

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成30年11月30日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 岩本 信之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	高橋 慎 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	i F r e e 8 資産バランス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

i F r e e 8資産バランス

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

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

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・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）

(7) 【申込期間】

2018年12月1日から2019年5月31日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

受益権の取得申込者は、申込取扱場所において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得および換金の申込みの受け付けは行ないません。

申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

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

（ ）前 の申込受付中止日を除きます。

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受け付けた取得申込みを取消することができるものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

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

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、値動きの異なる8つの資産クラスに分散投資を行ない、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 資産配分固定型（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 資産配分固定型」…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固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、3,000億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 >

iFree 8資産バランス

SIMPLE
& EASY

インデックスってなに？

FREE
& LOW

費用はどれくらいかかるのかな？



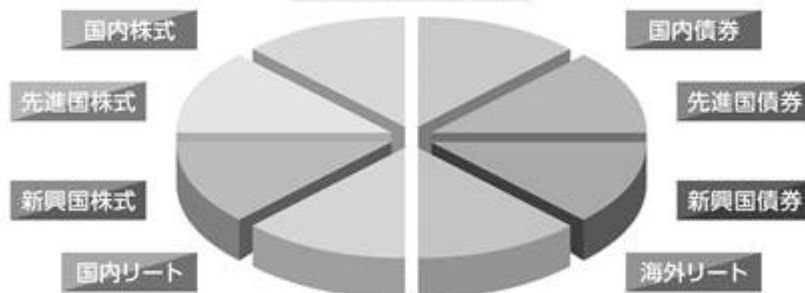
これらの質問については、以降でご説明します。

ファンドの目的・特色

値動きの異なる8つの資産クラスに均等分散投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

■ 8つの資産クラスについて

資産配分のイメージ



- ・内外の株式、債券およびリート(不動産投資信託)に投資します。
- ・各資産クラスにおける投資にあたっては、投資成果をそれぞれの対象インデックスに連動させることをめざして運用を行ないます。

※先進国株式・債券の資産クラスには、日本の株式・債券を含みません。

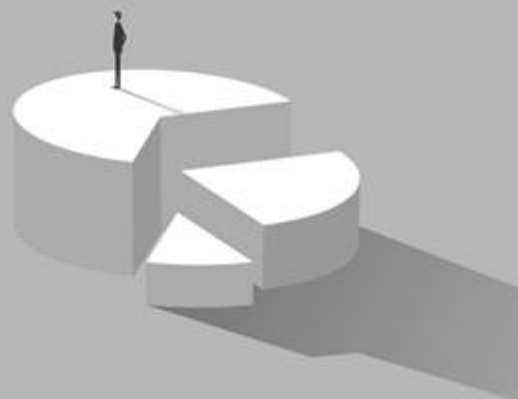
※対象インデックスについては、後掲の「対象インデックスについて」をご参照下さい。



当ファンドは、「つみたてNISA」対象ファンドです。



インデックス ってなに？




「インデックス」とは

いふなれば「市場のモノサシ」です。

マーケット(市場)を構成する個々の価格データからマーケット全体の動向がわかるように情報会社等が計算したもので、「〇〇指数」「〇〇インデックス」などと呼ばれます。

インデックスの動きを確認することにより、マーケットのおおよその動きを読み取ることができます。

インデックス	マーケット	
		一般に インデックスの上昇時はマーケットは好調 インデックスの下落時はマーケットは低調 と考えられます。



当ファンドの各資産クラスにおける対象インデックスは以下のとおりです。

■対象インデックスについて

資産クラス	対象インデックス
国内株式	東証株価指数(TOPIX)
先進国株式	MSCIコクサイ指数(円ベース)
新興国株式	FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)
国内債券	NOMURA-BPI総合指数

資産クラス	対象インデックス
先進国債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債券	JPモルガン ガバメント・ボンド・イン デックス-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 (円換算)
国内リート	東証REIT指数(配当込み)
海外リート	S&P先進国REIT指数(除く日本) (円ベース)

※対象インデックスの内容については、後掲の「インデックスの概要について」をご参照下さい。



ファンドへの投資にかかる主な費用は



当ファンドは、費用を低く抑えたファンドです。

※上記は主な費用であり、他にも費用・税金がかかります。

— Aさんの場合 —

運用管理費用っていくらくらい？

Aさんは当ファンドを10万円分保有しています。
当ファンドの運用管理費用の料率は年率0.2376%（税込）です。
1年間ファンドの値段（基準価額）が変わらなかったと仮定した場合の1年間にかかる費用はおおよそ…

Aさんの保有残高	×	運用管理費用の料率	÷	1年間にかかる運用管理費用
10万円		0.2376%		238円(税込)

※上記の運用管理費用は簡便に計算した概算値です。

■ インデックスの概要について

● 東証株価指数(TOPIX)

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

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

● MSCIコクサイ指数

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

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

● FTSE RAFI エマージング インデックス

FTSE RAFI エマージング インデックスとは、FTSE社(FTSE International Limited)の流動性基準、時価総額基準、浮動株調整をクリアした新興国の上場株の中から、4つのファンダメンタル指標(株主資本、キャッシュフロー、売上、配当)に着目し、リサーチ・アフィリエイツ社(Research Affiliates LLC)独自のインデックス構成手法により、銘柄の選定およびウェイト付けを行なう指数です。なお、FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)は、FTSE RAFI エマージング インデックス(米ドルベース)をもとに、FTSE International Limitedの承諾を得て委託会社が計算したものです。

[iFree 8資産バランス]は、いかなる形式においてもFTSE International Limited(以下[FTSE])、ロンドン証券取引所グループ会社(以下[LSEG])、またはResearch Affiliates LLC(以下[RA]) (以下、総称して「ライセンサ各社」)によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンサ各社はいずれも、明示的にも黙示的にも当該インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行うことはございません。当該指数はまたRAと共同しFTSEによってルールに基づき計算されます。いずれのライセンサ各社も、指数における瑕疵については(過失の有無に関わらず)何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。

FTSE®はLSEGの商標です。Fundamental Index®およびRAFI®はResearch Affiliates, LLCの登録商標です。

The iFree Balanced Fund 8 is not in any way sponsored, endorsed, sold or promoted by FTSE International Limited ("FTSE"), by the London Stock Exchange Group companies ("LSEG"), or by Research Affiliates LLC ("RA") (collectively the "Licensor Parties"), and none of the Licensor Parties make any warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the results to be obtained from the use of the FTSE RAFI Emerging Index (the "Index") and/or the figure at which the said Index stands at any particular time on any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated by FTSE in conjunction with RA. None of the Licensor Parties shall be liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index and none of the Licensor Parties shall be under any obligation to advise any person of any error therein.

FTSE® is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index® and RAFI® are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.

● NOMURA-BPI総合指数

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

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

● FTSE世界国債インデックス

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

● JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-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(円換算)

JPモルガン社が算出し公表している債券指数で、新興国の政府が現地通貨建てで発行する債券で構成されています。米ドルベースの指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。外国人投資家に対して著しい不利益を与えうる制度等がある国は除外されています。国別構成比率に、1か国当たりの上限を設けており、分散が図られています。

JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-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.

● 東証REIT指数(配当込み)

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

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「㈩東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は㈩東京証券取引所が有します。

㈩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、㈩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。

当ファンドは、㈩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。

● S&P先進国REIT指数

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。

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を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。

ファンドの仕組みなど



- 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。
- 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- 安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。
 - 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
 - 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的
 - 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的
- 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場合、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」の運用が行なわれないことがあります。

分配方針

毎年9月7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。

【分配方針】

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

(2) 【ファンドの沿革】

2016年9月8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せん。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないません。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3 ）
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないません。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
		損益 投資
投資対象	<p>内外の株式・債券およびリート（不動産投資信託） など （ファミリーファンド方式で運用を行ないません。）</p>	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（2018年9月末日現在） >

- ・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	設立登記
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

各マザーファンドは、それぞれかっこ内に掲げる指数に採用されている資産に投資を行ない、投資成果を当該指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券（東証株価指数）
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券（MSCIコクサイ指数（円ベース））
3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券（FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算））
4. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券（NOMURA - BPI 総合指数）
5. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））
6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券（JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス - 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（円換算））
7. ダイワJ - REITマザーファンドの受益証券（東証REIT指数（配当込み））
8. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））

投資態度

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、次の資産クラスに投資を行ない、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。

- 1．国内株式
- 2．先進国株式
- 3．新興国株式
- 4．国内債券
- 5．先進国債券
- 6．新興国債券
- 7．国内リート
- 8．海外リート

ロ．各資産クラスの配分比率については、均等とすることを目標とします。

ハ．各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ニ．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。

ホ．安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

(b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的

(c) 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的

ヘ．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次の1．から8．までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の9．から12．までに掲げる有価証券（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. 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. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
4. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券
5. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券
7. ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
8. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
9. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
10. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前9.の証券の性質を有するもの
11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
12. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

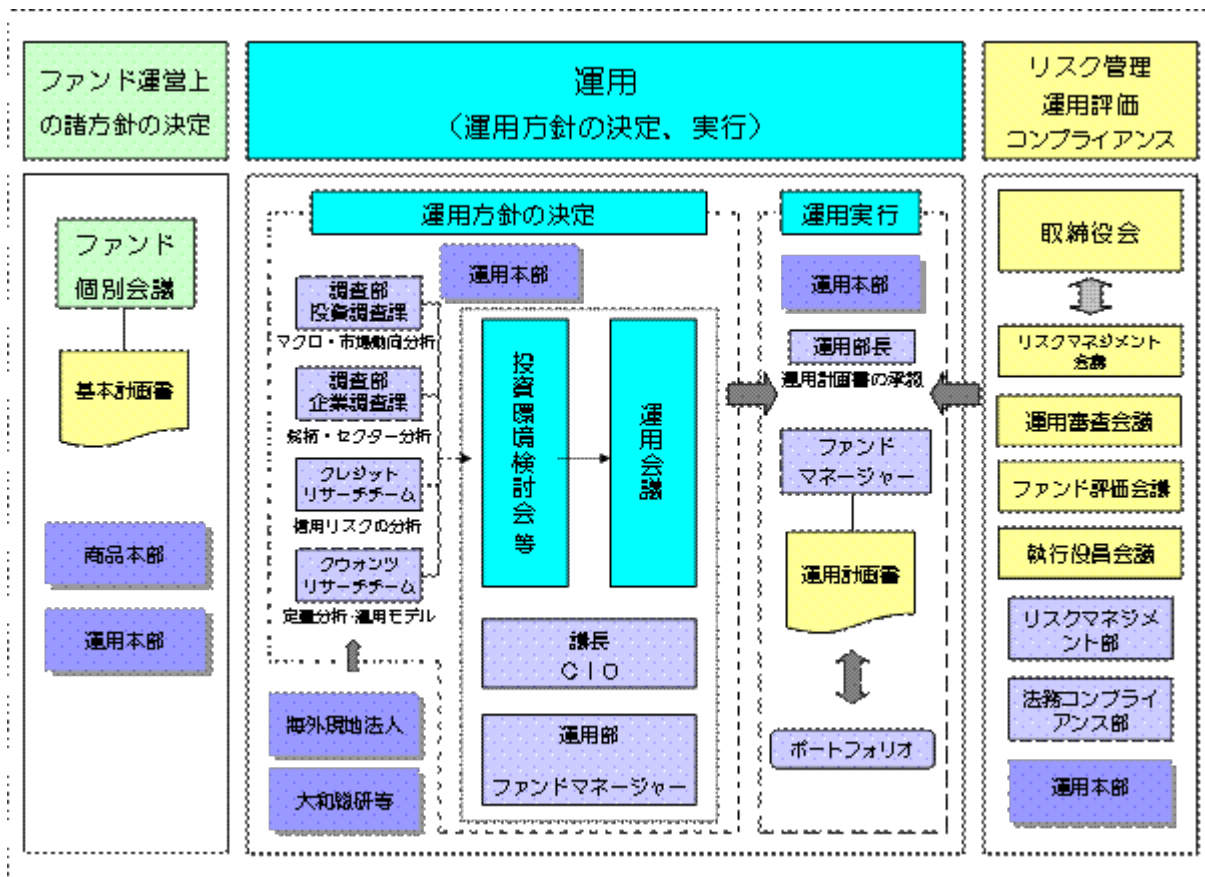
委託会社は、信託金を、前に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

八．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。

二．執行役員会議

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

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2018年9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売買益（評価益を含みます。）等とします。

原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、配当等収益が少額の場合には、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取引の指図をすることができます。

信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場

合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

資金の借入れ（信託約款）

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

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

株式への投資には、制限を設けません。

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、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、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。

ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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わが国の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、ならびに価格変動リスクを回避するため、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合計額が、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合計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、

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

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資信託証券

投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

イ. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みません。)

ロ. 新興国の企業のDR(預託証券)

ハ. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF(上場投資信託証券)

投資態度

イ 主として、新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）（ ）に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）に投資する場合があります。

ロ 株式およびETF（上場投資信託証券）の組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

ハ 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数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。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約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。

ニ 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。

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. 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、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することができます。

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. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
17. 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。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 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。）
20. 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。）
21. 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
22. 外国の者に対する権利で前21.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前12.および前17.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.までの証券ならびに前14.の証券のうち投資法人債券ならびに前12.および前17.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（投資法人債券を除きます。）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

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資信託証券

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

- イ．委託会社は、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。）ならびに外国の金融商品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、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
ハ．委託会社は、わが国の金融商品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金融商品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、異なった通貨、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、市場実勢金利等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。

金利先渡取引および為替先渡取引

- 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、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
ロ．金利先渡取引および為替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（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.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）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．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産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、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価

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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

へ．委託会社は、金利先渡取引および為替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。

4. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券

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

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。

5. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

(2) 投資対象

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式

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。

投資信託証券

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

6. ダイワ新興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

新興国通貨建ての債券を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス - 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（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

ロ．運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約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、信託財産の純

資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

八．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。

二．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．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、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．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

13．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。）

14．外国法人が発行する譲渡性預金証書

15．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。）

16．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。）

17. 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

18. 外国の者に対する権利で前17.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.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.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.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9.の証券および前10.の証券(投資法人債券を除きます。)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

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

投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

イ. 委託会社は、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。)ならびに外国の金融商品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、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

ハ. 委託会社は、わが国の金融商品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金融商品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、異なった通貨、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、市場実勢金利等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、

金利先渡取引および為替先渡取引

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、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引および為替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(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.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。)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．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産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、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとし、

ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとし、

ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替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、

7. 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号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。

投資態度

- イ．東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」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。）

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式

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。

8. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

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

投資態度

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロ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。

3 【投資リスク】

(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。

新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向が考えられます。

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉

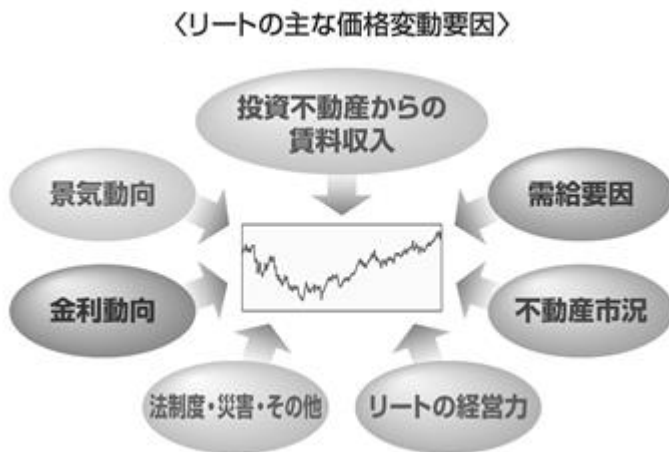


※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがより高いものになると考えられます。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．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

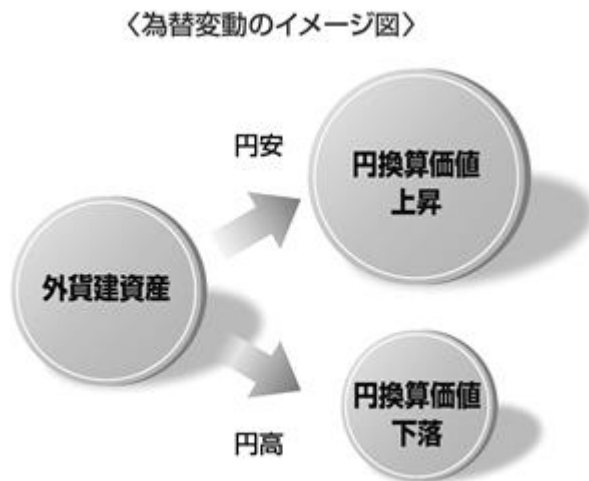
ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク



※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。

特に、新興国の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。

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

ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。新興国への投資には、先進国と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

新興国においては、先進国と比較して、証券の決済、保管等にかかる制度やインフラストラクチャーが未発達であったり、証券の売買を行なう当該国の仲介業者等の固有の事由等により、決済の遅延、不能等が発生する可能性も想定されます。そのような場合、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

実質的な投資対象である証券が上場または取引されている新興国の税制は先進国と異なる面がある場合があります。また、税制が変更されたり、あるいは新たな税制が適用されることにより、基準価額が影響を受ける可能性があります。

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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

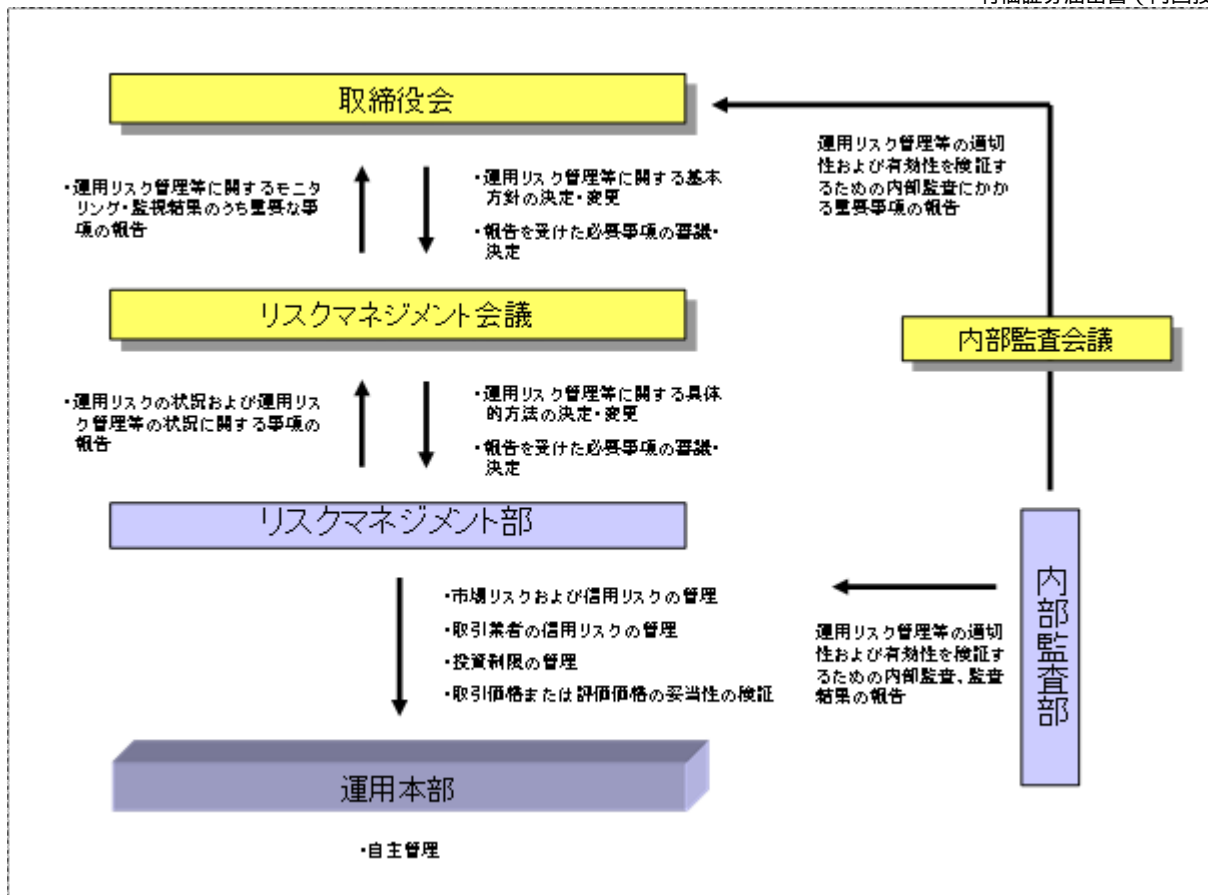
ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(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。

