
| 3 0 2 10年国債 | 54,000,000  | 56,096,820  |             |    |
| 3 0 5 10年国債 | 100,000,000 | 104,318,000 |             |    |



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

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

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

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

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

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

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

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

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分                        | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日   |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法     | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>  |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p>   |



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

## (貸借対照表に関する注記)

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

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

|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| ダイワ・バランスファンド 2<br>5 V A（適格機関投資家専<br>用） | 407,666,172円    | 393,370,357円    |
| ダイワ・インデックスセレクト 外国債券                    | 72,906,868円     | 103,674,791円    |
| ダイワ・ノーロード 外国債券<br>ファンド                 | - 円             | 8,299,785円      |
| ダイワ投信倶楽部外国債券イ<br>ンデックス                 | 5,435,216,798円  | 5,596,721,299円  |
| ダイワライフスタイル 2 5                         | 30,315,983円     | 34,708,067円     |
| ダイワライフスタイル 5 0                         | 48,927,240円     | 55,186,341円     |
| ダイワライフスタイル 7 5                         | 12,886,265円     | 14,379,536円     |
| 計                                      | 57,214,334,756円 | 58,881,648,354円 |
| 2. 期末日における受益権の総数                       | 57,214,334,756口 | 58,881,648,354口 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分               | 自 平成27年12月19日<br>至 平成28年12月19日   |
|-------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>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。<br>信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。   |

|                                |  |
|--------------------------------|--|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項<br>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。<br><br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |
|--------------------------------|--|

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 平成27年12月18日現在          | 平成28年12月19日現在          |
|------|------------------------|------------------------|
|      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 972,980,918            | 1,427,392,937          |
| 合計   | 972,980,918            | 1,427,392,937          |

## (注)

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

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

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

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

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

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

|            |  |               |  |  |
|------------|--|---------------|--|--|
|            | 3.75% United Kingdom Gilt<br>20200907        | 1,795,000.000 | 2,014,528.500                                  |  |
|            | 4.25% United Kingdom Gilt<br>20401207        | 1,577,000.000 | 2,223,412.300                                  |  |
|            | 3.75% United Kingdom Gilt<br>20210907        | 1,633,000.000 | 1,869,785.000                                  |  |
|            | 3.75% United Kingdom Gilt<br>20520722        | 1,182,000.000 | 1,716,973.200                                  |  |
|            | 1.75% United Kingdom Gilt<br>20220907        | 2,242,000.000 | 2,354,772.600                                  |  |
|            | 3.25% United Kingdom Gilt<br>20440122        | 2,156,000.000 | 2,665,894.000                                  |  |
|            | 1.25% United Kingdom Gilt<br>20180722        | 2,854,000.000 | 2,905,086.600                                  |  |
|            | 2.25% United Kingdom Gilt<br>20230907        | 1,942,000.000 | 2,098,913.600                                  |  |
|            | 3.5% United Kingdom Gilt<br>20680722         | 1,621,000.000 | 2,473,808.100                                  |  |
|            | 1.75% United Kingdom Gilt<br>20190722        | 2,161,000.000 | 2,245,927.300                                  |  |
|            | 2.75% United Kingdom Gilt<br>20240907        | 1,842,000.000 | 2,057,329.800                                  |  |
|            | 3.5% United Kingdom Gilt<br>20450122         | 2,124,000.000 | 2,750,367.600                                  |  |
|            | イギリス・ポンド 小計                                  |               | イギリス・ポンド<br>77,990,894.100<br>(11,457,642,252) |  |
| オーストラリア・ドル |  | オーストラリア・ドル    | オーストラリア・ドル                                     |  |
|            | 5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20190315 | 2,455,000.000 | 2,635,344.300                                  |  |
|            | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20210515 | 2,420,000.000 | 2,785,057.000                                  |  |
|            | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20200415  | 2,209,000.000 | 2,386,007.170                                  |  |
|            | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20220715 | 2,032,000.000 | 2,394,366.560                                  |  |
|            | 5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20180121  | 2,063,000.000 | 2,147,211.660                                  |  |
|            | 5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20230421  | 2,068,000.000 | 2,434,966.600                                  |  |