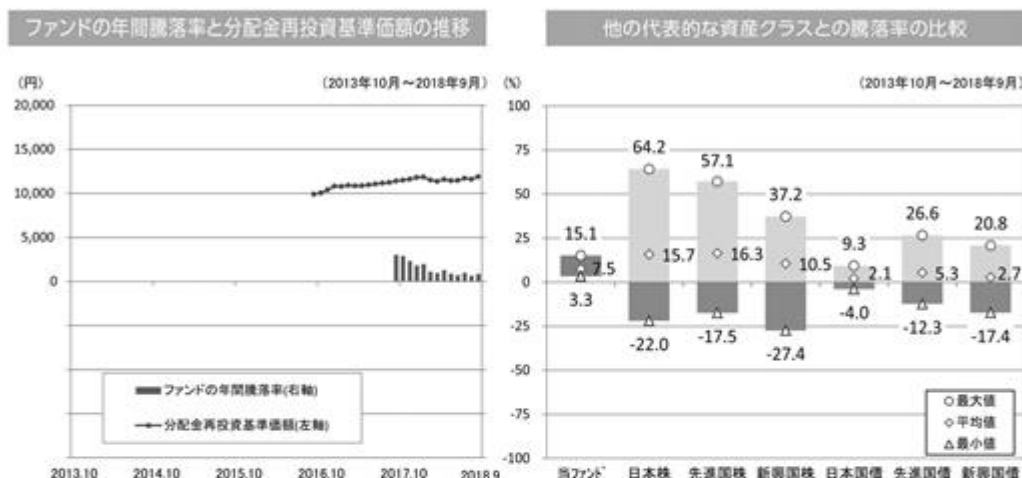


流動性リスクに対する管理体制

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。



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

「分配金再投資コース」の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年率0.2376%（税抜0.22%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬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、受託会社への配分については、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.10%（税抜）	年率0.10%（税抜）	年率0.02%（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、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、先物取引・オプション取引等に要する費用、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。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたNISAをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度

「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

「つみたてNISA」をご利用の場合

販売会社によっては「つみたてNISA」の適用対象となります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

毎年、年間40万円の範囲で販売会社との契約に基づいて定期かつ継続的な方法で購入することにより生じる配当所得および譲渡所得が20年間非課税となります。

なお、「NISA」と「つみたてNISA」の投資枠は、年ごとに選択制であり、同一年においてその両方を併用した投資は行なえません。

法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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、前にかかわらず所得税がかかりません。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。

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- () 上記は、2018年9月末現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2018年9月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	9,896,074,528	98.99
内 日本	9,896,074,528	98.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	100,848,125	1.01
純資産総額	9,996,922,653	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（2018年9月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,104,020,360	1.0602 1,170,517,235	1.1523 1,272,162,660	12.73
2	ダイワ新興国株式ファンダメンタ ル・インデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	790,840,092	1.5002 1,186,488,979	1.6065 1,270,484,607	12.71
3	ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	951,065,766	1.2344 1,174,005,456	1.3138 1,249,510,203	12.50
4	外国株式インデックスマザーファ ンド	日本	親投資 信託受 益証券	469,731,540	2.5075 1,177,869,346	2.6251 1,233,092,265	12.33
5	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	472,186,177	2.5557 1,206,784,386	2.6077 1,231,319,893	12.32
6	外国債券インデックスマザーファ ンド	日本	親投資 信託受 益証券	438,864,400	2.7233 1,195,197,031	2.7855 1,222,456,786	12.23

7	ダイワ日本債券インデックスマ ザーファンド(BPI)	日本	親投資 信託受 益証券	959,938,270	1.2680 1,217,250,647	1.2647 1,214,033,930	12.14
8	ダイワ・グローバルREITイン デックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	525,976,821	2.2967 1,208,019,177	2.2872 1,203,014,184	12.03

(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	98.99%
合計	98.99%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年9月7日)	4,423,564,263	4,423,564,263	1.1184	1.1184
2017年9月末日	4,753,192,406	-	1.1393	-
10月末日	5,193,485,236	-	1.1495	-
11月末日	5,594,767,626	-	1.1595	-
12月末日	5,918,842,545	-	1.1795	-
2018年1月末日	6,411,024,271	-	1.1850	-
2月末日	6,615,319,079	-	1.1499	-
3月末日	6,949,835,073	-	1.1370	-
4月末日	7,442,353,398	-	1.1574	-

5月末日	7,716,184,754	-	1.1439	-
6月末日	8,166,044,778	-	1.1454	-
7月末日	8,789,656,544	-	1.1701	-
8月末日	9,234,897,321	-	1.1603	-
第2計算期間末 (2018年9月7日)	9,247,296,645	9,247,296,645	1.1443	1.1443
9月末日	9,996,922,653	-	1.1877	-

【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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.8
第2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	5,119,041,794	1,173,761,616
第2計算期間	5,936,562,291	1,810,640,911

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2018年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	150,594,260,490	98.74
内 日本	150,594,260,490	98.74
新株予約権証券	1,352,000	0.00
内 日本	1,352,000	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,918,127,967	1.26
純資産総額	152,513,740,457	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,999,250,000	1.31
内 日本	1,999,250,000	1.31

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

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

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

(2) 投資資産 (2018年9月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	705,800	7,019.00 4,954,010,200	7,095.00 5,007,651,000	3.28
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	258,300	10,915.00 2,819,344,500	11,470.00 2,962,701,000	1.94
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	3,988,000	702.70 2,802,367,600	709.10 2,827,890,800	1.85
4	ソニー	日本	株式	電気機 器	389,300	6,682.00 2,601,302,600	6,966.00 2,711,863,800	1.78
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	408,400	5,154.00 2,104,893,600	5,132.00 2,095,908,800	1.37
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	428,600	4,538.00 1,944,986,800	4,586.00 1,965,559,600	1.29
7	キーエンス	日本	株式	電気機 器	28,500	63,370.00 1,806,045,000	65,980.00 1,880,430,000	1.23
8	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	521,400	3,383.00 1,763,896,200	3,439.00 1,793,094,600	1.18
9	リクルートホールディングス	日本	株式	サービ ス業	430,000	3,665.00 1,575,950,000	3,792.00 1,630,560,000	1.07
10	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	502,100	3,090.00 1,551,489,000	3,139.00 1,576,091,900	1.03

11	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,787,100	198.30 1,544,181,930	198.20 1,543,403,220	1.01
12	任天堂	日本	株式	その他製 品	35,800	40,000.00 1,432,000,000	41,460.00 1,484,268,000	0.97
13	三菱商事	日本	株式	卸売業	401,800	3,473.00 1,395,451,400	3,501.00 1,406,701,800	0.92
14	花王	日本	株式	化学	142,900	9,055.00 1,293,959,500	9,174.00 1,310,964,600	0.86
15	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	409,100	3,049.00 1,247,345,900	3,055.00 1,249,800,500	0.82
16	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	52,200	23,270.00 1,214,694,000	23,660.00 1,235,052,000	0.81
17	東京海上HD	日本	株式	保険業	215,500	5,447.00 1,173,828,500	5,637.00 1,214,773,500	0.80
18	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	239,800	5,100.00 1,222,980,000	5,060.00 1,213,388,000	0.80
19	ダイキン工業	日本	株式	機械	79,400	15,605.00 1,239,037,000	15,125.00 1,200,925,000	0.79
20	ファナック	日本	株式	電気機 器	55,200	22,170.00 1,223,784,000	21,420.00 1,182,384,000	0.78
21	日本電産	日本	株式	電気機 器	70,000	16,500.00 1,155,000,000	16,345.00 1,144,150,000	0.75
22	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	571,300	2,006.50 1,146,313,450	1,982.00 1,132,316,600	0.74
23	キヤノン	日本	株式	電気機 器	310,100	3,553.00 1,101,785,300	3,610.00 1,119,461,000	0.73
24	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	103,500	10,670.00 1,104,345,000	10,555.00 1,092,442,500	0.72
25	日立	日本	株式	電気機 器	278,000	3,736.00 1,038,608,000	3,860.00 1,073,080,000	0.70
26	村田製作所	日本	株式	電気機 器	60,900	17,940.00 1,092,546,000	17,465.00 1,063,618,500	0.70
27	武田薬品	日本	株式	医薬品	213,800	4,686.00 1,001,866,800	4,861.00 1,039,281,800	0.68
28	資生堂	日本	株式	化学	115,900	7,928.00 918,855,200	8,799.00 1,019,804,100	0.67
29	信越化学	日本	株式	化学	100,200	9,833.00 985,266,600	10,065.00 1,008,513,000	0.66
30	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	336,000	2,990.00 1,004,640,000	2,966.00 996,576,000	0.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.74%
新株予約権証券	0.00%
合計	98.74%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.12%
鉱業	0.33%
建設業	2.80%
食料品	3.96%
繊維製品	0.63%
パルプ・紙	0.29%
化学	7.45%
医薬品	5.07%
石油・石炭製品	0.89%
ゴム製品	0.72%
ガラス・土石製品	0.96%
鉄鋼	1.06%
非鉄金属	0.80%
金属製品	0.59%
機械	5.17%
電気機器	13.12%
輸送用機器	8.36%
精密機器	1.75%
その他製品	2.11%
電気・ガス業	1.72%
陸運業	4.22%
海運業	0.19%
空運業	0.55%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	7.94%
卸売業	4.79%
小売業	4.85%

銀行業	6.67%
証券、商品先物取引業	0.92%
保険業	2.38%
その他金融業	1.17%
不動産業	2.28%
サービス業	4.69%
合計	98.74%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2018年12月	買建	110	1,981,805,220	1,999,250,000	1.31%

(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 - R E I Tマザーファンド

(1) 投資状況 (2018年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	216,335,885,410	98.37
内 日本	216,335,885,410	98.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,586,245,004	1.63
純資産総額	219,922,130,414	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	3,180,600,000	1.45
内 日本	3,180,600,000	1.45

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

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

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

(2) 投資資産（2018年9月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	24,308	645,087.58 15,680,789,088	657,000.00 15,970,356,000	7.26
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	25,102	586,046.55 14,710,940,537	596,000.00 14,960,792,000	6.80
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	74,402	153,012.19 11,384,413,689	155,200.00 11,547,190,400	5.25
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	55,363	176,105.06 9,749,704,852	178,300.00 9,871,222,900	4.49
5	日本リテールファンド	日本	投資証券	47,443	206,294.76 9,787,242,566	206,100.00 9,778,002,300	4.45
6	オリックス不動産投資	日本	投資証券	50,016	174,625.47 8,734,067,892	177,400.00 8,872,838,400	4.03
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	31,428	254,066.76 7,984,810,375	259,900.00 8,168,137,200	3.71
8	日本プロロジスリート	日本	投資証券	33,671	217,092.65 7,309,726,694	224,900.00 7,572,607,900	3.44
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	24,464	285,445.13 6,983,129,793	290,200.00 7,099,452,800	3.23
10	GLP投資法人	日本	投資証券	62,200	109,917.69 6,836,880,364	110,500.00 6,873,100,000	3.13
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	15,890	404,990.54 6,435,299,812	405,000.00 6,435,450,000	2.93
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	72,683	83,781.33 6,089,479,122	82,700.00 6,010,884,100	2.73
13	API投資法人	日本	投資証券	12,029	494,518.16 5,948,559,000	492,000.00 5,918,268,000	2.69

14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	7,765	708,074.06 5,498,195,078	725,000.00 5,629,625,000	2.56
15	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	64,767	71,600.53 4,637,351,736	71,900.00 4,656,747,300	2.12
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	8,341	501,113.96 4,179,791,553	506,000.00 4,220,546,000	1.92
17	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	87,844	46,510.90 4,085,703,842	47,500.00 4,172,590,000	1.90
18	森ヒルズリート	日本	投資証券	28,789	144,290.13 4,153,968,720	144,400.00 4,157,131,600	1.89
19	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	5,794	683,007.90 3,957,347,828	685,000.00 3,968,890,000	1.80
20	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	8,539	438,067.00 3,740,654,113	442,500.00 3,778,507,500	1.72
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	16,563	221,921.65 3,675,688,347	223,500.00 3,701,830,500	1.68
22	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	22,478	146,527.54 3,293,646,263	150,600.00 3,385,186,800	1.54
23	産業ファンド	日本	投資証券	29,246	116,488.83 3,406,832,512	114,600.00 3,351,591,600	1.52
24	イオンリート投資	日本	投資証券	25,767	121,108.43 3,120,601,105	122,100.00 3,146,150,700	1.43
25	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	18,104	159,963.40 2,895,977,573	165,200.00 2,990,780,800	1.36
26	日本リート投資法人	日本	投資証券	8,103	367,493.37 2,977,798,814	367,500.00 2,977,852,500	1.35
27	森トラスト総合リート	日本	投資証券	17,940	161,721.61 2,901,285,691	162,000.00 2,906,280,000	1.32
28	プレミア投資法人	日本	投資証券	23,866	115,829.45 2,764,385,779	119,400.00 2,849,600,400	1.30
29	東急リアル・エステート	日本	投資証券	16,830	156,695.84 2,637,191,044	156,900.00 2,640,627,000	1.20
30	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	14,892	174,474.89 2,598,280,085	173,900.00 2,589,718,800	1.18

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 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	98.37%

合計	98.37%
----	--------

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2018年12月	買建	1,800	3,139,200,000	3,180,600,000	1.45%

(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。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

(1) 投資状況 (2018年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	13,496,026,180	80.13
内 日本	13,496,026,180	80.13
地方債証券	1,136,709,000	6.75
内 日本	1,136,709,000	6.75
特殊債券	917,121,700	5.45
内 日本	917,121,700	5.45
社債券	1,139,964,000	6.77
内 日本	1,139,964,000	6.77
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	153,246,283	0.91
純資産総額	16,843,067,163	100.00

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

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

(2) 投資資産（2018年9月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	125 5年国債	日本	国債証券	370,000,000	100.54 372,015,300	100.42 371,568,800	0.100000 2020/09/20	2.21
2	130 5年国債	日本	国債証券	197,000,000	100.84 198,665,380	100.62 198,239,130	0.100000 2021/12/20	1.18
3	334 10年国債	日本	国債証券	181,000,000	104.39 188,962,970	103.60 187,530,480	0.600000 2024/06/20	1.11
4	350 10年国債	日本	国債証券	185,000,000	100.64 186,200,650	99.90 184,826,100	0.100000 2028/03/20	1.10
5	135 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.06 171,813,200	100.80 171,370,200	0.100000 2023/03/20	1.02
6	386 2年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.45 170,771,300	100.32 170,544,000	0.100000 2020/03/15	1.01
7	128 5年国債	日本	国債証券	167,000,000	100.79 168,324,660	100.54 167,910,150	0.100000 2021/06/20	1.00
8	329 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	104.53 167,250,900	104.11 166,588,800	0.800000 2023/06/20	0.99
9	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	104.38 167,017,600	103.50 165,606,400	0.800000 2022/09/20	0.98
10	126 5年国債	日本	国債証券	164,000,000	100.71 165,164,720	100.46 164,765,880	0.100000 2020/12/20	0.98
11	347 10年国債	日本	国債証券	155,000,000	100.67 156,041,250	100.17 155,268,150	0.100000 2027/06/20	0.92
12	343 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	100.98 153,494,160	100.46 152,700,720	0.100000 2026/06/20	0.91
13	133 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	101.00 151,505,400	100.73 151,104,000	0.100000 2022/09/20	0.90
14	345 10年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.85 151,287,000	100.32 150,490,500	0.100000 2026/12/20	0.89
15	348 10年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.67 151,007,000	100.08 150,132,000	0.100000 2027/09/20	0.89

16	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	104.95 146,939,800	103.85 145,401,200	1.100000 2021/12/20	0.86
17	322 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	104.42 146,189,400	103.44 144,817,400	0.900000 2022/03/20	0.86
18	335 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	103.92 145,496,400	103.10 144,351,200	0.500000 2024/09/20	0.86
19	129 5年国債	日本	国債証券	132,000,000	100.83 133,105,720	100.58 132,765,600	0.100000 2021/09/20	0.79
20	349 10年国債	日本	国債証券	125,000,000	100.35 125,448,700	100.00 125,000,000	0.100000 2027/12/20	0.74
21	124 5年国債	日本	国債証券	120,000,000	100.50 120,611,500	100.37 120,453,600	0.100000 2020/06/20	0.72
22	11兵庫県公債20年	日本	地方債証券	100,000,000	118.05 118,053,000	116.65 116,651,500	1.840000 2030/08/16	0.69
23	80 三菱地所	日本	社債券	100,000,000	117.68 117,682,000	116.25 116,256,500	2.305000 2027/03/19	0.69
24	331 10年国債	日本	国債証券	110,000,000	103.92 114,312,290	103.28 113,617,900	0.600000 2023/09/20	0.67
25	149 20年国債	日本	国債証券	97,000,000	117.47 113,946,660	116.00 112,528,730	1.500000 2034/06/20	0.67
26	32東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	113.27 113,278,800	111.43 111,438,200	2.260000 2024/03/19	0.66
27	309 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	103.15 106,244,500	102.10 105,163,000	1.100000 2020/06/20	0.62
28	147 20年国債	日本	国債証券	89,000,000	119.14 106,043,290	117.46 104,545,630	1.600000 2033/12/20	0.62
29	497 関西電力	日本	社債券	100,000,000	104.95 104,951,000	104.32 104,325,600	1.002000 2025/06/20	0.62
30	25 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	103.65 103,656,700	103.25 103,258,100	0.694000 2023/11/22	0.61

(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	80.13%
地方債証券	6.75%
特殊債券	5.45%
社債券	6.77%
合計	99.09%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2018年9月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		5,325,304,599	87.77
	内 中国	1,709,680,365	28.18
	内 台湾	876,233,831	14.44
	内 タイ	228,129,398	3.76
	内 シンガポール	3,210,412	0.05
	内 マレーシア	133,314,074	2.20
	内 インドネシア	78,786,962	1.30
	内 インド	404,825,309	6.67
	内 ポーランド	75,030,399	1.24
	内 ロシア	513,081,120	8.46
	内 トルコ	53,611,053	0.88
	内 メキシコ	234,137,611	3.86
	内 チリ	55,690,554	0.92
	内 ブラジル	642,542,529	10.59
	内 南アフリカ	317,030,982	5.23
投資証券		605,862,071	9.99
	内 アメリカ	587,197,785	9.68
	内 メキシコ	6,965,038	0.11
	内 南アフリカ	11,699,248	0.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		135,907,654	2.24

純資産総額	6,067,074,324	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)	59,999,031	0.99
内 アメリカ	59,999,031	0.99
為替予約取引(買建)	11,295,849	0.19
内 日本	11,295,849	0.19
為替予約取引(売建)	25,903	0.00
内 日本	25,903	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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

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

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

(2) 投資資産 (2018年9月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証券	-	244,000	2,350.67 573,571,309	2,406.54 587,197,785	9.68
2	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	2,264,000	102.17 231,350,286	98.65 223,363,297	3.68
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	193,000	821.17 158,488,050	983.15 189,747,950	3.13
4	GAZPROM PAO -SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	266,010	503.56 133,981,159	557.85 148,395,232	2.45
5	CHINA MOBILE LTD	中国	株式	電気通信サービス	129,000	999.03 128,876,517	1,104.28 142,452,120	2.35
6	IND & COMM BK OF CHINA- H	中国	株式	金融	1,696,000	83.60 141,809,195	82.82 140,464,416	2.32
7	LUKOIL PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	14,870	7,833.94 116,492,216	8,501.85 126,422,512	2.08

8	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	1,027,800	100.60 103,417,215	111.73 114,841,952	1.89
9	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	2,187,000	55.43 121,250,046	50.70 110,902,114	1.83
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	376,128	305.19 114,794,352	291.97 109,820,725	1.81
11	VALE SA	ブラジル	株式	素材	61,590	1,382.60 85,155,525	1,682.09 103,600,194	1.71
12	CNOOC LTD	中国	株式	エネルギー	454,000	185.98 84,437,364	217.07 98,553,503	1.62
13	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	61,024	1,205.85 73,587,045	1,258.74 76,813,521	1.27
14	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	33,980	1,630.50 55,404,764	1,980.92 67,311,832	1.11
15	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	337,900	170.40 57,580,926	189.54 64,045,566	1.06
16	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	104,600	531.63 55,610,347	606.88 63,480,568	1.05
17	SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR	ロシア	株式	金融	41,930	1,589.86 66,667,288	1,436.09 60,215,365	0.99
18	SASOL LTD	南アフリカ	株式	素材	13,330	4,050.20 53,989,322	4,441.05 59,199,260	0.98
19	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	メキシコ	株式	電気通信サービス	626,200	97.44 61,024,345	92.41 57,868,394	0.95
20	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	81,600	594.44 48,507,570	692.86 56,537,376	0.93
21	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	596,000	83.76 49,932,529	90.52 53,951,052	0.89
22	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	63,934	810.08 51,791,938	826.34 52,831,324	0.87
23	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	40,500	1,015.37 41,122,754	1,145.69 46,400,465	0.76
24	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	34,420	1,070.41 36,843,654	1,145.18 39,417,233	0.65
25	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	696,000	52.36 36,450,969	55.64 38,732,330	0.64
26	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	45,100	876.34 39,524,017	856.60 38,632,714	0.64