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

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

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

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



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

|           |  |               |   |  |
|-----------|--|---------------|---|--|
|           | 3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525 | 6,698,000.000 | 7,464,452.140                                 |  |
|           | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524    | 4,824,000.000 | 5,005,141.200                                 |  |
|           | 3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314    | 4,095,000.000 | 4,513,181.400                                 |  |
|           | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313 | 3,395,000.000 | 3,436,079.500                                 |  |
|           | 1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219  | 3,140,000.000 | 3,095,569.000                                 |  |
|           | ノルウェー・クローネ 小計                            |               | ノルウェー・クローネ<br>30,136,112.490<br>(409,248,407) |  |
| ポーランド・ズロチ |  | ポーランド・ズロチ     | ポーランド・ズロチ                                     |  |
|           | 5.75% Poland Government Bond 20220923    | 2,309,000.000 | 2,646,114.000                                 |  |
|           | 5.5% Poland Government Bond 20191025     | 1,912,000.000 | 2,079,300.000                                 |  |
|           | 1.5% Poland Government Bond 20200425     | 2,078,000.000 | 2,019,192.600                                 |  |
|           | 2.5% Poland Government Bond 20260725     | 3,377,000.000 | 3,115,789.050                                 |  |
|           | 2% Poland Government Bond 20210425       | 2,127,000.000 | 2,071,272.600                                 |  |
|           | Poland Government Bond 20181025          | 1,668,000.000 | 1,609,536.600                                 |  |
|           | 1.75% Poland Government Bond 20210725    | 3,051,000.000 | 2,926,824.300                                 |  |
|           | 2.5% Poland Government Bond 20270725     | 900,000.000   | 822,690.000                                   |  |
|           | 2.25% Poland Government Bond 20220425    | 700,000.000   | 676,900.000                                   |  |
|           | 5.75% Poland Government Bond 20290425    | 627,000.000   | 758,168.400                                   |  |
|           | 5.25% Poland Government Bond 20201025    | 2,256,000.000 | 2,478,892.800                                 |  |
|           | 5.75% Poland Government Bond 20211025    | 884,000.000   | 1,002,102.400                                 |  |
|           | 4% Poland Government Bond 20231025       | 2,575,000.000 | 2,713,148.750                                 |  |

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

| 通貨          | 銘柄数        | 組入債券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|-------------|------------|--------------|----------------|
| アメリカ・ドル     | 国債証券 239銘柄 | 100%         | 44.5%          |
| イギリス・ポンド    | 国債証券 40銘柄  | 100%         | 7.3%           |
| オーストラリア・ドル  | 国債証券 21銘柄  | 100%         | 2.0%           |
| カナダ・ドル      | 国債証券 32銘柄  | 100%         | 2.1%           |
| シンガポール・ドル   | 国債証券 19銘柄  | 100%         | 0.4%           |
| スイス・フラン     | 国債証券 6銘柄   | 100%         | 0.2%           |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 7銘柄   | 100%         | 0.4%           |
| デンマーク・クローネ  | 国債証券 7銘柄   | 100%         | 0.6%           |
| ノルウェー・クローネ  | 国債証券 6銘柄   | 100%         | 0.3%           |

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成28年12月30日

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

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

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

## (参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

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

## (参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

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

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

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

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

## (参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド( B P I )

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

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

1 単位当たり純資産額 ( / )

1.2677円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年12月30日

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



## 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部 【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12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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

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

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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



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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

|      |        |
|------|--------|
| 建物   | 10～18年 |
| 器具備品 | 4～20年  |

## (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

### (損益計算書)

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

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

## (貸借対照表関係)

### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社項目

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

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

## 3 保証債務

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

## (損益計算書関係)

## 1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

|       | 当事業年度期首<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>総額（百万円） | 1株当たり<br>配当額（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|----|-------|--------------------|-----------------|-----|-------|
|    |       |                    |                 |     |       |

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

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

|       | 当事業年度期首<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>総額（百万円） | 1株当たり<br>配当額（円） | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|--------------------|-----------------|----------------|----------------|
| 平成27年6月23日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 13,428             | 5,148           | 平成27年<br>3月31日 | 平成27年<br>6月24日 |

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

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

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

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

## ( ) 価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

|                             | 貸借対照表<br>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<br>その他有価証券 | 10,520       | 10,520 | -  |
| 資産計                         | 52,254       | 52,254 | -  |
| (1) 未払手数料                   | 4,965        | 4,965  | -  |
| (2) その他未払金                  | 4,127        | 4,127  | -  |
| (3) 未払費用(*)                 | 3,366        | 3,366  | -  |
| 負債計                         | 12,460       | 12,460 | -  |

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

|                                   | 1年以内   | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>その他有価証券のうち満期があるもの | 6      | 1,591       | 3,790        | 84   |
| 合計                                | 41,740 | 1,591       | 3,790        | 84   |

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

## 1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

|                      | 貸借対照表計上額<br>（百万円） | 取得原価<br>（百万円） | 差額<br>（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<br>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<br>証券投資信託 | 5,779  | 5,793 | 14    |
| 小計            | 5,779  | 5,793 | 14    |
| 合計            | 10,520 | 9,482 | 1,038 |

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

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

### 3．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

### 4．減損処理を行った有価証券

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

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

## (退職給付関係)

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

### 2. 確定給付制度

#### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

#### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

### 3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

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

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

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

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

（セグメント情報等）

#### [セグメント情報]

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

#### [関連情報]

##### 1. サービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

###### （1）営業収益

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

###### （2）有形固定資産

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

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

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

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

#### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

## （ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

| 種類  | 会社等の名称                                  | 所在地       | 資本金又は出資金<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容       | 取引金額<br>(百万円) | 科目 | 期末残高<br>(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<br>(注) | 1,834         | -  | -             |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

| 種類  | 会社等の名称                                  | 所在地       | 資本金又は出資金<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容       | 取引金額<br>(百万円) | 科目 | 期末残高<br>(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<br>(注) | 1,749         | -  | -             |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## （イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

### (1株当たり情報)

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

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

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

（単位：百万円）

当中間会計期間  
（平成28年9月30日）

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

## (2) 中間損益計算書

（単位：百万円）

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



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

### (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

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

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

## 注記事項

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

|      |        |
|------|--------|
| 建物   | 10～18年 |
| 器具備品 | 4～20年  |

## （２）無形固定資産

定額法によっております。

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

## ３．引当金の計上基準

### （１）賞与引当金

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

### （２）退職給付引当金

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

### （３）役員退職慰労引当金

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

## ４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### （１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

### （２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## （中間貸借対照表関係）

### １ 減価償却累計額

|        | 当中間会計期間<br>(平成28年9月30日現在) |
|--------|---------------------------|
| 有形固定資産 | 273百万円                    |

### ２ 保証債務

当中間会計期間（平成28年9月30日現在）

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

## 3 消費税等の取扱い

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

## (中間損益計算書関係)

## 1 減価償却実施額

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

## 2 営業外収益の主要項目

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

## 3 営業外費用の主要項目

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

## 4 特別損失の主要項目

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

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

|       | 当事業年度期首<br>株式数 | 当中間会計期間<br>増加株式数 | 当中間会計期間<br>減少株式数 | 当中間会計期間末<br>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<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|-----------------|---------------------|----------------|----------------|
| 平成28年6月23日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 13,261          | 5,084               | 平成28年<br>3月31日 | 平成28年<br>6月24日 |

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払金及び(2) 未払費用

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

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

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

（セグメント情報等）

[ セグメント情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

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

[ 関連情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

（1 株当たり情報）

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

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

(注2) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。



#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

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

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

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

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成28年3月末日現在）

事業の内容

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

#### (2) 販売会社

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

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（注2）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

### 2 【関係業務の概要】

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

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

### 3 【資本関係】

該当事項はありません。

#### <再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成28年3月末日現在）

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

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

## 第3 【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28年3月11日 | 有価証券届出書、有価証券報告書（第8期）      |
| 平成28年5月13日 | 有価証券届出書の訂正届出書             |
| 平成28年9月9日  | 半期報告書（第9期中）、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28年 5月27日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

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

## 利害関係

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

以上

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

(注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成27年12月19日から平成28年12月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成28年11月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

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

## 利害関係

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

以 上

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



(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。