27	LENOVO GROUP LTD	中国	株式	情報技術	428,000	60.34 25,831,280	80.93 34,638,939	0.57
28	CEMEX SAB-CPO	メキシコ	株式	素材	424,519	79.66 33,818,065	80.45 34,153,742	0.56
29	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	ロシア	株式	エネルギー	38,040	702.77 26,733,415	815.43 31,019,056	0.51
30	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	メキシコ	株式	生活必需品	26,900	1,063.58 28,610,706	1,106.34 29,760,729	0.49

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	87.77%
投資証券	9.99%
合計	97.76%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	18.11%
素材	9.27%
資本財・サービス	2.34%
一般消費財・サービス	2.92%
生活必需品	4.49%
ヘルスケア	0.61%
金融	26.84%
情報技術	11.75%
電気通信サービス	6.92%
公益事業	2.74%
不動産	1.79%
合計	87.77%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMGMKT 2018年12月	買建	10	58,209,736	59,999,031	0.99%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年12 月	買建	100,000	11,148,570	11,270,000	0.19%
		米ドル買/円売 2018年10 月	買建	228	25,903	25,849	0.00%
		タイ・パーツ売/円買 2018年10月	売建	7,380	25,903	25,903	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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2018年9月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	107,758,709,397	96.25
内 香港	1,404,676,082	1.25
内 シンガポール	487,080,425	0.44
内 イスラエル	225,652,797	0.20
内 ノルウェー	328,623,779	0.29
内 スウェーデン	1,165,023,838	1.04
内 デンマーク	709,360,660	0.63
内 イギリス	7,371,884,688	6.58
内 アイルランド	219,060,901	0.20
内 オランダ	1,424,083,678	1.27
内 ベルギー	431,024,110	0.38
内 フランス	4,634,266,761	4.14
内 ドイツ	4,040,166,388	3.61
内 スイス	3,491,783,575	3.12
内 ポルトガル	64,841,494	0.06
内 スペイン	1,267,721,268	1.13

	内 イタリア	1,006,032,571	0.90
	内 フィンランド	450,700,107	0.40
	内 オーストリア	99,111,805	0.09
	内 カナダ	4,076,086,131	3.64
	内 アメリカ	72,249,038,955	64.53
	内 オーストラリア	2,523,586,283	2.25
	内 ニュージーランド	88,903,101	0.08
投資証券		2,657,024,901	2.37
	内 香港	86,219,494	0.08
	内 シンガポール	43,795,329	0.04
	内 イギリス	82,988,312	0.07
	内 フランス	150,997,039	0.13
	内 カナダ	18,707,445	0.02
	内 アメリカ	1,965,931,239	1.76
	内 オーストラリア	308,386,043	0.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,540,530,738	1.38
純資産総額		111,956,265,036	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,591,797,120	1.42
内 アメリカ	1,591,797,120	1.42
為替予約取引(買建)	272,400,000	0.24
内 日本	272,400,000	0.24

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

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

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

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

(2) 投資資産 (2018年9月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
-----	----	----	----	--------------------------	-------------------	-------------------	-----------------

1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	124,550	19,317.80 2,406,032,329	25,547.57 3,181,950,030	2.84
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	184,600	9,611.76 1,774,333,604	12,993.54 2,398,608,167	2.14
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	10,390	136,726.24 1,420,586,824	228,614.13 2,375,300,900	2.12
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	60,700	19,907.91 1,208,411,886	19,175.15 1,163,932,139	1.04
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	86,070	11,846.03 1,019,595,049	13,006.03 1,119,429,553	1.00
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,917	117,111.22 927,170,088	135,675.26 1,074,141,071	0.96
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	67,650	15,782.48 1,067,687,129	15,697.64 1,061,945,711	0.95
8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	106,605	9,317.39 993,288,507	9,740.89 1,038,428,527	0.93
9	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	7,550	118,764.12 896,669,721	137,119.87 1,035,255,058	0.92
10	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	243,301	3,230.83 786,072,521	3,400.28 827,292,935	0.74
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	32,400	21,733.66 704,173,204	24,610.61 797,384,056	0.71
12	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	44,900	12,598.43 565,674,385	17,037.77 764,995,936	0.68
13	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	80,100	9,798.97 784,904,619	9,441.71 756,281,195	0.68
14	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	147,663	4,111.57 607,135,649	4,985.72 736,206,815	0.66
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	24,226	25,436.38 616,223,084	30,056.30 728,143,936	0.65
16	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	117,222	6,439.98 754,914,743	5,998.76 703,187,512	0.63
17	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	183,791	4,012.31 737,440,447	3,795.50 697,580,468	0.62
18	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	29,000	20,201.83 585,855,899	23,490.81 681,233,745	0.61

19	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	48,168	13,355.15 643,292,960	13,908.91 669,964,757	0.60
20	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	120,400	4,288.97 516,403,085	5,488.83 660,856,107	0.59
21	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通 信サー ビス	104,554	5,677.70 593,629,834	6,086.21 636,338,259	0.57
22	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	117,900	5,042.84 594,561,778	5,210.59 614,328,750	0.55
23	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	63,617	10,069.79 640,610,853	9,410.41 598,662,066	0.53
24	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	23,450	17,180.86 402,893,550	25,247.74 592,059,660	0.53
25	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・ サービス	13,940	31,216.30 435,156,777	41,724.48 581,639,283	0.52
26	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケ ア	56,150	9,680.54 543,566,459	9,806.64 550,643,038	0.49
27	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケ ア	68,071	6,331.86 431,017,237	8,031.67 546,723,836	0.49
28	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	102,350	5,156.98 527,820,879	5,225.35 534,815,156	0.48
29	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	64,473	8,519.90 549,304,175	8,284.93 534,154,389	0.48
30	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	517,250	1,098.82 568,418,709	1,012.97 523,961,112	0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.25%
投資証券	2.37%
合計	98.62%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	6.91%
素材	4.55%
資本財・サービス	10.21%

一般消費財・サービス	11.81%
生活必需品	7.91%
ヘルスケア	13.16%
金融	16.63%
情報技術	19.34%
電気通信サービス	2.29%
公益事業	2.92%
不動産	0.51%
その他	0.00%
合計	96.25%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2018年12月	買建	96	1,580,416,497	1,591,797,120	1.42%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年10 月	買建	2,400,000	271,174,560	272,400,000	0.24%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2018年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	293,805,590	1.53
内 アメリカ	293,805,590	1.53

投資証券		18,585,510,034	97.08
内 ガーンジー		24,572,177	0.13
内 マン島		8,518,056	0.04
内 香港		416,088,491	2.17
内 シンガポール		674,354,741	3.52
内 イスラエル		4,342,902	0.02
内 イギリス		1,009,749,635	5.27
内 アイルランド		49,492,131	0.26
内 オランダ		72,675,751	0.38
内 ベルギー		148,238,986	0.77
内 フランス		951,851,767	4.97
内 ドイツ		53,809,946	0.28
内 スペイン		148,397,241	0.78
内 イタリア		19,872,543	0.10
内 カナダ		353,614,807	1.85
内 アメリカ		13,253,917,021	69.23
内 オーストラリア		1,316,710,139	6.88
内 ニュージーランド		79,303,700	0.41
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		266,168,473	1.39
純資産総額		19,145,484,097	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)	187,334,335	0.98
内 ドイツ	23,084,858	0.12
内 アメリカ	164,249,477	0.86
為替予約取引(買建)	77,529,400	0.40
内 日本	77,529,400	0.40

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

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

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

(2) 投資資産 (2018年9月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	45,547	18,255.24 831,473,875	19,928.12 907,666,441	4.74
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	92,702	7,333.10 679,796,390	7,547.86 699,701,922	3.65
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	22,000	23,649.58 520,291,313	22,656.07 498,433,745	2.60
4	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	フランス	投資証券	20,390	26,858.77 547,650,608	23,283.06 474,741,757	2.48
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	20,300	20,282.80 411,742,016	20,184.79 409,751,361	2.14
6	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	54,000	7,439.51 401,739,679	7,376.37 398,324,061	2.08
7	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	54,800	7,393.63 405,175,137	7,160.58 392,400,250	2.05
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	30,378	13,092.34 397,720,893	12,674.41 385,023,288	2.01
9	LINK REIT	香港	投資証券	324,000	1,025.71 332,335,017	1,112.99 360,611,352	1.88
10	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	52,479	6,973.19 365,947,018	6,128.23 321,603,760	1.68
11	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	22,700	14,160.47 321,444,553	13,710.17 311,220,868	1.63
12	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託受益証券	32,500	9,256.29 300,830,462	9,040.17 293,805,590	1.53
13	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	42,717	6,249.52 266,965,591	6,373.54 272,258,867	1.42
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	9,667	27,726.63 268,034,395	27,471.44 265,566,481	1.39
15	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	810,020	342.29 277,276,584	327.32 265,135,746	1.38
16	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	109,200	2,260.04 246,801,402	2,405.41 262,671,056	1.37
17	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	15,600	14,367.51 224,133,234	13,938.44 217,439,759	1.14

18	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	25,464	8,552.72 217,787,683	8,171.36 208,075,549	1.09
19	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	243,850	722.14 176,113,418	851.03 207,524,153	1.08
20	HCP INC	アメリカ	投資証券	69,200	2,973.03 205,735,377	2,913.07 201,584,479	1.05
21	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	16,728	11,359.27 190,019,418	11,233.20 187,909,115	0.98
22	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	18,600	9,764.18 181,615,352	9,713.64 180,673,743	0.94
23	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	24,920	7,511.74 187,193,797	7,207.15 179,602,233	0.94
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	39,000	4,390.61 171,235,054	4,529.17 176,637,692	0.92
25	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	52,000	3,204.26 166,627,453	3,147.02 163,645,284	0.85
26	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	42,100	4,387.89 184,733,272	3,871.60 162,994,415	0.85
27	GECINA SA	フランス	投資証券	8,121	18,855.05 153,122,966	19,384.93 157,425,081	0.82
28	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	10,700	14,659.27 156,855,048	14,106.52 150,939,868	0.79
29	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	113,681	1,386.97 157,681,412	1,318.05 149,837,835	0.78
30	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	150,490	848.10 127,637,889	945.83 142,339,317	0.74

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	1.53%
投資証券	97.08%
合計	98.61%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DJ US REIT IDXFTRS 2018年12月	買建	46	169,930,816	164,249,477	0.86%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFTR 2018年12月	買建	20	23,388,780	23,084,858	0.12%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年10 月	買建	500,000	56,518,680	56,766,000	0.30%
		ユーロ買/円売 2018年10 月	買建	100,000	13,244,380	13,213,000	0.07%
		カナダ・ドル買/円売 2018年10月	買建	20,000	1,696,250	1,742,000	0.01%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2018年10月	買建	70,000	5,744,052	5,808,400	0.03%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2018年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	9,682,791,328	96.16
内 タイ	814,604,958	8.09
内 マレーシア	568,627,210	5.65
内 フィリピン	31,336,830	0.31
内 インドネシア	890,325,614	8.84
内 ポーランド	926,383,817	9.20
内 ロシア	748,657,459	7.43
内 ハンガリー	452,501,491	4.49
内 ルーマニア	258,659,799	2.57
内 トルコ	412,916,312	4.10

内 チェコ	412,141,802	4.09
内 メキシコ	959,839,312	9.53
内 コロンビア	719,486,638	7.15
内 ペルー	300,287,104	2.98
内 チリ	248,351,511	2.47
内 ブラジル	1,009,706,796	10.03
内 ウルグアイ	26,557,777	0.26
内 アルゼンチン	50,666,868	0.50
内 南アフリカ	851,740,030	8.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	386,829,673	3.84
純資産総額	10,069,621,001	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)	124,395,841	1.24
内 日本	124,395,841	1.24
為替予約取引(売建)	30,840,000	0.31
内 日本	30,840,000	0.31

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

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

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

(2) 投資資産 (2018年9月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	8,640,000	84.56 206,613,227	86.25 210,759,663	- 2020/07/01	2.09
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	19,050,000	109.67 167,975,027	108.47 166,134,821	10.500000 2026/12/21	1.65
3	Colombian TES	コロンビア	国債証券	3,050,000,000	119.30 138,270,068	117.99 136,758,523	10.000000 2024/07/24	1.36
4	Colombian TES	コロンビア	国債証券	3,310,000,000	106.63 134,124,245	105.31 132,461,433	7.500000 2026/08/26	1.32
5	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	21,950,000	96.82 128,372,625	96.88 128,448,195	6.500000 2021/06/10	1.28

6	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	18,350,000	112.04 124,187,280	110.65 122,638,929	10.000000 2024/12/05	1.22
7	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	4,410,000	98.29 122,582,176	97.54 121,654,298	10.000000 2023/01/01	1.21
8	Colombian TES	コロンビア	国債証券	2,935,000,000	104.75 116,834,366	104.46 116,504,238	7.000000 2022/05/04	1.16
9	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	19,450,000	95.92 112,686,072	95.86 112,623,809	6.500000 2022/06/09	1.12
10	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	5,030,000	75.94 108,026,279	77.36 110,046,207	- 2021/07/01	1.09
11	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	3,990,000	95.35 107,594,783	94.79 106,965,152	10.000000 2025/01/01	1.06
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	16,990,000	100.58 103,214,793	100.32 102,956,192	8.000000 2020/06/11	1.02
13	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	14,020,000	91.72 103,397,676	89.05 100,377,872	8.750000 2048/02/28	1.00
14	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	26,600,000	105.85 98,827,911	104.74 97,795,283	3.650000 2021/12/17	0.97
15	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	23,050,000	119.13 96,382,835	117.62 95,163,476	4.875000 2029/06/22	0.95
16	Colombian TES	コロンビア	国債証券	2,265,000,000	111.43 95,916,271	110.52 95,129,728	11.000000 2020/07/24	0.94
17	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	3,650,000	88.77 91,634,298	90.58 93,501,584	- 2020/01/01	0.93
18	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	3,030,000	101.51 86,985,722	101.20 86,723,515	10.000000 2021/01/01	0.86
19	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	11,150,000,000	101.92 86,369,804	100.47 85,139,125	8.375000 2024/03/15	0.85
20	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	2,890,000	94.80 84,795,247	94.68 84,689,682	2.500000 2027/07/25	0.84
21	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	2,530,000	107.15 83,906,115	106.85 83,671,204	4.000000 2023/10/25	0.83
22	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	23,400,000	96.74 79,459,716	96.18 79,001,409	2.125000 2026/12/17	0.78
23	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	10,224,000,000	102.49 79,638,743	101.15 78,602,193	8.375000 2026/09/15	0.78
24	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	2,640,000	95.56 78,084,250	95.87 78,337,545	2.500000 2026/07/25	0.78
25	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	2,210,000	113.75 77,805,115	113.07 77,339,314	5.750000 2022/09/23	0.77

26	Russian Federal Bond - OFZ	ロシア	国債証券	47,000,000	100.30 81,553,930	93.66 76,158,198	7.700000 2033/03/23	0.76
27	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	10,020,000,000	99.76 75,972,281	98.96 75,360,780	8.375000 2034/03/15	0.75
28	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	10,300,000	90.94 75,312,589	90.17 74,679,033	8.250000 2032/03/31	0.74
29	Colombian TES	コロンビア	国債証券	2,090,000,000	95.46 75,817,284	93.95 74,619,061	6.000000 2028/04/28	0.74
30	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	21,200,000	99.60 74,120,304	98.84 73,552,541	1.875000 2022/06/17	0.73

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.16%
合計	96.16%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ルーマニア・レイ買/円 売 2018年10月	買建	979,000	27,353,785	27,725,280	0.28%
		チェコ・コルナ買/円売 2018年10月	買建	5,089,000	25,724,451	26,157,460	0.26%
		ハンガリー・フォリント 買/円売 2018年10月	買建	24,410,000	9,950,642	9,961,721	0.10%
		メキシコ・ペソ買/円売 2018年10月	買建	4,600,000	27,406,820	27,692,000	0.28%
		ポーランド・ズロチ買/ 円売 2018年10月	買建	466,000	14,313,953	14,413,380	0.14%

	南アフリカ・ランド買/ 円売 2018年10月	買建	2,300,000	17,924,440	18,446,000	0.18%
	チェコ・コルナ売/円買 2018年10月	売建	6,000,000	30,895,200	30,840,000	0.31%

(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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2018年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	166,755,462,232	97.90
内 ユーロ	67,173,404,714	39.44
内 シンガポール	656,855,851	0.39
内 マレーシア	806,359,298	0.47
内 ノルウェー	404,124,455	0.24
内 スウェーデン	633,037,032	0.37
内 デンマーク	1,010,296,827	0.59
内 イギリス	11,066,041,208	6.50
内 ポーランド	1,036,535,954	0.61
内 カナダ	3,463,131,184	2.03
内 アメリカ	74,575,311,154	43.78
内 メキシコ	1,453,490,207	0.85
内 南アフリカ	934,225,749	0.55
内 オーストラリア	3,542,648,599	2.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,574,118,050	2.10
純資産総額	170,329,580,282	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,703,881,880	1.00
内 日本	1,703,881,880	1.00

(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。

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

(2) 投資資産（2018年9月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,300,000	99.21 709,867,581	97.53 697,825,527	2.750000 2028/02/15	0.41
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,287,000	99.30 709,059,519	96.31 687,681,731	2.000000 2022/11/30	0.40
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,084,000	161.87 659,657,211	158.73 646,872,415	4.500000 2041/04/25	0.38
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,921,000	98.95 665,410,512	95.82 644,393,440	2.250000 2024/11/15	0.38
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,840,000	99.47 659,773,376	95.03 630,345,027	2.250000 2025/11/15	0.37
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,900,000	98.80 662,049,046	93.79 628,492,291	2.250000 2027/08/15	0.37
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,788,000	98.87 649,948,049	94.69 622,471,105	2.125000 2025/05/15	0.37
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,500,000	99.99 624,582,757	98.50 615,309,199	2.875000 2028/05/15	0.36
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,700,000	99.92 646,889,382	94.96 614,722,610	2.375000 2027/05/15	0.36
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,743,000	98.14 640,100,985	94.17 614,266,055	2.000000 2025/02/15	0.36
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,743,000	97.81 637,961,662	93.70 611,161,428	2.000000 2025/08/15	0.36
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,807,000	165.97 615,610,911	161.25 598,122,176	5.750000 2032/10/25	0.35
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,697,000	125.56 613,387,695	121.09 591,565,436	4.250000 2023/10/25	0.35
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,023,000	151.92 606,888,243	147.33 588,535,252	5.500000 2029/04/25	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,229,000	103.05 611,993,938	98.92 587,449,807	2.750000 2024/02/15	0.34
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,500,000	97.55 609,347,228	93.61 584,764,547	2.250000 2027/11/15	0.34

17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,500,000	97.03 606,139,557	92.52 577,931,041	2.000000 2026/11/15	0.34
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,340,000	97.83 593,325,743	94.14 570,925,021	2.250000 2027/02/15	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,600,000	93.28 593,259,697	89.26 567,718,258	1.500000 2026/08/15	0.33
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,162,000	100.73 590,551,402	96.70 566,919,732	2.375000 2024/08/15	0.33
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,021,000	103.16 588,277,204	99.01 564,618,155	2.750000 2023/11/15	0.33
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,000,000	100.02 568,008,998	99.32 564,011,334	2.625000 2021/06/15	0.33
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,025,000	144.56 577,850,235	139.21 556,455,084	6.000000 2025/10/25	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,366,000	94.68 577,038,314	90.74 552,996,829	1.625000 2026/02/15	0.32
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,499,000	120.81 558,611,519	118.29 546,923,112	2.750000 2027/10/25	0.32
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	4,100,000	100.30 543,434,074	99.68 540,083,665	0.750000 2028/05/25	0.32
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,630,000	114.53 549,392,769	111.29 533,846,723	3.000000 2022/04/25	0.31
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,550,000	114.21 535,774,447	110.78 519,670,347	3.250000 2021/10/25	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,029,000	94.47 539,593,561	90.45 516,616,457	1.625000 2026/05/15	0.30
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,146,000	126.42 525,581,080	122.77 510,382,633	3.500000 2026/04/25	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.90%
合計	97.90%

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

八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2018年10月	買建	255,000	20,628,973	20,856,450	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2018年10月	買建	95,000	8,229,185	8,276,400	0.00%
		デンマーク・クローネ 買/円売 2018年10月	買建	886,000	15,337,032	15,699,920	0.01%
		米ドル買/円売 2018年10月	買建	6,879,000	766,484,967	780,906,260	0.46%
		英ポンド買/円売 2018年 10月	買建	507,000	73,790,684	75,284,430	0.04%
		ポーランド・ズロチ買/ 円売 2018年10月	買建	472,000	14,200,025	14,598,960	0.01%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2018年10月	買建	178,000	14,383,646	14,770,440	0.01%
		ユーロ買/円売 2018年10月	買建	5,854,000	761,588,804	773,489,020	0.45%

(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

●iFree 8資産バランス

2018年9月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,877円
純資産総額	99億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.4%
3カ月間	3.7%
6カ月間	4.5%
1年間	4.2%
3年間	-
5年間	-
設定来	18.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「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。
「分配金再投資基準価額」の騰落率です。 ※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 17年9月	第2期 18年9月							
分配金	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

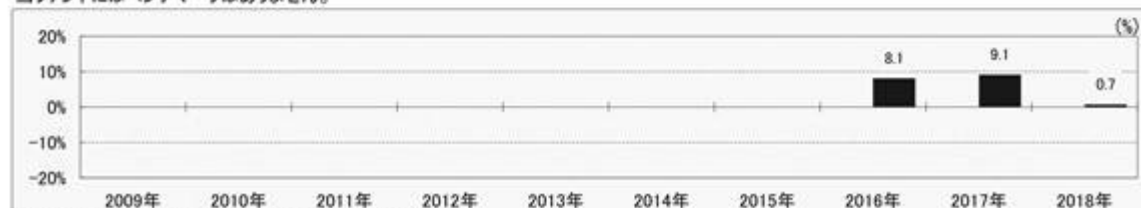
※比率は、純資産総額に対するものです。

マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
トピックス・インデックス・MF	12.7%	外国債券	911	24.0%	日本円	38.4%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	1.2%
ダイワ新興国株式 F・INDEX・MF	12.7%	外国株式・先物	1,603	23.3%	米ドル	25.0%	日本ビルファンド	日本	0.9%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	12.5%	国内株式・先物	1,498	12.7%	ユーロ	7.4%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.8%
外国株式INDEXMF	12.3%	国内リート・先物	61	12.3%	香港ドル	4.0%	野村不動産マスターF	日本	0.6%
ダイワJ-REIT MF	12.3%	外国リート・先物	318	12.1%	ブラジル・レアル	2.6%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.6%
外国債券INDEXMF	12.2%	国内債券	271	12.0%	英ポンド	2.3%	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.6%
日本債券インデックスMF(BPI)	12.1%	外国投資信託等	9	1.4%	南アフリカ・ランド	1.9%	日本リテールファンド	日本	0.5%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	12.0%				メキシコ・ペソ	1.9%	オリックス不動産投資	日本	0.5%
					台湾ドル	1.9%	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	0.5%
		コール・ローン、その他		2.8%	その他	14.8%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.5%
合計	99.0%	合計	4,671	-	合計	100.0%	合計		6.7%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額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。
・2016年は設定日(9月8日)から年末、2018年は9月28日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

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、「分配金再投資コース」の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。

継続申込期間においては、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。

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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

2 【換金(解約)手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までには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。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、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たものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り得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得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。
- ・わが国および外国の公社債：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9月8日から翌年9月7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、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは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は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨お

よびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前1.の事項（前1.の変更事項にあっては、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発送します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知っている受益者が議決権を行行使しないときは、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にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知っ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。

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

収益分配金は、決算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(当該収益分配金にかかる決算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、当該収益分配金にかかる計算期間の末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)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。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)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。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに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2期計算期間（平成29年9月8日から平成30年9月7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】

iFree 8資産バランス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成29年9月7日現在	第2期 平成30年9月7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	2,991,483
コール・ローン	64,311,618	120,823,062
親投資信託受益証券	4,377,862,456	9,152,937,456
流動資産合計	4,442,174,074	9,276,752,001
資産合計	4,442,174,074	9,276,752,001
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,439,691	19,650,628
未払受託者報酬	351,135	861,881
未払委託者報酬	3,687,375	8,619,273
その他未払費用	131,610	323,574
流動負債合計	18,609,811	29,455,356
負債合計	18,609,811	29,455,356
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,955,280,178	1 8,081,201,558
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	468,284,085	1,166,095,087
（分配準備積立金）	120,280,512	91,031,169
元本等合計	4,423,564,263	9,247,296,645
純資産合計	4,423,564,263	9,247,296,645
負債純資産合計	4,442,174,074	9,276,752,001

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成28年9月8日 至 平成29年9月7日	自	平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
営業収益				
受取利息		-		6
有価証券売買等損益		159,712,456		67,962,000
営業収益合計		159,712,456		67,962,006
営業費用				
支払利息		17,922		52,972
受託者報酬		432,057		1,462,529
委託者報酬		4,537,501		14,655,830
その他費用		162,009		555,749
営業費用合計		5,149,489		16,727,080
営業利益		154,562,967		51,234,926
経常利益		154,562,967		51,234,926
当期純利益		154,562,967		51,234,926
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		34,297,850		46,902,967
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		468,284,085
剰余金増加額又は欠損金減少額		419,949,319		934,829,745
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		419,949,319		934,829,745
剰余金減少額又は欠損金増加額		71,930,351		241,350,702
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		71,930,351		241,350,702
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		468,284,085		1,166,095,087

(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2期	
	自 平成29年9月8日	至 平成30年9月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1. 1 期首元本額	10,000,000円	3,955,280,178円
期中追加設定元本額	5,119,041,794円	5,936,562,291円
期中一部解約元本額	1,173,761,616円	1,810,640,911円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,955,280,178口	8,081,201,558口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成28年9月8日 至 平成29年9月7日	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(120,280,512円)、投資信託約款に規定される収益調整金(348,038,984円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は468,319,496円(1万口当たり1,184.04円)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(4,368,334円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,075,111,392円)及び分配準備積立金(86,662,835円)より分配対象額は1,166,142,561円(1万口当たり1,443.03円)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2期 自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期 平成30年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第1期 平成29年9月7日現在	第2期 平成30年9月7日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	148,132,078	60,796,121
合計	148,132,078	60,796,121

(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1期 平成29年9月7日現在	第2期 平成30年9月7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2期 自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7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1期 平成29年9月7日現在	第2期 平成30年9月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1184円 (11,184円)	1.1443円 (11,443円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	755,702,065	1,133,326,386	
	ダイワ新興国債券インデックス・マ ザーファンド	925,602,549	1,141,915,864	
	トピックス・インデックス・マザー ファンド	1,069,562,722	1,133,308,660	
	外国株式インデックスマザーファンド	453,272,929	1,135,811,305	
	外国債券インデックスマザーファンド	423,058,282	1,151,480,031	
	ダイワJ-REITマザーファンド	451,203,721	1,152,780,386	
	ダイワ・グローバルREITインデッ クス・マザーファンド	499,504,519	1,147,062,177	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	912,587,846	1,157,252,647	
親投資信託受益証券 合計			9,152,937,456	
合計			9,152,937,456	

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、「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・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、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITマザーファンド」受益証券及び「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	223,401,778
コール・ローン	6,648,658,147	9,022,977,824
株式 3 4	129,924,539,150	139,864,958,440
派生商品評価勘定	2,297,880	301,760
未収入金	1,630,080	683,520
未収配当金	58,901,912	71,488,355
未収利息	861,013	806,491
前払金	7,490,000	42,100,000
その他未収収益 5	6,442,091	5,810,811
流動資産合計	136,650,820,273	149,232,528,979
資産合計	136,650,820,273	149,232,528,979
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	23,660,640
未払金	4,212,320	698,389,362
未払解約金	156,082,000	54,554,300
受入担保金	5,341,230,562	7,376,155,919
その他未払費用	-	35,039

流動負債合計		5,501,524,882	8,152,795,260
負債合計		5,501,524,882	8,152,795,260
純資産の部			
元本等			
元本	1	133,145,475,897	133,142,800,795
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	1,996,180,506	7,936,932,924
元本等合計		131,149,295,391	141,079,733,719
純資産合計		131,149,295,391	141,079,733,719
負債純資産合計		136,650,820,273	149,232,528,979

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1. 1 期首	平成28年9月8日	平成29年9月8日
期首元本額	143,654,359,473円	133,145,475,897円
期中追加設定元本額	15,627,022,980円	17,186,580,603円
期中一部解約元本額	26,135,906,556円	17,189,255,705円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス ファンド	4,896,618,702円	4,245,628,279円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	12,084,121,303円	9,359,879,940円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2	63,828,395円	55,756,555円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	98,324,013円	72,184,941円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,596,875,323円	1,120,195,925円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	76,208,283円	59,077,590円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	2,295,278,056円	1,527,462,202円
D-I's TOPIXイン デックス	37,386,271円	28,183,767円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	27,492,055円	21,998,547円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	573,610円	675,429円
iFree TOPIXイン デックス	218,253,907円	645,665,905円
iFree 8資産バランス	554,289,722円	1,069,562,722円
iFree 年金バランス	- 円	3,937,772円
DCダイワ日本株式インデッ クス	61,269,812,340円	64,280,342,277円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,312,660,123円	2,467,642,627円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,363,094,190円	2,732,367,900円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,233,888,135円	2,662,328,093円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,968,189,714円	4,477,138,807円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	21,251,339円	15,088,706円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	59,644,627円	49,393,510円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	12,842,583円	15,685,699円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	- 円	936,142円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	404,752円	334,996円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	400,556円	343,410円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	753,865円	684,622円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	11,529,912円	4,016,770円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	48,352,674円	8,266,286円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	28,683,987円	9,446,810円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	557,638,921円	210,484,127円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	191,358,243円	166,035,147円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	11,937,573,145円	9,876,268,731円

	ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	319,015,775円	22,729,071円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	490,619,296円	25,269,263円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,023,222,261円	856,720,435円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	148,071,718円	129,305,829円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	256,045,701円	223,180,217円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	62,724,638円	123,650,057円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス	5,437,570,985円	8,208,650,119円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	4,253,094円	225,913,379円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	916,669,038円	1,838,368,259円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,200,859,744円	1,384,836,660円
	ダイワライフスタイル25	192,738,358円	178,510,387円
	ダイワライフスタイル50	644,422,182円	632,015,638円
	ダイワライフスタイル75	521,596,387円	539,009,109円
	DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)	14,960,337,974円	13,567,628,138円
	計	133,145,475,897円	133,142,800,795円
2.	期末日における受益権の総数	133,145,475,897口	133,142,800,795口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は1,996,180,506円であり ます。	
4.	3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。

	株式	5,124,123,700円	株式	6,921,220,300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。		先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。	
	株式	623,500,000円	株式	659,600,000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4,622,279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3,819,373円が含まれております。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	22,351,693,667	777,795,821
合計	22,351,693,667	777,795,821

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成28年9月21日から平成29年9月7日まで、及び平成29年9月20日から平成30年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成29年9月7日 現在				平成30年9月7日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,235,130,000	-	1,237,470,000	2,340,000	1,239,760,000	-	1,216,440,000	23,320,000
合計	1,235,130,000	-	1,237,470,000	2,340,000	1,239,760,000	-	1,216,440,000	23,320,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9850円 (9,850円)	1.0596円 (10,596円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,800	3,115.00	11,837,000	
日本水産	74,500	635.00	47,307,500	
マルハニチロ	12,600	3,815.00	48,069,000	
カネコ種苗	6,900	1,521.00	10,494,900	
サカタのタネ	9,900	3,760.00	37,224,000	
ホクト	7,100	1,909.00	13,553,900	
ショーボンドHD	6,100	8,150.00	49,715,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ミライト・ホールディングス	20,200	1,734.00	35,026,800	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
タマホーム	7,500	1,020.00	7,650,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
TATERU	10,300	502.00	5,170,600	貸付株式数 2,600株
日鉄鉱業	2,100	5,000.00	10,500,000	
三井松島	5,100	1,756.00	8,955,600	
国際石油開発帝石	313,500	1,202.00	376,827,000	貸付株式数 85,300株
石油資源開発	9,800	2,289.00	22,432,200	
K&Oエナジーグループ	3,500	1,703.00	5,960,500	

安藤・間	53,500	815.00	43,602,500	
東急建設	25,800	1,011.00	26,083,800	
コムシスホールディングス	23,100	3,035.00	70,108,500	
ミサワホーム	6,700	851.00	5,701,700	
高松コンストラクシヨンG P	4,200	2,883.00	12,108,600	
東建コーポレーション	2,400	7,240.00	17,376,000	
ヤマウラ	9,300	856.00	7,960,800	貸付株式数 2,300株
大成建設	65,200	4,880.00	318,176,000	
大林組	193,300	1,016.00	196,392,800	
清水建設	199,000	936.00	186,264,000	
飛鳥建設	74,400	180.00	13,392,000	
長谷工コーポレーション	74,900	1,389.00	104,036,100	
松井建設	11,800	884.00	10,431,200	
鹿島建設	285,000	764.00	217,740,000	
不動テトラ	63,700	216.00	13,759,200	
鉄建建設	4,400	2,801.00	12,324,400	
西松建設	14,900	2,590.00	38,591,000	
三井住友建設	46,800	696.00	32,572,800	
大豊建設	27,000	596.00	16,092,000	
前田建設	46,800	1,432.00	67,017,600	
奥村組	10,800	3,350.00	36,180,000	
東鉄工業	8,000	2,930.00	23,440,000	貸付株式数 1,700株
浅沼組	29,000	336.00	9,744,000	
戸田建設	75,200	752.00	56,550,400	
熊谷組	10,500	2,850.00	29,925,000	
北野建設	21,000	407.00	8,547,000	
三井ホーム	11,000	979.00	10,769,000	
矢作建設	10,700	807.00	8,634,900	
ピーエス三菱	13,100	514.00	6,733,400	
日本ハウスH L D G S	17,500	555.00	9,712,500	貸付株式数 4,700株
大東建託	23,300	15,240.00	355,092,000	貸付株式数 3,300株
新日本建設	8,900	1,160.00	10,324,000	
N I P P O	14,300	2,039.00	29,157,700	
東亜道路	2,000	3,625.00	7,250,000	
前田道路	18,400	2,160.00	39,744,000	
日本道路	1,900	5,920.00	11,248,000	
東亜建設	5,800	2,708.00	15,706,400	
若築建設	6,100	1,535.00	9,363,500	
東洋建設	22,900	439.00	10,053,100	
五洋建設	76,400	687.00	52,486,800	

世紀東急	13,600	677.00	9,207,200	
福 田 組	2,400	5,310.00	12,744,000	貸付株式数 600株
住友林業	40,300	1,802.00	72,620,600	
日本基礎技術	22,000	388.00	8,536,000	貸付株式数 3,000株
日成ビルド工業	12,100	1,018.00	12,317,800	
巴コーポレーション	14,900	460.00	6,854,000	
大和ハウス	192,100	3,178.00	610,493,800	
ライト工業	14,300	1,485.00	21,235,500	
積水ハウス	211,100	1,673.50	353,275,850	貸付株式数 58,500株
日特建設	10,900	730.00	7,957,000	
ユアテック	9,400	889.00	8,356,600	貸付株式数 500株
中電工	7,500	2,636.00	19,770,000	
関 電 工	24,400	1,081.00	26,376,400	
きんでん	41,200	1,709.00	70,410,800	
東京エネシス	8,200	1,062.00	8,708,400	
トーエネック	1,900	3,070.00	5,833,000	
住友電設	5,300	1,829.00	9,693,700	
日本電設工業	9,800	2,132.00	20,893,600	
協和エクシオ	23,700	3,105.00	73,588,500	貸付株式数 800株
日本工営	4,200	2,807.00	11,789,400	
九電工	12,900	4,260.00	54,954,000	
三機工業	14,000	1,199.00	16,786,000	
日 揮	56,200	2,194.00	123,302,800	貸付株式数 1,600株
中外炉工業	3,300	2,827.00	9,329,100	
太平電業	4,600	2,652.00	12,199,200	
高砂熱学	17,500	1,932.00	33,810,000	
NEC ネットズエスアイ	6,100	2,570.00	15,677,000	
明星工業	13,200	834.00	11,008,800	
大 気 社	8,200	3,510.00	28,782,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
ダイダン	4,700	2,712.00	12,746,400	
日比谷総合設備	8,000	1,877.00	15,016,000	貸付株式数 1,000株
東芝プラントシステム	13,500	2,318.00	31,293,000	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
日本製粉	18,800	1,797.00	33,783,600	
日清製粉G本社	71,700	2,168.00	155,445,600	
昭和産業	5,400	2,855.00	15,417,000	貸付株式数 1,400株
中部飼料	8,000	1,464.00	11,712,000	
フィード・ワン	48,200	198.00	9,543,600	
東洋精糖	9,900	1,223.00	12,107,700	

三井製糖	5,000	3,025.00	15,125,000	
塩水港精糖	43,900	253.00	11,106,700	
日新製糖	4,600	2,307.00	10,612,200	
L I F U L L	21,600	610.00	13,176,000	貸付株式数 5,800株
ジェイエシーリクルートメント	5,200	2,484.00	12,916,800	貸付株式数 1,300株
日本M&Aセンター	39,600	2,811.00	111,315,600	
タケエイ	9,100	881.00	8,017,100	貸付株式数 2,400株
トラスト・テック	3,200	4,785.00	15,312,000	
コシダカホールディングス	16,100	1,149.00	18,498,900	貸付株式数 1,000株
パソナグループ	6,200	1,682.00	10,428,400	貸付株式数 500株 (500株)
C D S	7,000	1,378.00	9,646,000	貸付株式数 1,900株
リンクアンドモチベーション	11,800	1,180.00	13,924,000	貸付株式数 2,900株
G C A	9,600	874.00	8,390,400	
エス・エム・エス	22,700	2,047.00	46,466,900	貸付株式数 5,800株
パーソルホールディングス	52,300	2,481.00	129,756,300	
リニカル	4,700	1,669.00	7,844,300	
クックパッド	21,400	447.00	9,565,800	貸付株式数 5,700株
森永製菓	13,700	4,105.00	56,238,500	
江崎グリコ	16,400	5,260.00	86,264,000	貸付株式数 4,500株
不二家	3,700	2,427.00	8,979,900	
山崎製パン	48,800	2,149.00	104,871,200	
モロゾフ	1,900	5,130.00	9,747,000	
亀田製菓	3,900	5,000.00	19,500,000	
寿スピリッツ	6,000	4,270.00	25,620,000	
カルビー	26,700	3,525.00	94,117,500	貸付株式数 7,400株
森永乳業	11,700	2,893.00	33,848,100	
六甲バター	5,000	2,396.00	11,980,000	
ヤクルト	34,100	8,190.00	279,279,000	
明治ホールディングス	38,500	7,270.00	279,895,000	
雪印メグミルク	14,200	2,682.00	38,084,400	
プリマハム	42,000	502.00	21,084,000	
日本ハム	24,600	3,945.00	97,047,000	貸付株式数 600株
丸大食品	35,000	444.00	15,540,000	
S F o o d s	4,800	4,330.00	20,784,000	
伊藤ハム米久H L D G S	36,800	805.00	29,624,000	
スタジオアリス	3,900	2,310.00	9,009,000	
シミックホールディングス	4,300	2,444.00	10,509,200	
システナ	19,900	1,395.00	27,760,500	

デジタルアーツ	3,200	5,030.00	16,096,000	貸付株式数	300株
新日鉄住金SOL	9,400	3,435.00	32,289,000		
総合警備保障	22,500	4,845.00	109,012,500		
キューブシステム	9,200	922.00	8,482,400		
いちご	84,600	414.00	35,024,400		
日本駐車場開発	84,500	167.00	14,111,500		
コア	4,800	1,273.00	6,110,400		
カカクコム	42,800	1,968.00	84,230,400		
ディップ	8,400	2,527.00	21,226,800		
オプトホールディング	4,400	2,951.00	12,984,400	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
ツクイ	15,600	1,038.00	16,192,800		
エムスリー	59,500	5,090.00	302,855,000		
アウトソーシング	25,100	1,669.00	41,891,900	貸付株式数	6,600株
ウェルネット	9,700	1,010.00	9,797,000	貸付株式数	2,500株
ワールドホールディングス	2,000	3,120.00	6,240,000	貸付株式数	500株 (500株)
ディー・エヌ・エー	30,100	1,874.00	56,407,400	貸付株式数	8,300株
博報堂DYHLDGS	77,800	1,815.00	141,207,000		
ぐるなび	11,000	890.00	9,790,000	貸付株式数	1,300株
ファンコミュニケーションズ	19,000	656.00	12,464,000		
WDBホールディングス	3,100	3,815.00	11,826,500		
ティア	7,800	956.00	7,456,800	貸付株式数	2,200株
バリューコマース	4,500	2,155.00	9,697,500		
インフォマート	32,000	1,382.00	44,224,000	貸付株式数	8,600株
サッポロホールディングス	20,800	2,251.00	46,820,800	貸付株式数	5,700株
アサヒグループホールディング	122,700	4,785.00	587,119,500	貸付株式数	34,000株
キリンHD	265,000	2,682.00	710,730,000	貸付株式数	73,500株
宝ホールディングス	44,100	1,313.00	57,903,300	貸付株式数	9,600株 (9,600株)
オエノンホールディングス	24,600	388.00	9,544,800		
コカ・コーラボトラーズJHD	44,800	2,936.00	131,532,800		
サントリー食品インター	39,100	4,460.00	174,386,000		
ダイドーグループHD	3,200	5,250.00	16,800,000	貸付株式数	800株
伊藤園	19,500	4,380.00	85,410,000	貸付株式数	5,300株
キーコーヒー	7,000	2,104.00	14,728,000		
日清オイリオグループ	7,000	3,020.00	21,140,000		
不二製油グループ	15,900	3,305.00	52,549,500		
J-オイルミルズ	3,100	3,680.00	11,408,000		

ローソン	14,300	6,470.00	92,521,000	貸付株式数	4,800株
サンエー	4,400	5,100.00	22,440,000	貸付株式数	1,200株
カワチ薬品	4,800	2,086.00	10,012,800		
エービーシー・マート	10,300	6,060.00	62,418,000		
ハードオフコーポレーション	8,300	948.00	7,868,400		
アスクル	5,100	3,210.00	16,371,000	貸付株式数	1,600株
ゲオホールディングス	10,900	1,529.00	16,666,100	貸付株式数	3,000株
アダストリア	9,300	1,359.00	12,638,700	貸付株式数	2,500株
くらコーポレーション	3,600	6,690.00	24,084,000	貸付株式数	900株
エレマテック	2,900	2,418.00	7,012,200		
パルグループHLDGS	3,400	2,427.00	8,251,800		
JALUX	2,500	2,744.00	6,860,000	貸付株式数	700株
エディオン	22,600	1,260.00	28,476,000	貸付株式数	8,800株
あらた	3,100	5,220.00	16,182,000		
サーラコーポレーション	13,700	653.00	8,946,100		
ワッツ	7,200	939.00	6,760,800	貸付株式数	200株
ハローズ	3,600	2,520.00	9,072,000		
J Pホールディングス	25,800	308.00	7,946,400	貸付株式数	6,100株 (2,000株)
あみやき亭	2,200	4,340.00	9,548,000		
東京エレクトロニクス	3,600	1,918.00	6,904,800		
ひらまつ	16,200	432.00	6,998,400	貸付株式数	4,700株
フィールズ	5,700	925.00	5,272,500	貸付株式数	1,200株
双日	338,300	380.00	128,554,000		
アルフレッサホールディングス	63,200	2,706.00	171,019,200		
大黒天物産	1,900	4,275.00	8,122,500	貸付株式数	400株
ハニーズホールディングス	10,000	1,020.00	10,200,000		
キッコーマン	42,600	5,780.00	246,228,000		
味の素	133,600	1,848.50	246,959,600	貸付株式数	20,600株
キューピー	32,400	2,606.00	84,434,400		
ハウス食品G本社	22,400	3,160.00	70,784,000		
カゴメ	23,700	3,115.00	73,825,500		
アリアケジャパン	5,400	9,670.00	52,218,000		
ニチレイ	28,000	2,675.00	74,900,000		
横浜冷凍	16,400	891.00	14,612,400		
東洋水産	31,900	4,120.00	131,428,000		
日清食品HD	22,700	7,250.00	164,575,000		
永谷園ホールディングス	9,000	1,467.00	13,203,000		
フジッコ	6,700	2,304.00	15,436,800		

ロックフィールド	7,500	1,716.00	12,870,000		
日本たばこ産業	337,100	2,865.50	965,960,050	貸付株式数	93,600株
ケンコーマヨネーズ	4,600	2,780.00	12,788,000	貸付株式数	1,200株
わらべや日洋HD	4,300	2,165.00	9,309,500	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
北の達人コーポ	19,600	549.00	10,760,400	貸付株式数	5,100株
ユーグレナ	23,600	823.00	19,422,800	貸付株式数	6,600株 (5,800株)
片倉工業	8,100	1,326.00	10,740,600		
グ ン ゼ	4,800	5,430.00	26,064,000		
ヒューリック	119,200	1,020.00	121,584,000		
アルペン	4,400	1,970.00	8,668,000		
クオール	6,900	2,281.00	15,738,900		
アルコニックス	7,300	1,481.00	10,811,300	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
神戸物産	4,500	5,470.00	24,615,000		
ジンス	4,100	5,420.00	22,222,000	貸付株式数	1,000株
ビックカメラ	31,700	1,459.00	46,250,300	貸付株式数	8,900株 (8,900株)
DCMホールディングス	27,400	1,019.00	27,920,600	貸付株式数	9,100株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	4,800	3,780.00	18,144,000	貸付株式数	1,200株 (300株)
MonotaRO	18,600	6,040.00	112,344,000	貸付株式数	5,600株
あい ホールディングス	9,600	2,508.00	24,076,800	貸付株式数	2,600株
ディーブイエックス	5,700	1,345.00	7,666,500		
アークランドサービスHD	4,800	1,989.00	9,547,200	貸付株式数	1,200株
J. フロント リテイリ ング	67,200	1,560.00	104,832,000		
ドトール・日レスHD	9,400	1,967.00	18,489,800		
マツモトキヨシHLDGS	23,900	4,210.00	100,619,000		
ブロンコビリー	3,800	3,345.00	12,711,000	貸付株式数	900株 (900株)
スタートトゥデイ	56,900	3,410.00	194,029,000		
物語コーポレーション	1,800	10,090.00	18,162,000		
ココカラファイン	6,100	6,530.00	39,833,000		
三越伊勢丹HD	107,100	1,256.00	134,517,600		
東洋紡	21,900	1,889.00	41,369,100		
ユニチカ	19,400	652.00	12,648,800		
富士紡ホールディングス	3,800	3,195.00	12,141,000		

日清紡ホールディングス	36,400	1,220.00	44,408,000	貸付株式数	9,600株
倉敷紡績	63,000	297.00	18,711,000		
ダイワボウHD	5,000	6,620.00	33,100,000		
シキボウ	6,800	1,272.00	8,649,600		
日東紡績	9,000	2,497.00	22,473,000		
トヨタ紡織	16,600	1,855.00	30,793,000		
マクニカ・富士エレHLDGS	10,800	1,908.00	20,606,400		
ウエルシアHD	15,600	5,200.00	81,120,000		
クリエイトSDH	8,700	2,588.00	22,515,600		
バイタルKSKHD	10,700	1,263.00	13,514,100	貸付株式数	2,900株
UKCホールディングス	4,100	2,346.00	9,618,600		
TOKAIホールディングス	31,500	1,071.00	33,736,500		
三洋貿易	3,900	2,050.00	7,995,000		
ウイン・パートナーズ	5,400	1,331.00	7,187,400		
ジョイフル本田	16,400	1,629.00	26,715,600	貸付株式数	4,600株
鳥貴族	2,900	2,328.00	6,751,200	貸付株式数	100株
ホットランド	5,800	1,272.00	7,377,600	貸付株式数	1,600株 (1,300株)
すかいらーくHD	52,600	1,634.00	85,948,400	貸付株式数	14,200株 (2,800株)
綿半ホールディングス	3,100	2,658.00	8,239,800	貸付株式数	700株
日本毛織	18,900	865.00	16,348,500		
ユナイテッド・スーパーマーケ	20,200	1,281.00	25,876,200		
三栄建築設計	3,400	1,600.00	5,440,000		
野村不動産HLDGS	37,900	2,242.00	84,971,800		
三重交通グループHD	15,700	527.00	8,273,900	貸付株式数	600株
サムティ	6,400	2,076.00	13,286,400	貸付株式数	1,600株
日本商業開発	5,100	1,796.00	9,159,600		
プレサンスコーポレーション	9,100	1,458.00	13,267,800		
ユニゾホールディングス	8,000	2,088.00	16,704,000	貸付株式数	1,700株
日本管理センター	6,700	1,255.00	8,408,500		
フージャースHD	17,400	665.00	11,571,000	貸付株式数	2,000株
オープンハウス	9,900	5,000.00	49,500,000	貸付株式数	1,000株
東急不動産HD	137,400	721.00	99,065,400		
飯田GHD	47,000	1,936.00	90,992,000	貸付株式数	13,100株
帝国繊維	7,200	2,601.00	18,727,200		
日本コークス工業	58,300	109.00	6,354,700		
あさひ	6,400	1,426.00	9,126,400		

日本調剤	2,300	3,510.00	8,073,000	貸付株式数 400株 (100株)
コスモス薬品	3,000	23,250.00	69,750,000	
シップヘルスケアHD	11,600	4,075.00	47,270,000	
ソフトクリエイトHD	5,700	1,706.00	9,724,200	貸付株式数 1,000株
セブン&アイ・HLDGS	240,200	4,553.00	1,093,630,600	
薬王堂	2,800	3,655.00	10,234,000	貸付株式数 800株
クリエイト・レストランツ・ホール	16,500	1,313.00	21,664,500	貸付株式数 4,400株
ツルハホールディングス	12,500	13,090.00	163,625,000	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
サンマルクホールディングス	4,100	2,553.00	10,467,300	
トリドールホールディングス	7,600	2,435.00	18,506,000	貸付株式数 2,000株
帝人	48,200	2,136.00	102,955,200	貸付株式数 13,200株 (13,000株)
東レ	440,500	818.00	360,329,000	
クラレ	93,300	1,541.00	143,775,300	貸付株式数 25,600株
旭化成	381,200	1,565.50	596,768,600	
サカイオーベックス	3,400	2,358.00	8,017,200	
TOKYO BASE	7,000	654.00	4,578,000	
宮地エンジニアリングG	2,800	2,919.00	8,173,200	
トーカロ	17,100	1,165.00	19,921,500	
アルファCO	3,400	1,410.00	4,794,000	
SUMCO	63,700	1,713.00	109,118,100	貸付株式数 17,600株
川田テクノロジーズ	1,400	5,760.00	8,064,000	
住江織物	2,800	2,760.00	7,728,000	貸付株式数 600株
アツギ	8,900	1,139.00	10,137,100	
コメダホールディングス	11,300	2,186.00	24,701,800	
ダイユー・リックHLDGS	6,200	1,188.00	7,365,600	
クスリのアオキHLDGS	4,700	7,970.00	37,459,000	貸付株式数 1,200株
ダイニック	8,300	923.00	7,660,900	貸付株式数 300株
共和レザー	9,800	941.00	9,221,800	
スシローグローバルHLDGS	6,700	6,360.00	42,612,000	
LIXILピバ	7,700	1,730.00	13,321,000	
セーレン	14,400	1,803.00	25,963,200	
ソトー	12,800	1,006.00	12,876,800	貸付株式数 1,600株
東海染工	6,300	1,355.00	8,536,500	貸付株式数 1,700株
小松精練	11,500	847.00	9,740,500	
ワコールホールディングス	16,100	3,190.00	51,359,000	

ホギメディカル	8,000	3,725.00	29,800,000		
T S Iホールディングス	21,200	719.00	15,242,800		
T I S	19,400	5,280.00	102,432,000		
電算システム	6,300	2,108.00	13,280,400		
グリー	32,800	548.00	17,974,400		
コーエーテクモHD	9,600	2,198.00	21,100,800		
三菱総合研究所	2,800	4,110.00	11,508,000		
K L a b	10,700	979.00	10,475,300	貸付株式数	3,000株
ポルトゥウィン・ピットクル	5,000	2,449.00	12,245,000	貸付株式数	1,200株
ネクソン	145,600	1,363.00	198,452,800		
アイスタイル	16,000	1,216.00	19,456,000	貸付株式数	3,400株
エイチーム	4,600	2,097.00	9,646,200		
テクノスジャパン	10,000	948.00	9,480,000	貸付株式数	2,400株
コロプラ	16,500	714.00	11,781,000	貸付株式数	4,600株 (4,500株)
ブロードリーフ	31,200	680.00	21,216,000		
デジタルハーツHLDGS	5,100	1,501.00	7,655,100	貸付株式数	1,200株
メディアドゥHLDGS	3,000	2,513.00	7,539,000		
特種東海製紙	3,300	4,335.00	14,305,500		
ティーガイア	6,100	2,847.00	17,366,700		
豆蔵ホールディングス	7,900	912.00	7,204,800	貸付株式数	1,700株
ガンホー・オンライン・エンター	138,000	221.00	30,498,000	貸付株式数	43,100株
GMOペイメントゲートウェイ	4,900	13,580.00	66,542,000	貸付株式数	1,300株
インターネットイニシアティブ	10,400	2,320.00	24,128,000	貸付株式数	2,700株
さくらインターネット	13,200	680.00	8,976,000	貸付株式数	2,800株
S R Aホールディングス	3,700	3,260.00	12,062,000		
システムインテグレータ	5,800	1,651.00	9,575,800		
朝日ネット	23,000	506.00	11,638,000	貸付株式数	100株
コムチュア	3,900	3,940.00	15,366,000		
王子ホールディングス	256,000	768.00	196,608,000		
日本製紙	25,000	1,963.00	49,075,000	貸付株式数	6,300株
三菱製紙	14,100	615.00	8,671,500	貸付株式数	600株
北越コーポレーション	31,700	636.00	20,161,200		
中越パルプ	4,900	1,638.00	8,026,200		
大王製紙	23,100	1,596.00	36,867,600	貸付株式数	6,400株 (6,200株)

gumi	9,100	740.00	6,734,000	貸付株式数	1,500株
アカツキ	1,800	3,605.00	6,489,000	貸付株式数	400株
LINE	18,100	4,580.00	82,898,000	貸付株式数	4,900株
レンゴー	59,200	919.00	54,404,800	貸付株式数	15,700株 (15,700株)
トーモク	4,300	1,992.00	8,565,600		
ザ・パック	4,400	3,180.00	13,992,000		
AOI TYO HOLDINGS	7,900	1,417.00	11,194,300		
マクロミル	8,100	2,452.00	19,861,200	貸付株式数	2,000株
昭和電工	38,300	5,100.00	195,330,000		
住友化学	443,000	601.00	266,243,000		
住友精化	2,600	5,540.00	14,404,000	貸付株式数	700株
日産化学	35,400	5,210.00	184,434,000		
ラサ工業	3,500	2,348.00	8,218,000	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,400	7,400.00	39,960,000		
テイカ	5,500	2,439.00	13,414,500		
石原産業	12,300	1,503.00	18,486,900		
日本曹達	42,000	626.00	26,292,000		
東ソー	86,800	1,628.00	141,310,400		
トクヤマ	18,000	3,115.00	56,070,000		
セントラル硝子	12,700	2,557.00	32,473,900		
東亜合成	33,600	1,210.00	40,656,000		
大阪ソーダ	6,800	2,923.00	19,876,400	貸付株式数	1,800株
関東電化	15,900	1,117.00	17,760,300		
デンカ	22,100	3,515.00	77,681,500		
イビデン	34,600	1,519.00	52,557,400	貸付株式数	9,600株
信越化学	100,500	9,733.00	978,166,500		
日本カ-パイド	3,600	1,673.00	6,022,800		
堺化学	4,700	2,762.00	12,981,400		
エア・ウォーター	48,800	1,901.00	92,768,800		
大陽日酸	47,500	1,644.00	78,090,000		
日本化学工業	2,800	3,675.00	10,290,000		
日本パ-カラijing	30,100	1,410.00	42,441,000		
高圧ガス	11,000	826.00	9,086,000		
四国化成	9,800	1,448.00	14,190,400		
戸田工業	2,400	2,786.00	6,686,400		
ステラ ケミファ	3,600	3,705.00	13,338,000	貸付株式数	900株
保土谷化学	2,500	3,110.00	7,775,000		
日本触媒	9,500	7,940.00	75,430,000		

大日精化	4,800	3,265.00	15,672,000	
カネカ	80,000	986.00	78,880,000	
協和発酵キリン	72,200	1,993.00	143,894,600	貸付株式数 20,100株
三菱瓦斯化学	49,700	2,240.00	111,328,000	
三井化学	54,500	2,691.00	146,659,500	
J S R	61,300	2,020.00	123,826,000	
東京応化工業	9,500	3,305.00	31,397,500	
大阪有機化学	6,800	1,306.00	8,880,800	貸付株式数 300株
三菱ケミカルH L D G S	405,900	951.20	386,092,080	
K H ネオケム	9,100	3,950.00	35,945,000	
ダイセル	80,300	1,220.00	97,966,000	
住友ベークライト	50,000	1,018.00	50,900,000	
積水化学	123,600	1,840.00	227,424,000	
日本ゼオン	51,000	1,127.00	57,477,000	
アイカ工業	17,000	4,195.00	71,315,000	
宇部興産	30,100	2,669.00	80,336,900	
積水樹脂	9,600	2,055.00	19,728,000	
タキロンシーアイ	15,100	614.00	9,271,400	
旭有機材	5,000	2,548.00	12,740,000	
日立化成	29,000	2,212.00	64,148,000	
ニチバン	3,500	2,541.00	8,893,500	
リケンテクノス	16,100	564.00	9,080,400	貸付株式数 4,500株
大倉工業	3,400	2,053.00	6,980,200	
積水化成品	9,100	926.00	8,426,600	貸付株式数 2,500株
群栄化学	2,500	3,120.00	7,800,000	
ダイキョーニシカワ	11,900	1,284.00	15,279,600	
竹本容器	2,400	2,813.00	6,751,200	貸付株式数 200株
日本化薬	38,100	1,251.00	47,663,100	貸付株式数 10,400株
カーリットホールディングス	8,000	932.00	7,456,000	貸付株式数 4,000株
E P S ホールディングス	9,200	2,243.00	20,635,600	
プレステージ・インター	13,200	1,235.00	16,302,000	
アミューズ	4,200	3,245.00	13,629,000	
野村総合研究所	36,800	5,480.00	201,664,000	
ドリームインキュベータ	3,100	2,022.00	6,268,200	貸付株式数 800株
クイック	5,000	1,944.00	9,720,000	
T A C	17,100	265.00	4,531,500	
ケネディクス	55,800	648.00	36,158,400	
電通	68,100	5,050.00	343,905,000	貸付株式数 18,800株 (400株)
インテージホールディングス	9,600	991.00	9,513,600	

ぴあ	2,000	5,030.00	10,060,000	
イオンファンタジー	2,100	3,595.00	7,549,500	
ネクシィーズグループ	3,600	1,712.00	6,163,200	
日本精化	7,700	1,310.00	10,087,000	貸付株式数 2,400株
扶桑化学工業	6,100	2,548.00	15,542,800	貸付株式数 1,200株
A D E K A	25,200	1,764.00	44,452,800	
日油	23,700	3,450.00	81,765,000	
ハリマ化成グループ	7,100	892.00	6,333,200	
花 王	143,200	8,744.00	1,252,140,800	貸付株式数 39,700株
第一工業製薬	14,000	693.00	9,702,000	
三洋化成	3,700	5,240.00	19,388,000	
武田薬品	214,400	4,374.00	937,785,600	貸付株式数 58,300株
アステラス製薬	572,400	1,817.50	1,040,337,000	
大日本住友製薬	43,900	2,122.00	93,155,800	貸付株式数 12,000株
塩野義製薬	81,900	6,437.00	527,190,300	貸付株式数 22,600株 (22,600株)
田辺三菱製薬	70,600	1,798.00	126,938,800	
あすか製薬	7,900	1,345.00	10,625,500	貸付株式数 200株
日本新薬	15,400	6,630.00	102,102,000	
中外製薬	61,000	6,530.00	398,330,000	貸付株式数 16,900株
科研製薬	10,300	5,590.00	57,577,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
エーザイ	70,000	9,888.00	692,160,000	
理研ビタミン	2,600	3,760.00	9,776,000	
ロート製薬	32,300	3,475.00	112,242,500	
小野薬品	137,600	2,897.50	398,696,000	
久光製薬	17,200	7,860.00	135,192,000	
持田製薬	3,800	8,530.00	32,414,000	
参天製薬	110,000	1,684.00	185,240,000	
扶桑薬品	4,000	2,746.00	10,984,000	
日本ケミファ	2,200	4,485.00	9,867,000	
ツムラ	20,600	3,840.00	79,104,000	
日医工	14,200	1,618.00	22,975,600	
テ ル モ	89,400	6,200.00	554,280,000	
みらかホールディングス	16,500	3,070.00	50,655,000	貸付株式数 4,500株
キッセイ薬品工業	9,800	3,160.00	30,968,000	
生化学工業	12,200	1,567.00	19,117,400	
栄研化学	9,800	2,268.00	22,226,400	
鳥居薬品	3,400	2,409.00	8,190,600	貸付株式数 1,000株
J C R ファーマ	4,300	5,510.00	23,693,000	

東和薬品	3,000	7,470.00	22,410,000	
富士製薬工業	4,500	1,758.00	7,911,000	
沢井製薬	11,600	5,900.00	68,440,000	貸付株式数 1,300株
ゼリア新薬工業	13,000	2,359.00	30,667,000	
第一三共	166,900	4,338.00	724,012,200	
キョーリン製薬HD	15,100	2,174.00	32,827,400	
大幸薬品	4,400	1,880.00	8,272,000	貸付株式数 1,100株
ダイト	4,100	3,215.00	13,181,500	
大塚ホールディングス	110,900	5,274.00	584,886,600	貸付株式数 30,800株
大正製薬HD	13,100	12,520.00	164,012,000	
ペプチドリーム	27,100	4,015.00	108,806,500	貸付株式数 7,200株
大日本塗料	8,800	1,249.00	10,991,200	貸付株式数 500株
日本ペイントHOLD	47,300	4,120.00	194,876,000	
関西ペイント	64,000	1,989.00	127,296,000	貸付株式数 12,300株
中国塗料	18,800	1,098.00	20,642,400	貸付株式数 5,100株
日本特殊塗料	4,900	2,239.00	10,971,100	貸付株式数 900株
藤倉化成	15,000	626.00	9,390,000	
太陽ホールディングス	4,500	4,250.00	19,125,000	
DIC	25,500	3,730.00	95,115,000	
サカタインクス	13,100	1,390.00	18,209,000	
東洋インキSCホールディン	11,200	2,718.00	30,441,600	
T&K TOKA	6,400	1,115.00	7,136,000	
アルプス技研	6,000	2,537.00	15,222,000	
オリエンタルランド	66,100	11,775.00	778,327,500	
ダスキン	14,900	2,655.00	39,559,500	
パーク24	33,800	3,240.00	109,512,000	貸付株式数 300株
明光ネットワークジャパン	9,700	1,015.00	9,845,500	貸付株式数 2,700株
ファルコホールディングス	8,200	1,812.00	14,858,400	
クレスコ	2,100	3,070.00	6,447,000	
フジ・メディア・HD	59,000	1,870.00	110,330,000	貸付株式数 200株
ラウンドワン	18,200	1,383.00	25,170,600	貸付株式数 4,800株
リゾートトラスト	23,300	1,750.00	40,775,000	
オービック	18,400	10,410.00	191,544,000	
ジャストシステム	10,000	1,965.00	19,650,000	
ヤフー	421,300	370.00	155,881,000	貸付株式数 116,800株
ビー・エム・エル	7,900	3,080.00	24,332,000	
トレンドマイクロ	30,700	6,950.00	213,365,000	貸付株式数 8,400株
りらいあコミュニケーション	9,900	1,380.00	13,662,000	
リソー教育	11,700	857.00	10,026,900	
日本オラクル	9,700	9,090.00	88,173,000	

フューチャー	9,700	1,738.00	16,858,600	
C A C H O L D I N G S	8,800	1,060.00	9,328,000	
ユー・エス・エス	67,400	2,034.00	137,091,600	
オービックビジネスC	3,200	8,940.00	28,608,000	
伊藤忠テクノソリュー	26,800	2,409.00	64,561,200	
アイティフォー	9,900	931.00	9,216,900	貸付株式数 2,800株
サイバーエージェント	34,900	5,900.00	205,910,000	
楽天	261,600	808.50	211,503,600	貸付株式数 72,500株
テー・オー・ダブリュー	13,100	755.00	9,890,500	
大塚商会	31,500	3,990.00	125,685,000	
総合メディカル	5,500	2,388.00	13,134,000	
サイボウズ	15,400	694.00	10,687,600	
セントラルスポーツ	2,500	4,185.00	10,462,500	
パラカ	2,900	2,267.00	6,574,300	貸付株式数 800株
電通国際情報S	4,100	3,905.00	16,010,500	貸付株式数 900株
デジタルガレージ	10,700	3,415.00	36,540,500	
イーエムシステムズ	6,500	1,232.00	8,008,000	
ウェザーニューズ	3,300	3,210.00	10,593,000	貸付株式数 700株 (700株)
C I J	13,200	752.00	9,926,400	
WOWOW	3,200	3,500.00	11,200,000	貸付株式数 800株
フルキャストホールディングス	6,600	2,370.00	15,642,000	
富士フイルムHLDGS	120,600	4,613.00	556,327,800	
コニカミノルタ	134,400	1,043.00	140,179,200	
資生堂	116,100	7,676.00	891,183,600	
ライオン	81,300	2,353.00	191,298,900	
高砂香料	3,800	3,795.00	14,421,000	
マンダム	11,100	3,360.00	37,296,000	貸付株式数 2,900株 (2,900株)
ミルボン	7,400	4,840.00	35,816,000	
ファンケル	14,400	5,280.00	76,032,000	
コーセー	10,000	19,350.00	193,500,000	
シーズ・ホールディングス	7,300	4,840.00	35,332,000	
ポーラ・オルビスHD	25,100	3,540.00	88,854,000	
ノエビアホールディングス	3,700	6,180.00	22,866,000	
エステー	4,700	1,960.00	9,212,000	
コニシ	10,700	1,703.00	18,222,100	
長谷川香料	7,200	2,176.00	15,667,200	

小林製薬	16,400	7,830.00	128,412,000	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
荒川化学工業	6,200	1,666.00	10,329,200	貸付株式数 200株
メック	5,000	1,771.00	8,855,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	5,300	2,340.00	12,402,000	
タカラバイオ	15,700	2,719.00	42,688,300	
J C U	7,500	2,488.00	18,660,000	
新田ゼラチン	12,700	806.00	10,236,200	
デクセリアルズ	15,900	1,097.00	17,442,300	貸付株式数 300株
アース製薬	4,300	4,950.00	21,285,000	
北興化学	12,800	548.00	7,014,400	
クミアイ化学	25,000	832.00	20,800,000	
日本農薬	14,800	785.00	11,618,000	
昭和シエル石油	55,900	2,142.00	119,737,800	
ニチレキ	8,600	1,274.00	10,956,400	
ユシロ化学	4,800	1,433.00	6,878,400	
ビーピー・カストロール	2,900	1,504.00	4,361,600	
富士石油	18,200	431.00	7,844,200	
M O R E S C O	5,200	1,588.00	8,257,600	
出光興産	49,100	5,500.00	270,050,000	
J X T Gホールディングス	929,100	719.20	668,208,720	
コスモエネルギーH L D G S	17,200	3,860.00	66,392,000	貸付株式数 4,500株 (4,500株)
横浜ゴム	32,300	2,238.00	72,287,400	貸付株式数 8,900株
東洋ゴム	29,800	1,738.00	51,792,400	
ブリヂストン	178,600	3,946.00	704,755,600	貸付株式数 49,600株
住友ゴム	50,700	1,585.00	80,359,500	
藤倉ゴム	12,100	568.00	6,872,800	
オカモト	20,000	1,197.00	23,940,000	
アキレス	5,400	2,289.00	12,360,600	貸付株式数 600株
ニッタ	5,600	3,885.00	21,756,000	
住友理工	9,800	1,019.00	9,986,200	
三ツ星ベルト	16,000	1,305.00	20,880,000	
バンドー化学	11,300	1,180.00	13,334,000	貸付株式数 400株
A G C	57,700	4,360.00	251,572,000	貸付株式数 16,100株
日本板硝子	29,800	1,114.00	33,197,200	貸付株式数 7,600株
有沢製作所	11,500	959.00	11,028,500	
日本山村硝子	59,000	185.00	10,915,000	
日本電気硝子	25,200	3,380.00	85,176,000	貸付株式数 6,800株

住友大阪セメント	110,000	461.00	50,710,000	
太平洋セメント	36,600	3,285.00	120,231,000	
日本ヒュ-ム	10,300	908.00	9,352,400	
日本コンクリ-ト	25,000	345.00	8,625,000	
アジアパイルHD	10,800	847.00	9,147,600	貸付株式数 2,900株
東海カーボン	54,100	1,938.00	104,845,800	貸付株式数 14,700株
日本カーボン	3,100	6,660.00	20,646,000	
東洋炭素	3,900	3,205.00	12,499,500	貸付株式数 700株
ノリタケ	3,500	6,540.00	22,890,000	
TOTO	45,200	4,575.00	206,790,000	貸付株式数 12,400株
日本碍子	68,700	1,724.00	118,438,800	
日本特殊陶業	49,000	2,949.00	144,501,000	
MARUWA	2,200	7,550.00	16,610,000	
品川リフラクトリーズ	2,300	4,685.00	10,775,500	
黒崎播磨	1,400	8,370.00	11,718,000	貸付株式数 300株
ニッカトー	4,600	1,317.00	6,058,200	
フジミインコーポレーテッド	5,700	2,865.00	16,330,500	
ニチアス	33,000	1,440.00	47,520,000	
新日鐵住金	255,500	2,151.50	549,708,250	
神戸製鋼所	104,000	898.00	93,392,000	
中山製鋼所	9,000	689.00	6,201,000	
合同製鐵	3,900	2,254.00	8,790,600	
JFEホールディングス	155,000	2,364.50	366,497,500	
日新製鋼	16,200	1,497.00	24,251,400	
東京製鐵	31,600	842.00	26,607,200	貸付株式数 200株
共英製鋼	6,700	1,966.00	13,172,200	
大和工業	12,200	3,080.00	37,576,000	
東京鐵鋼	5,000	1,726.00	8,630,000	貸付株式数 600株
大阪製鐵	3,900	2,023.00	7,889,700	
淀川製鋼所	7,100	2,582.00	18,332,200	
丸一鋼管	20,300	3,295.00	66,888,500	
大同特殊鋼	9,800	4,995.00	48,951,000	
日本高周波	8,000	756.00	6,048,000	貸付株式数 1,500株
日本冶金工	53,600	329.00	17,634,400	
山陽特殊製鋼	6,900	2,524.00	17,415,600	
愛知製鋼	2,700	3,950.00	10,665,000	
日立金属	60,800	1,259.00	76,547,200	貸付株式数 15,300株
日本金属	2,800	1,598.00	4,474,400	
大平洋金属	3,900	3,545.00	13,825,500	貸付株式数 800株
新日本電工	38,900	278.00	10,814,200	貸付株式数 10,200株

栗本鉄工所	4,300	1,767.00	7,598,100	貸付株式数	100株
日本製鋼所	19,200	2,645.00	50,784,000		
三菱製鋼	5,200	2,091.00	10,873,200		
日本精線	1,700	3,960.00	6,732,000		
大紀アルミニウム	12,700	728.00	9,245,600	貸付株式数	3,200株
日本軽金属HD	166,000	238.00	39,508,000		
三井金属	15,500	2,897.00	44,903,500		
東邦亜鉛	3,500	3,720.00	13,020,000		
三菱マテリアル	36,700	2,988.00	109,659,600		
住友鉱山	73,400	3,500.00	256,900,000		
DOWAホールディングス	14,200	3,235.00	45,937,000	貸付株式数	3,900株
古河機金	9,900	1,549.00	15,335,100		
大阪チタニウム	7,100	1,600.00	11,360,000	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
東邦チタニウム	12,100	1,126.00	13,624,600	貸付株式数	3,000株
UACJ	8,600	2,450.00	21,070,000	貸付株式数	2,200株
古河電工	19,100	3,580.00	68,378,000		
住友電工	213,000	1,663.00	354,219,000		
フジクラ	67,300	601.00	40,447,300		
昭和電線HLDGS	11,200	764.00	8,556,800		
タツタ電線	13,800	601.00	8,293,800		
リョービ	7,400	4,095.00	30,303,000		
アーエステイ	9,300	823.00	7,653,900		
アサヒHD	10,400	2,029.00	21,101,600		
東洋製罐グループHD	36,200	2,064.00	74,716,800		
ホッカンホールディングス	20,000	422.00	8,440,000		
横河ブリッジHLDGS	11,300	2,461.00	27,809,300		
OSJBHD	38,100	295.00	11,239,500		
駒井ハルテック	4,300	2,332.00	10,027,600		
三和ホールディングス	55,200	1,295.00	71,484,000		
文化シャツタ-	18,000	802.00	14,436,000		
三協立山	8,400	1,330.00	11,172,000	貸付株式数	1,300株
アルインコ	8,700	1,050.00	9,135,000		
LIXILグループ	84,500	2,083.00	176,013,500	貸付株式数	23,400株
日本ファイルコン	13,500	567.00	7,654,500	貸付株式数	2,100株
ノーリツ	12,200	1,651.00	20,142,200		
長府製作所	5,900	2,427.00	14,319,300		
リンナイ	10,200	7,990.00	81,498,000		
ユニプレス	10,900	2,016.00	21,974,400		
岡部	13,400	1,007.00	13,493,800		

ジーテクト	7,000	1,745.00	12,215,000	
東 プ レ	10,500	2,597.00	27,268,500	
高周波熱錬	12,300	1,034.00	12,718,200	
東京製綱	5,400	1,440.00	7,776,000	貸付株式数 1,400株
パイオラックス	8,900	2,343.00	20,852,700	
エイチワン	6,500	1,264.00	8,216,000	
日本発条	56,200	1,153.00	64,798,600	貸付株式数 15,300株
三浦工業	25,200	3,135.00	79,002,000	
タ ク マ	19,800	1,293.00	25,601,400	貸付株式数 5,000株
テクノプロ・ホールディング	10,800	6,700.00	72,360,000	
イー・ガーディアン	3,600	2,614.00	9,410,400	貸付株式数 800株
ジャパンマテリアル	16,800	1,454.00	24,427,200	貸付株式数 2,400株
ベクトル	7,600	2,346.00	17,829,600	貸付株式数 1,900株
アサンテ	4,700	2,338.00	10,988,600	貸付株式数 1,000株
N・フィールド	4,800	1,750.00	8,400,000	貸付株式数 1,000株
M&Aキャピタルパートナー	1,700	6,380.00	10,846,000	貸付株式数 400株
エスクローA J	12,700	413.00	5,245,100	
日本ビューホテル	8,200	1,292.00	10,594,400	
リクルートホールディングス	430,800	3,411.00	1,469,458,800	
ツ ガ ミ	17,000	1,105.00	18,785,000	
オークマ	6,500	5,920.00	38,480,000	
東芝機械	34,000	494.00	16,796,000	
アマダホールディングス	84,800	1,130.00	95,824,000	
アイダエンジニア	14,100	934.00	13,169,400	
滝澤鉄工所	4,300	1,676.00	7,206,800	
F U J I	17,400	1,772.00	30,832,800	貸付株式数 4,700株
牧野フライス	28,000	922.00	25,816,000	
オーエスジー	27,700	2,455.00	68,003,500	
旭ダイヤモンド	18,900	774.00	14,628,600	貸付株式数 5,200株
D M G 森精機	35,500	1,736.00	61,628,000	貸付株式数 9,700株
ソディック	13,200	1,021.00	13,477,200	貸付株式数 3,500株
ディスコ	7,800	18,040.00	140,712,000	
日東工器	4,000	2,483.00	9,932,000	
パンチ工業	7,300	830.00	6,059,000	貸付株式数 1,800株
日本郵政	314,400	1,308.00	411,235,200	
ベルシステム24HLDGS	10,600	1,739.00	18,433,400	
ソラスト	12,100	1,239.00	14,991,900	
豊田自動織機	46,400	6,020.00	279,328,000	
豊和工業	4,900	916.00	4,488,400	貸付株式数 900株 (900株)

OKK	5,600	1,054.00	5,902,400	
石川製作所	2,400	1,540.00	3,696,000	貸付株式数 400株
東洋機械金属	9,700	705.00	6,838,500	
島精機製作所	7,400	4,795.00	35,483,000	貸付株式数 2,000株 (100株)
オプトラン	5,800	2,963.00	17,185,400	貸付株式数 1,500株
ヤマシンフィルタ	10,200	913.00	9,312,600	貸付株式数 2,500株 (1,700株)
日阪製作所	10,100	1,086.00	10,968,600	
やまびこ	11,100	1,274.00	14,141,400	
平田機工	2,300	8,090.00	18,607,000	貸付株式数 600株
ナブテスコ	31,500	2,756.00	86,814,000	
三井海洋開発	6,300	3,285.00	20,695,500	
レオン自動機	6,100	1,875.00	11,437,500	
S M C	18,300	33,240.00	608,292,000	
ホソカワミクロン	2,300	6,030.00	13,869,000	
ユニオンツール	2,900	3,720.00	10,788,000	
オイレス工業	7,700	2,277.00	17,532,900	
日精エーエスビー	1,900	4,700.00	8,930,000	貸付株式数 400株
サト - ホールディングス	7,900	3,525.00	27,847,500	貸付株式数 2,100株
技研製作所	4,900	2,503.00	12,264,700	貸付株式数 1,200株
日精樹脂工業	6,800	1,119.00	7,609,200	
小松製作所	280,900	3,004.00	843,823,600	
住友重機械	32,300	3,550.00	114,665,000	
日立建機	27,200	3,180.00	86,496,000	
巴工業	4,300	2,255.00	9,696,500	
井関農機	6,100	1,881.00	11,474,100	
T O W A	5,900	1,038.00	6,124,200	貸付株式数 1,400株
丸山製作所	3,800	1,705.00	6,479,000	
北川鉄工所	3,900	2,831.00	11,040,900	
シンニッタン	17,300	475.00	8,217,500	
ローツェ	3,400	2,087.00	7,095,800	貸付株式数 900株
クボタ	311,600	1,675.50	522,085,800	貸付株式数 86,500株
東洋エンジニア	11,600	941.00	10,915,600	貸付株式数 3,100株 (900株)
三菱化工機	4,300	1,811.00	7,787,300	貸付株式数 100株
月島機械	11,700	1,407.00	16,461,900	
帝国電機製作所	6,500	1,551.00	10,081,500	
新東工業	13,300	1,034.00	13,752,200	
渋谷工業	5,600	4,075.00	22,820,000	

アイチ コーポレーション	9,900	607.00	6,009,300	貸付株式数	1,400株
小森コーポレーション	13,700	1,299.00	17,796,300		
鶴見製作所	5,500	1,790.00	9,845,000	貸付株式数	300株
住友精密	24,000	380.00	9,120,000		
酒井重工業	1,600	3,140.00	5,024,000		
荏原製作所	26,000	3,630.00	94,380,000		
西島製作所	7,400	1,008.00	7,459,200		
北越工業	8,400	1,197.00	10,054,800		
千代田化工建	43,100	773.00	33,316,300	貸付株式数	8,200株
ダイキン工業	79,600	13,815.00	1,099,674,000		
オルガノ	2,800	3,115.00	8,722,000		
ト - ヨ - カネツ	3,000	3,040.00	9,120,000		
栗田工業	31,000	3,150.00	97,650,000		
椿本チエイン	33,000	953.00	31,449,000		
日 機 装	19,300	1,234.00	23,816,200		
新興プランテック	13,400	1,008.00	13,507,200		
アネスト岩田	11,100	1,053.00	11,688,300		
ダイフク	30,000	5,250.00	157,500,000		
加藤製作所	3,400	3,270.00	11,118,000		
油研工業	3,100	2,214.00	6,863,400		
タダノ	27,700	1,139.00	31,550,300		
フジテック	17,400	1,452.00	25,264,800		
C K D	16,700	1,439.00	24,031,300		
キトー	5,100	2,018.00	10,291,800		
平和	18,000	2,681.00	48,258,000		
理想科学工業	6,100	2,731.00	16,659,100		
S A N K Y O	13,900	4,305.00	59,839,500	貸付株式数	1,800株
日本金銭機械	6,500	1,290.00	8,385,000	貸付株式数	1,800株
マースエンジニアリング	3,800	2,286.00	8,686,800	貸付株式数	1,100株
福島工業	3,800	5,170.00	19,646,000		
ダイコク電機	3,800	1,763.00	6,699,400		
竹内製作所	9,800	2,720.00	26,656,000		
ア マ ノ	18,100	2,290.00	41,449,000		
J U K I	9,200	1,258.00	11,573,600		
サンデンホールディングス	8,300	1,331.00	11,047,300	貸付株式数	2,100株
ブラザー工業	70,100	2,126.00	149,032,600	貸付株式数	16,200株
マックス	9,000	1,544.00	13,896,000		
モリタホールディングス	9,700	2,350.00	22,795,000		
グローリー	16,800	2,770.00	46,536,000		
新晃工業	6,800	1,674.00	11,383,200		

大和冷機工業	9,000	1,162.00	10,458,000	
セガサミーホールディングス	57,200	1,764.00	100,900,800	
日本ピストンリング	4,500	2,232.00	10,044,000	
リケン	2,800	5,730.00	16,044,000	
T P R	6,400	2,636.00	16,870,400	
ツバキ・ナカシマ	9,200	2,092.00	19,246,400	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,100	10,350.00	176,985,000	
大豊工業	5,900	1,155.00	6,814,500	
日本精工	117,900	1,206.00	142,187,400	貸付株式数 33,100株 (33,100株)
N T N	128,000	427.00	54,656,000	
ジェイテクト	59,500	1,470.00	87,465,000	
不二越	5,500	4,990.00	27,445,000	貸付株式数 1,400株
ミネベアミツミ	107,800	2,001.00	215,707,800	
日本トムソン	20,800	719.00	14,955,200	貸付株式数 5,400株
T H K	36,200	2,691.00	97,414,200	
ユーシン精機	6,500	1,133.00	7,364,500	
イーグル工業	6,700	1,492.00	9,996,400	
日本ピラ - 工業	7,300	1,545.00	11,278,500	貸付株式数 600株
キッツ	24,600	948.00	23,320,800	
日立	1,392,000	700.60	975,235,200	
三菱電機	580,600	1,438.00	834,902,800	
富士電機	176,000	877.00	154,352,000	
東洋電機製造	4,300	1,574.00	6,768,200	貸付株式数 600株
安川電機	68,000	3,270.00	222,360,000	貸付株式数 900株
シンフォニアテクノロジー	41,000	359.00	14,719,000	貸付株式数 10,000株
明電舎	49,000	364.00	17,836,000	
オリジン電気	3,500	1,648.00	5,768,000	貸付株式数 600株
山洋電気	2,900	5,430.00	15,747,000	
デンヨー	5,900	1,805.00	10,649,500	
三桜工業	11,300	648.00	7,322,400	
マキタ	75,600	4,895.00	370,062,000	
東芝テック	41,000	682.00	27,962,000	
マブチモーター	15,500	4,310.00	66,805,000	
日本電産	70,100	15,670.00	1,098,467,000	
東光高岳	4,200	1,668.00	7,005,600	貸付株式数 1,000株
ダブル・スコープ	9,500	1,039.00	9,870,500	貸付株式数 2,400株 (900株)
ダイヘン	33,000	576.00	19,008,000	

ヤーマン	9,100	1,707.00	15,533,700	貸付株式数 2,400株 (100株)
JVCケンウッド	49,100	309.00	15,171,900	貸付株式数 12,800株
第一精工	3,400	1,531.00	5,205,400	
日新電機	13,400	949.00	12,716,600	
大崎電気	14,300	779.00	11,139,700	貸付株式数 3,900株
オムロン	61,400	4,650.00	285,510,000	貸付株式数 4,200株
日東工業	10,600	1,837.00	19,472,200	
I D E C	8,000	2,233.00	17,864,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	104,000	523.00	54,392,000	
メルコホールディングス	3,100	4,070.00	12,617,000	貸付株式数 800株
日本電気	74,100	3,005.00	222,670,500	貸付株式数 20,600株 (20,600株)
富士通	599,000	800.10	479,259,900	
沖電気	22,200	1,358.00	30,147,600	
電気興業	4,100	3,175.00	13,017,500	
サンケン電気	36,000	578.00	20,808,000	
アイホン	5,700	1,616.00	9,211,200	貸付株式数 700株
ルネサスエレクトロニクス	61,900	744.00	46,053,600	
セイコーエプソン	85,600	1,821.00	155,877,600	
ワコム	47,600	477.00	22,705,200	貸付株式数 12,500株
アルバック	13,500	4,090.00	55,215,000	
E I Z O	5,500	4,715.00	25,932,500	
ジャパンディスプレイ	124,600	149.00	18,565,400	貸付株式数 30,400株 (30,400株)
日本信号	16,200	1,085.00	17,577,000	
京三製作所	16,600	611.00	10,142,600	貸付株式数 700株
能美防災	8,600	2,312.00	19,883,200	貸付株式数 2,200株
ホーチキ	5,300	1,553.00	8,230,900	
エレコム	5,700	2,813.00	16,034,100	
パナソニック	663,100	1,273.50	844,457,850	
シャープ	58,000	2,410.00	139,780,000	貸付株式数 15,000株
アンリツ	42,900	1,743.00	74,774,700	
富士通ゼネラル	17,900	1,822.00	32,613,800	貸付株式数 4,900株
ソニー	390,100	6,230.00	2,430,323,000	
T D K	30,600	12,060.00	369,036,000	
帝国通信工業	6,900	1,238.00	8,542,200	貸付株式数 100株
タムラ製作所	24,700	760.00	18,772,000	
アルプス電気	50,100	3,260.00	163,326,000	
池上通信機	48,000	139.00	6,672,000	

パイオニア	118,600	123.00	14,587,800	貸付株式数	28,600株
日本電波工業	12,800	472.00	6,041,600	貸付株式数	3,500株
日本トリム	1,700	5,450.00	9,265,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,600	2,492.00	8,971,200		
フオスタ - 電機	7,700	1,388.00	10,687,600		
クラリオン	35,000	308.00	10,780,000		
S M K	20,000	315.00	6,300,000		
ヨコオ	4,900	1,410.00	6,909,000	貸付株式数	1,200株
ホシデン	15,000	1,052.00	15,780,000		
ヒロセ電機	9,400	12,290.00	115,526,000		
日本航空電子	15,000	2,002.00	30,030,000		
T O A	8,500	1,176.00	9,996,000		
マクセルホールディングス	11,500	1,740.00	20,010,000		
古野電気	8,300	1,340.00	11,122,000		
ユニデンホールディングス	23,000	273.00	6,279,000		
アルパイン	13,900	2,390.00	33,221,000		
スミダコーポレーション	6,000	1,338.00	8,028,000	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
アイコム	3,800	2,406.00	9,142,800		
リオン	3,700	2,173.00	8,040,100		
本多通信工業	7,300	788.00	5,752,400		
船井電機	10,000	637.00	6,370,000	貸付株式数	2,800株 (1,800株)
横河電機	58,200	2,196.00	127,807,200		
新電元工業	2,200	4,900.00	10,780,000		
アズビル	17,300	4,585.00	79,320,500		
日本光電工業	24,100	3,260.00	78,566,000		
共和電業	20,100	410.00	8,241,000		
堀場製作所	11,600	6,380.00	74,008,000	貸付株式数	3,200株 (3,100株)
アドバンテスト	32,800	2,446.00	80,228,800	貸付株式数	9,000株
エスペック	6,000	2,102.00	12,612,000		
キーエンス	28,600	59,450.00	1,700,270,000		
日置電機	3,400	3,675.00	12,495,000		
シスメックス	45,500	9,440.00	429,520,000		
日本マイクロニクス	10,800	788.00	8,510,400		
メガチップス	5,200	2,215.00	11,518,000	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
O B A R A G R O U P	3,300	4,950.00	16,335,000		

デンソー	129,100	5,225.00	674,547,500	
コーセル	8,700	1,223.00	10,640,100	
イリソ電子工業	4,900	5,590.00	27,391,000	貸付株式数 1,300株
オプテックスグループ	10,900	2,221.00	24,208,900	貸付株式数 2,800株
千代田インテグレ	3,200	2,274.00	7,276,800	
レーザーテック	12,500	3,870.00	48,375,000	
スタンレー電気	44,100	3,605.00	158,980,500	
岩崎電気	4,700	1,511.00	7,101,700	
ウシオ電機	32,100	1,423.00	45,678,300	
ヘリオステクノH	8,300	719.00	5,967,700	
日本セラミック	6,100	2,789.00	17,012,900	
古河電池	7,500	822.00	6,165,000	貸付株式数 1,400株 (1,000株)
山一電機	5,200	1,520.00	7,904,000	貸付株式数 1,200株
図 研	4,800	1,631.00	7,828,800	
日本電子	22,000	1,091.00	24,002,000	
カ シ オ	46,500	1,778.00	82,677,000	
ファナック	55,300	20,690.00	1,144,157,000	
日本シイエムケイ	11,700	759.00	8,880,300	貸付株式数 3,100株
エンプラス	2,900	3,090.00	8,961,000	貸付株式数 700株 (700株)
大真空	4,100	1,314.00	5,387,400	
ロ ム	26,100	9,500.00	247,950,000	
浜松ホトニクス	41,600	4,205.00	174,928,000	
三井ハイテック	8,500	1,383.00	11,755,500	貸付株式数 2,200株 (100株)
新光電気工業	22,100	927.00	20,486,700	
京 セ ラ	95,400	6,449.00	615,234,600	
太陽誘電	28,600	3,110.00	88,946,000	貸付株式数 7,000株
村田製作所	61,100	18,165.00	1,109,881,500	貸付株式数 4,800株 (4,800株)
ユーシン	15,500	759.00	11,764,500	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
双葉電子工業	9,200	2,022.00	18,602,400	
日東電工	43,700	8,084.00	353,270,800	
北陸電気工業	5,400	1,176.00	6,350,400	
東海理化電機	14,400	2,200.00	31,680,000	
ニチコン	18,900	1,105.00	20,884,500	
日本ケミコン	4,900	3,090.00	15,141,000	
K O A	8,400	2,002.00	16,816,800	

三井E & S H D	20,700	1,813.00	37,529,100	貸付株式数	200株
日立造船	42,000	438.00	18,396,000		
三菱重工業	96,500	4,048.00	390,632,000		
川崎重工業	44,200	2,948.00	130,301,600		
I H I	44,500	4,040.00	179,780,000		
名村造船所	19,200	503.00	9,657,600		
日本車輛	27,000	287.00	7,749,000	貸付株式数	7,000株
三菱ロジスネクスト	7,900	1,217.00	9,614,300	貸付株式数	800株
F P G	20,800	1,141.00	23,732,800	貸付株式数	3,500株
じもとホールディングス	67,900	169.00	11,475,100		
全国保証	16,400	4,300.00	70,520,000	貸付株式数	1,500株
めぶきフィナンシャルG	292,100	369.00	107,784,900		
東京きらぼしF G	7,800	2,358.00	18,392,400		
九州フィナンシャルG	89,700	525.00	47,092,500		
かんぼ生命保険	21,400	2,443.00	52,280,200		
ゆうちょ銀行	161,000	1,275.00	205,275,000		
富山第一銀行	21,300	443.00	9,435,900	貸付株式数	400株
コンコルディア・フィナンシャル	343,000	502.00	172,186,000		
西日本フィナンシャルH D	35,100	1,205.00	42,295,500		
アルヒ	7,300	2,687.00	19,615,100	貸付株式数	1,900株
日産自動車	685,200	1,021.00	699,589,200		
いすゞ自動車	168,700	1,580.50	266,630,350		
トヨタ自動車	707,500	6,596.00	4,666,670,000		
日野自動車	82,400	1,097.00	90,392,800		
三菱自動車工業	215,100	741.00	159,389,100		
エフテック	6,000	1,183.00	7,098,000		
武蔵精密工業	6,600	3,715.00	24,519,000	貸付株式数	1,700株
日産車体	22,200	988.00	21,933,600	貸付株式数	600株
新明和工業	25,400	1,304.00	33,121,600		
極東開発工業	11,200	1,653.00	18,513,600		
日信工業	11,600	1,789.00	20,752,400	貸付株式数	2,400株
トピー工業	4,900	2,822.00	13,827,800		
ティラド	2,600	2,825.00	7,345,000		
曙ブレーキ	34,900	239.00	8,341,100	貸付株式数	8,700株 (100株)
タチエス	10,400	1,715.00	17,836,000		
N O K	28,700	1,935.00	55,534,500	貸付株式数	7,800株
フタバ産業	18,700	692.00	12,940,400		
K Y B	6,000	4,255.00	25,530,000		

市光工業	10,100	912.00	9,211,200	
大同メタル工業	9,000	909.00	8,181,000	貸付株式数 2,300株
プレス工業	32,600	534.00	17,408,400	
太平洋工業	12,800	1,697.00	21,721,600	
ケーヒン	13,300	2,164.00	28,781,200	貸付株式数 1,000株
河西工業	8,100	1,168.00	9,460,800	
アイシン精機	47,800	4,975.00	237,805,000	
マ ッ ダ	178,700	1,232.00	220,158,400	
今仙電機製作所	8,300	1,070.00	8,881,000	
本田技研	522,500	3,173.00	1,657,892,500	
スズキ	115,800	7,091.00	821,137,800	
S U B A R U	180,400	3,089.00	557,255,600	
安永	3,500	1,905.00	6,667,500	貸付株式数 900株
ヤマハ発動機	81,700	2,733.00	223,286,100	貸付株式数 22,700株
ショーワ	15,900	1,593.00	25,328,700	
小糸製作所	35,100	6,380.00	223,938,000	
T B K	20,800	478.00	9,942,400	貸付株式数 1,700株
エクセディ	6,700	3,330.00	22,311,000	
ミツバ	11,400	902.00	10,282,800	
豊田合成	20,700	2,626.00	54,358,200	
愛三工業	11,100	896.00	9,945,600	
ヨ ロ ズ	6,900	1,640.00	11,316,000	
エフ・シー・シー	9,800	3,270.00	32,046,000	
シマノ	23,500	17,070.00	401,145,000	貸付株式数 5,800株
テイ・エス テック	13,500	3,925.00	52,987,500	
関西みらいF G	26,500	960.00	25,440,000	
3 3 F G	5,000	2,167.00	10,835,000	
ジャムコ	3,200	3,020.00	9,664,000	貸付株式数 900株 (900株)
小 野 建	5,800	1,723.00	9,993,400	貸付株式数 1,500株 (1,400株)
ノ ジ マ	10,600	2,386.00	25,291,600	
佐鳥電機	7,500	954.00	7,155,000	
伯東	4,300	1,560.00	6,708,000	
コンドーテック	10,400	1,058.00	11,003,200	
ライトオン	7,800	1,010.00	7,878,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,400	2,532.00	21,268,800	
三菱食品	5,800	2,908.00	16,866,400	
良品計画	7,600	31,700.00	240,920,000	

松田産業	5,500	1,524.00	8,382,000	貸付株式数	200株
第一興商	8,400	5,060.00	42,504,000		
メディパルHD	56,000	2,163.00	121,128,000		
アドヴァン	7,400	1,003.00	7,422,200	貸付株式数	600株 (600株)
萩原電気HLDGS	2,900	3,115.00	9,033,500		
アルビス	2,500	3,045.00	7,612,500		
アズワン	4,700	7,920.00	37,224,000		
ドウシシャ	6,500	2,167.00	14,085,500		
小津産業	5,500	1,975.00	10,862,500	貸付株式数	1,500株
コジマ	13,100	463.00	6,065,300		
コーナン商事	8,800	2,620.00	23,056,000		
ネットワンシステムズ	24,200	2,474.00	59,870,800		
ワタミ	8,200	1,264.00	10,364,800	貸付株式数	2,200株
ドンキホーテホールディング	37,400	5,360.00	200,464,000		
丸文	7,000	824.00	5,768,000		
西松屋チェーン	12,900	1,173.00	15,131,700	貸付株式数	3,600株
ゼンショーホールディングス	30,400	2,201.00	66,910,400	貸付株式数	8,300株
ハピネット	5,300	1,734.00	9,190,200		
幸楽苑ホールディングス	5,900	1,616.00	9,534,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
日本ライフライン	16,700	2,124.00	35,470,800	貸付株式数	4,500株
サイゼリヤ	9,400	2,165.00	20,351,000	貸付株式数	2,600株
エクセル	3,400	1,865.00	6,341,000		
V Tホールディングス	21,200	484.00	10,260,800		
マルカキカイ	3,900	2,015.00	7,858,500		
アルゴグラフィックス	3,300	4,355.00	14,371,500		
IDOM	21,000	357.00	7,497,000		
ポプラ	10,400	623.00	6,479,200	貸付株式数	3,200株
ユナイテッドアローズ	7,200	4,130.00	29,736,000	貸付株式数	1,900株 (1,900株)
進和	4,400	2,108.00	9,275,200		
ダイトロン	4,100	1,957.00	8,023,700		
ハイデイ日高	8,000	2,205.00	17,640,000		
シークス	7,400	2,051.00	15,177,400	貸付株式数	2,000株
コロワイド	19,800	3,020.00	59,796,000	貸付株式数	5,400株
ピーシーデポコーポ	11,200	512.00	5,734,400	貸付株式数	700株 (500株)
壱番屋	4,300	4,545.00	19,543,500	貸付株式数	1,200株
スギホールディングス	12,500	5,360.00	67,000,000		

島津製作所	69,900	3,220.00	225,078,000	
長野計器	7,400	1,155.00	8,547,000	
ブイ・テクノロジー	1,400	17,430.00	24,402,000	貸付株式数 300株
スター精密	10,200	1,900.00	19,380,000	貸付株式数 2,700株
東京計器	5,200	1,127.00	5,860,400	貸付株式数 1,400株 (1,300株)
東京精密	10,200	3,005.00	30,651,000	
マニー	7,300	4,825.00	35,222,500	
ニコン	101,000	2,013.00	203,313,000	
トプコン	30,700	1,819.00	55,843,300	
オリンパス	86,500	4,295.00	371,517,500	
理研計器	6,100	2,251.00	13,731,100	
S C R E E Nホールディングス	11,100	7,280.00	80,808,000	
キヤノン電子	4,600	2,250.00	10,350,000	
タムロン	5,900	2,271.00	13,398,900	貸付株式数 100株
H O Y A	117,200	6,347.00	743,868,400	
ノーリツ鋼機	6,700	2,849.00	19,088,300	貸付株式数 1,700株 (1,000株)
エー・アンド・デイ	8,200	878.00	7,199,600	
キヤノン	311,500	3,389.00	1,055,673,500	貸付株式数 86,400株
リ コ ー	175,300	1,138.00	199,491,400	
シチズン時計	66,700	704.00	46,956,800	貸付株式数 12,800株
リズム時計	5,000	2,022.00	10,110,000	貸付株式数 600株
メニコン	8,500	2,477.00	21,054,500	
パラマウントベッドHD	6,000	4,925.00	29,550,000	
S H O B I	14,000	400.00	5,600,000	貸付株式数 3,000株
ニホンフラッシュ	3,600	2,257.00	8,125,200	
前田工織	8,100	2,097.00	16,985,700	
アートネイチャー	10,700	697.00	7,457,900	
バンダイナムコHLDGS	60,300	4,320.00	260,496,000	
S H O E I	3,200	4,535.00	14,512,000	
マーベラス	9,900	866.00	8,573,400	貸付株式数 2,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,100	6,010.00	60,701,000	
萩原工業	5,400	1,849.00	9,984,600	貸付株式数 1,400株
エイベックス	10,800	1,460.00	15,768,000	
トッパン・フォームズ	12,300	1,070.00	13,161,000	
フジシールインターナショナル	13,000	3,775.00	49,075,000	

タカラトミー	25,600	1,090.00	27,904,000	
レック	3,700	5,190.00	19,203,000	
大建工業	5,400	2,208.00	11,923,200	
凸版印刷	156,000	852.00	132,912,000	
大日本印刷	74,900	2,515.00	188,373,500	
共同印刷	3,300	2,796.00	9,226,800	
N I S S H A	12,400	2,141.00	26,548,400	貸付株式数 3,300株 (2,700株)
藤森工業	4,900	3,340.00	16,366,000	
ヴィア・ホールディングス	13,400	718.00	9,621,200	貸付株式数 3,700株
宝印刷	7,200	1,749.00	12,592,800	
アシックス	57,600	1,568.00	90,316,800	貸付株式数 16,000株
ジェイ エス ピー	3,800	2,779.00	10,560,200	貸付株式数 1,000株
ニチハ	9,000	3,095.00	27,855,000	
エフピコ	4,900	6,430.00	31,507,000	貸付株式数 1,300株
ヤマハ	38,400	5,410.00	207,744,000	
河合楽器	2,600	4,340.00	11,284,000	貸付株式数 600株
クリナップ	9,700	770.00	7,469,000	貸付株式数 2,000株
ピジョン	35,200	5,550.00	195,360,000	
天馬	5,200	1,899.00	9,874,800	貸付株式数 200株
キングジム	9,500	950.00	9,025,000	
象印マホービン	11,400	1,526.00	17,396,400	
リンテック	13,200	2,892.00	38,174,400	
信越ポリマー	12,100	890.00	10,769,000	
東リ	24,600	354.00	8,708,400	貸付株式数 1,300株
イトーキ	15,400	601.00	9,255,400	貸付株式数 4,400株
任天堂	35,900	38,530.00	1,383,227,000	
三菱鉛筆	9,300	1,900.00	17,670,000	
タカラスタンダ-ド	12,000	1,819.00	21,828,000	貸付株式数 2,200株
コクヨ	27,900	1,928.00	53,791,200	
ナカバヤシ	12,600	648.00	8,164,800	
ニフコ	20,700	2,935.00	60,754,500	
立川ブラインド	4,800	1,154.00	5,539,200	貸付株式数 400株
グローブライド	3,300	3,130.00	10,329,000	
オカムラ	20,700	1,446.00	29,932,200	
日本バルカー	5,200	3,025.00	15,730,000	
伊藤忠	420,600	1,943.50	817,436,100	
丸紅	469,900	912.50	428,783,750	
スクロール	16,600	744.00	12,350,400	貸付株式数 3,300株
高島	4,200	2,053.00	8,622,600	貸付株式数 900株

ヨンドシーホールディングス	6,000	2,297.00	13,782,000	貸付株式数	1,200株
三陽商会	4,400	1,996.00	8,782,400	貸付株式数	1,200株
長瀬産業	31,700	1,780.00	56,426,000		
蝶理	4,300	1,962.00	8,436,600		
豊田通商	62,700	3,665.00	229,795,500		
オンワードホールディングス	36,500	698.00	25,477,000		
兼松	24,500	1,615.00	39,567,500		
美津濃	6,100	2,835.00	17,293,500		
ツカモトコーポレーション	6,100	1,195.00	7,289,500	貸付株式数	200株
ユニー・ファミリーマートHD	18,600	9,760.00	181,536,000	貸付株式数	5,100株
三井物産	471,800	1,799.50	849,004,100		
日本紙パルプ	2,700	4,360.00	11,772,000		
東京エレクトロン	38,900	16,915.00	657,993,500	貸付株式数	10,800株
日立ハイテクノロジーズ	19,600	3,985.00	78,106,000		
カメイ	7,200	1,340.00	9,648,000		
スターゼン	2,600	4,535.00	11,791,000		
セイコーHD	9,400	2,953.00	27,758,200		
山善	22,100	1,239.00	27,381,900		
住友商事	360,100	1,766.50	636,116,650		
日本ユニシス	17,000	2,715.00	46,155,000		
内田洋行	3,300	2,977.00	9,824,100	貸付株式数	900株
三菱商事	402,500	3,117.00	1,254,592,500		
第一実業	3,200	3,575.00	11,440,000	貸付株式数	100株
キヤノンマーケティングJPN	16,600	2,267.00	37,632,200		
西華産業	4,200	1,946.00	8,173,200		
菱洋エレクトロ	6,000	1,703.00	10,218,000		
ユアサ商事	5,400	3,835.00	20,709,000		
神鋼商事	2,000	3,080.00	6,160,000		
阪和興業	10,500	3,600.00	37,800,000		
正栄食品	3,400	3,865.00	13,141,000		
カナデン	7,100	1,130.00	8,023,000		
菱電商事	5,300	1,628.00	8,628,400		
ニプロ	40,400	1,474.00	59,549,600		
岩谷産業	12,500	3,880.00	48,500,000	貸付株式数	3,400株
すてきなイスグループ	8,100	1,241.00	10,052,100	貸付株式数	1,700株
極東貿易	19,000	386.00	7,334,000		
イワキ	13,300	494.00	6,570,200		
兼松エレクトロニクス	3,900	3,535.00	13,786,500		

三愛石油	14,600	1,347.00	19,666,200	
稲畑産業	13,700	1,621.00	22,207,700	
ゴ-ルドウイン	3,700	6,920.00	25,604,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ユニ・チャ-ム	123,700	3,636.00	449,773,200	貸付株式数 34,300株
デサント	14,300	2,010.00	28,743,000	貸付株式数 3,900株
ワキタ	12,900	1,313.00	16,937,700	
東邦ホールディングス	15,700	2,870.00	45,059,000	貸付株式数 4,300株
サンゲツ	16,700	2,111.00	35,253,700	
ミツウロコグループ	8,700	767.00	6,672,900	
シナネンホールディングス	2,400	2,623.00	6,295,200	
伊藤忠エネクス	10,400	1,047.00	10,888,800	
サンリオ	16,000	2,248.00	35,968,000	貸付株式数 4,600株
サンワテクノス	5,400	1,431.00	7,727,400	
リョ-サン	6,200	4,180.00	25,916,000	
新光商事	7,300	1,626.00	11,869,800	
トーホ-	4,500	2,126.00	9,567,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
三信電気	5,900	1,893.00	11,168,700	
東陽テクニカ	11,500	897.00	10,315,500	
モスフードサービス	7,200	2,953.00	21,261,600	貸付株式数 2,000株
加賀電子	5,000	2,111.00	10,555,000	
三益半導体	5,300	1,717.00	9,100,100	
木曽路	7,400	2,643.00	19,558,200	貸付株式数 2,000株
千趣会	14,400	440.00	6,336,000	貸付株式数 4,200株
タカキュー	35,600	202.00	7,191,200	貸付株式数 4,400株
ケーヨー	12,900	531.00	6,849,900	
上新電機	7,000	2,859.00	20,013,000	
日本瓦斯	11,000	5,220.00	57,420,000	
ロイヤルホールディングス	10,400	2,739.00	28,485,600	
いなげや	6,700	1,589.00	10,646,300	貸付株式数 1,900株
島忠	13,000	3,590.00	46,670,000	
チヨダ	6,900	2,133.00	14,717,700	
ライフコーポレーション	4,000	2,662.00	10,648,000	
リンガーハット	7,900	2,363.00	18,667,700	貸付株式数 2,200株 (1,700株)
MrMaxHD	10,700	565.00	6,045,500	貸付株式数 100株
AOKIホールディングス	11,100	1,467.00	16,283,700	貸付株式数 3,100株
オークワ	10,000	1,079.00	10,790,000	
コメリ	8,200	2,638.00	21,631,600	

青山商事	10,200	3,300.00	33,660,000	貸付株式数	2,800株
しまむら	6,800	10,040.00	68,272,000		
高島屋	43,500	1,802.00	78,387,000		
松屋	12,700	1,138.00	14,452,600	貸付株式数	1,600株
エイチ・ツー・オーリテイリング	25,900	1,654.00	42,838,600		
丸井グループ	53,300	2,483.00	132,343,900		
クレディセゾン	42,600	1,737.00	73,996,200		
アクシアルリテイリング	5,000	3,765.00	18,825,000		
イオン	222,500	2,408.00	535,780,000	貸付株式数	61,400株
イズミ	10,400	7,000.00	72,800,000		
平和堂	11,700	2,859.00	33,450,300		
フジ	7,200	2,146.00	15,451,200	貸付株式数	400株
ヤオコー	6,700	6,320.00	42,344,000		
ゼビオホールディングス	7,000	1,595.00	11,165,000		
ケースホールディングス	50,800	1,339.00	68,021,200	貸付株式数	13,000株 (13,000株)
PALTA C	8,300	5,600.00	46,480,000		
新生銀行	46,300	1,655.00	76,626,500	貸付株式数	400株
あおぞら銀行	33,700	3,830.00	129,071,000		
三菱UFJフィナンシャルG	3,995,400	668.20	2,669,726,280		
りそなホールディングス	630,500	600.10	378,363,050		
三井住友トラストHD	112,400	4,327.00	486,354,800		
三井住友フィナンシャルG	431,800	4,311.00	1,861,489,800		
第四銀行	6,500	4,440.00	28,860,000		
北越銀行	5,900	2,242.00	13,227,800		
千葉銀行	201,700	672.00	135,542,400		
群馬銀行	107,200	535.00	57,352,000		
武蔵野銀行	8,000	3,030.00	24,240,000		
千葉興業銀行	23,700	463.00	10,973,100		
筑波銀行	39,200	267.00	10,466,400		
七十七銀行	16,800	2,485.00	41,748,000		
青森銀行	4,600	3,215.00	14,789,000	貸付株式数	1,300株
秋田銀行	4,000	2,767.00	11,068,000		
山形銀行	6,500	2,448.00	15,912,000	貸付株式数	1,700株 (1,600株)
岩手銀行	4,000	4,905.00	19,620,000	貸付株式数	900株
東邦銀行	49,000	414.00	20,286,000	貸付株式数	4,100株
東北銀行	10,400	1,344.00	13,977,600		
ふくおかフィナンシャルG	234,000	592.00	138,528,000		

静岡銀行	140,300	915.00	128,374,500	
十六銀行	6,800	2,785.00	18,938,000	
スルガ銀行	59,600	569.00	33,912,400	貸付株式数 16,300株
八十二銀行	94,100	467.00	43,944,700	貸付株式数 22,300株
山梨中央銀行	37,000	387.00	14,319,000	
大垣共立銀行	8,100	2,806.00	22,728,600	
福井銀行	5,400	2,207.00	11,917,800	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
北國銀行	6,400	4,215.00	26,976,000	
清水銀行	4,100	2,071.00	8,491,100	貸付株式数 300株 (300株)
滋賀銀行	46,000	550.00	25,300,000	
南都銀行	6,000	2,747.00	16,482,000	
百五銀行	50,700	443.00	22,460,100	
京都銀行	21,500	5,260.00	113,090,000	
紀陽銀行	20,600	1,657.00	34,134,200	
ほくほくフィナンシャルG	34,900	1,475.00	51,477,500	
広島銀行	77,400	732.00	56,656,800	
山陰合同銀行	32,900	917.00	30,169,300	
中国銀行	35,200	1,145.00	40,304,000	貸付株式数 9,700株
伊予銀行	75,800	698.00	52,908,400	
百十四銀行	56,000	325.00	18,200,000	
四国銀行	9,300	1,271.00	11,820,300	
阿波銀行	43,000	704.00	30,272,000	
大分銀行	3,300	3,805.00	12,556,500	貸付株式数 900株
宮崎銀行	4,100	3,145.00	12,894,500	
佐賀銀行	4,200	2,269.00	9,529,800	
十八銀行	42,000	349.00	14,658,000	
沖縄銀行	5,400	4,065.00	21,951,000	
琉球銀行	12,000	1,322.00	15,864,000	貸付株式数 3,300株
セブン銀行	214,000	346.00	74,044,000	
みずほフィナンシャルG	7,789,800	192.00	1,495,641,600	
高知銀行	11,900	1,074.00	12,780,600	
山口フィナンシャルG	67,300	1,205.00	81,096,500	貸付株式数 18,700株
芙蓉総合リース	6,600	6,650.00	43,890,000	
興銀リース	10,700	2,880.00	30,816,000	
東京センチュリー	12,100	6,070.00	73,447,000	
SBIホールディングス	65,700	3,015.00	198,085,500	貸付株式数 18,000株
日本証券金融	24,200	608.00	14,713,600	

アイフル	101,700	323.00	32,849,100	貸付株式数 27,400株 (300株)
名古屋銀行	4,300	3,680.00	15,824,000	貸付株式数 1,200株
北洋銀行	82,700	361.00	29,854,700	
愛知銀行	2,000	4,780.00	9,560,000	
中京銀行	3,100	2,338.00	7,247,800	
大光銀行	5,000	1,977.00	9,885,000	
愛媛銀行	9,200	1,211.00	11,141,200	貸付株式数 2,500株
トマト銀行	9,300	1,417.00	13,178,100	
京葉銀行	40,000	463.00	18,520,000	
栃木銀行	32,200	370.00	11,914,000	
北日本銀行	4,300	2,550.00	10,965,000	
東和銀行	12,100	988.00	11,954,800	
福島銀行	18,000	687.00	12,366,000	
大東銀行	10,800	1,189.00	12,841,200	
リコーリース	4,200	3,575.00	15,015,000	
イオンフィナンシャルサービス	39,800	2,189.00	87,122,200	
アコム	118,200	449.00	53,071,800	
ジャックス	6,900	2,280.00	15,732,000	
オリコ	114,400	157.00	17,960,800	貸付株式数 33,900株
日立キャピタル	15,500	2,977.00	46,143,500	
アプラスフィナンシャル	56,300	104.00	5,855,200	貸付株式数 16,300株
オリックス	382,700	1,725.50	660,348,850	
三菱UFJリース	144,100	607.00	87,468,700	
ジャフコ	8,300	3,930.00	32,619,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
トモニホールディングス	46,400	454.00	21,065,600	
大和証券G本社	486,600	647.60	315,122,160	
野村ホールディングス	979,500	507.20	496,802,400	
岡三証券グループ	46,000	510.00	23,460,000	貸付株式数 12,000株
丸三証券	20,500	944.00	19,352,000	
東洋証券	38,000	234.00	8,892,000	
東海東京HD	61,900	618.00	38,254,200	
水戸証券	25,600	367.00	9,395,200	
いちよし証券	13,600	1,089.00	14,810,400	
松井証券	29,000	1,156.00	33,524,000	
SOMPOホールディングス	112,600	4,424.00	498,142,400	
日本取引所グループ	164,900	1,859.00	306,549,100	
マネックスG	63,000	515.00	32,445,000	貸付株式数 16,500株

カブドットコム証券	39,400	370.00	14,578,000	
極東証券	8,200	1,398.00	11,463,600	
岩井コスモホールディング	8,000	1,455.00	11,640,000	
藍澤証券	14,000	725.00	10,150,000	
フィデアホール	71,500	168.00	12,012,000	
池田泉州HD	57,100	385.00	21,983,500	
アニコムホールディングス	4,300	3,545.00	15,243,500	貸付株式数 1,100株
MS&AD	148,900	3,252.00	484,222,800	
SONY FH	47,600	2,172.00	103,387,200	
第一生命HLDGS	324,300	2,039.50	661,409,850	
東京海上HD	216,100	5,099.00	1,101,893,900	
イー・ギャランティ	9,800	1,083.00	10,613,400	貸付株式数 500株
NECキャピタルソリューション	4,000	1,891.00	7,564,000	
T&Dホールディングス	175,900	1,614.00	283,902,600	
アドバンスクリエイト	4,600	2,292.00	10,543,200	
三井不動産	287,200	2,444.50	702,060,400	
三菱地所	428,100	1,780.00	762,018,000	
平和不動産	10,600	1,873.00	19,853,800	
東京建物	61,300	1,290.00	79,077,000	貸付株式数 16,900株
ダイビル	14,600	1,142.00	16,673,200	
京阪神ビルディング	12,300	809.00	9,950,700	
住友不動産	138,000	3,746.00	516,948,000	
大京	9,000	2,192.00	19,728,000	
テオーシー	20,600	782.00	16,109,200	
レオパレス21	69,000	567.00	39,123,000	貸付株式数 18,900株
スターツコーポレーション	7,800	2,335.00	18,213,000	
フジ住宅	11,700	879.00	10,284,300	
空港施設	12,200	640.00	7,808,000	
ゴールドクレスト	4,700	1,815.00	8,530,500	
リログループ	31,000	3,035.00	94,085,000	
日本エスリード	3,900	1,499.00	5,846,100	
日神不動産	11,300	575.00	6,497,500	
日本エスコン	13,100	768.00	10,060,800	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
タカラレーベン	29,800	344.00	10,251,200	
サンヨーハウジ名古屋	10,100	1,098.00	11,089,800	
イオンモール	36,300	1,772.00	64,323,600	
カチタス	8,200	2,866.00	23,501,200	貸付株式数 2,200株
東祥	4,100	4,240.00	17,384,000	貸付株式数 1,000株

トーセイ	10,200	1,047.00	10,679,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	35,600	1,183.00	42,114,800	貸付株式数 9,500株 (9,500株)
サンフロンティア不動産	8,600	1,203.00	10,345,800	
エフ・ジェー・ネクスト	6,700	881.00	5,902,700	
グランディハウス	19,000	457.00	8,683,000	
東武鉄道	61,000	3,155.00	192,455,000	
相鉄ホールディングス	18,200	3,465.00	63,063,000	
東京急行	157,400	1,870.00	294,338,000	
京浜急行	79,600	1,866.00	148,533,600	
小田急電鉄	86,700	2,507.00	217,356,900	
京王電鉄	32,600	5,640.00	183,864,000	
京成電鉄	40,900	3,760.00	153,784,000	
富士急行	8,500	3,170.00	26,945,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
東日本旅客鉄道	103,900	10,070.00	1,046,273,000	
西日本旅客鉄道	52,300	7,406.00	387,333,800	
東海旅客鉄道	52,300	21,960.00	1,148,508,000	
西武ホールディングス	74,100	1,999.00	148,125,900	
鴻池運輸	8,600	1,790.00	15,394,000	
西日本鉄道	16,000	2,955.00	47,280,000	貸付株式数 100株
ハマキョウレックス	4,600	3,600.00	16,560,000	
サカイ引越センター	3,400	6,040.00	20,536,000	貸付株式数 800株 (800株)
近鉄グループHLDGS	53,900	4,365.00	235,273,500	
阪急阪神HLDGS	73,000	3,955.00	288,715,000	
南海電鉄	25,700	2,771.00	71,214,700	
京阪ホールディングス	24,600	4,035.00	99,261,000	
名古屋鉄道	44,100	2,567.00	113,204,700	
山陽電鉄	5,100	2,532.00	12,913,200	
トランコム	1,800	7,080.00	12,744,000	貸付株式数 400株
日本通運	21,400	6,780.00	145,092,000	
ヤマトホールディングス	97,200	3,154.00	306,568,800	
山 九	14,100	5,740.00	80,934,000	
日 新	5,200	2,286.00	11,887,200	
丸全昭和運輸	21,000	525.00	11,025,000	
センコーグループHLDGS	34,200	891.00	30,472,200	貸付株式数 1,100株
トナミホールディングス	1,700	6,340.00	10,778,000	
ニッコンホールディングス	19,700	2,671.00	52,618,700	
福山通運	8,600	4,745.00	40,807,000	

セイノーホールディングス	41,800	1,621.00	67,757,800	貸付株式数 11,200株 (11,200株)
日立物流	12,200	3,000.00	36,600,000	
丸和運輸機関	3,400	3,720.00	12,648,000	貸付株式数 800株 (800株)
日本郵船	45,100	2,004.00	90,380,400	
商船三井	34,100	2,892.00	98,617,200	
川崎汽船	24,700	2,050.00	50,635,000	貸付株式数 6,900株
N S ユナイテッド海運	2,900	2,310.00	6,699,000	
飯野海運	30,100	557.00	16,765,700	
九州旅客鉄道	45,800	3,340.00	152,972,000	
S G ホールディングス	52,700	2,624.00	138,284,800	
日本航空	101,000	3,998.00	403,798,000	
A N A ホールディングス	107,100	3,751.00	401,732,100	
ヤマシタヘルスケアH L D G S	8,100	1,447.00	11,720,700	貸付株式数 1,500株
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,500	3,930.00	9,825,000	貸付株式数 600株
三菱倉庫	18,600	2,615.00	48,639,000	貸付株式数 5,000株
三井倉庫H O L D	38,000	381.00	14,478,000	
住友倉庫	37,000	688.00	25,456,000	
渋沢倉庫	5,700	1,634.00	9,313,800	貸付株式数 200株
ヤマタネ	5,900	1,879.00	11,086,100	貸付株式数 1,500株
東陽倉庫	33,200	338.00	11,221,600	
日本トランスシティ	18,400	498.00	9,163,200	
東洋埠頭	8,000	1,652.00	13,216,000	
上 組	32,700	2,270.00	74,229,000	
キューソー流通システム	2,600	2,775.00	7,215,000	
近鉄エクスプレス	10,300	2,085.00	21,475,500	
内外トランスライン	6,300	1,675.00	10,552,500	貸付株式数 1,500株
東京放送H D	31,300	2,240.00	70,112,000	
日本テレビH L D S	51,300	1,797.00	92,186,100	貸付株式数 14,100株
テレビ朝日H D	15,300	2,011.00	30,768,300	貸付株式数 100株 (100株)
スカパーJ S A T H D	44,200	523.00	23,116,600	
テレビ東京H D	5,300	2,685.00	14,230,500	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本B S 放送	5,900	1,308.00	7,717,200	
ワイヤレスゲート	6,400	713.00	4,563,200	貸付株式数 1,300株 (1,000株)

コネクシオ	4,700	2,074.00	9,747,800	
日本通信	65,200	181.00	11,801,200	貸付株式数 18,100株 (1,000株)
日本電信電話	409,400	4,718.00	1,931,549,200	
KDDI	503,400	2,927.50	1,473,703,500	
光通信	7,000	21,500.00	150,500,000	
NTTドコモ	409,700	2,851.00	1,168,054,700	
エムティーアイ	12,400	637.00	7,898,800	貸付株式数 3,400株
GMOインターネット	21,700	1,774.00	38,495,800	
カドカワ	17,400	1,222.00	21,262,800	貸付株式数 4,800株
ゼンリン	11,000	3,350.00	36,850,000	貸付株式数 2,900株
東京電力HD	464,500	495.00	229,927,500	
中部電力	178,700	1,617.50	289,047,250	貸付株式数 20,300株
関西電力	238,300	1,609.00	383,424,700	
中国電力	78,200	1,394.00	109,010,800	貸付株式数 21,400株
北陸電力	56,400	1,072.00	60,460,800	貸付株式数 15,600株
東北電力	135,400	1,416.00	191,726,400	
四国電力	52,400	1,485.00	77,814,000	
九州電力	128,400	1,262.00	162,040,800	貸付株式数 17,900株
北海道電力	58,400	727.00	42,456,800	
沖縄電力	12,300	2,290.00	28,167,000	貸付株式数 3,300株
電源開発	46,000	2,814.00	129,444,000	
イーレックス	10,800	1,066.00	11,512,800	貸付株式数 2,800株
東京瓦斯	123,200	2,623.00	323,153,600	
大阪瓦斯	111,500	2,068.50	230,637,750	
東邦瓦斯	28,900	3,755.00	108,519,500	
北海道瓦斯	34,000	300.00	10,200,000	貸付株式数 5,000株
西部瓦斯	7,200	2,597.00	18,698,400	
静岡ガス	20,200	906.00	18,301,200	
メタウォーター	3,400	3,030.00	10,302,000	
松竹	3,800	13,200.00	50,160,000	貸付株式数 300株
東宝	37,700	3,275.00	123,467,500	
エイチ・アイ・エス	10,000	3,520.00	35,200,000	貸付株式数 2,600株
東映	2,200	12,200.00	26,840,000	
NTTデータ	180,300	1,432.00	258,189,600	
共立メンテナンス	10,200	4,655.00	47,481,000	貸付株式数 2,100株
イチネンホールディングス	8,600	1,320.00	11,352,000	貸付株式数 2,200株
建設技術研究所	7,600	1,497.00	11,377,200	
インホールディングス	7,800	8,560.00	66,768,000	貸付株式数 2,100株
スバル興業	1,200	5,700.00	6,840,000	

東京テアトル	7,000	1,399.00	9,793,000	貸付株式数	1,500株
よみうりランド	1,900	4,470.00	8,493,000	貸付株式数	500株
東京都競馬	4,000	4,095.00	16,380,000		
常磐興産	6,400	1,828.00	11,699,200	貸付株式数	1,700株
カナモト	7,800	3,695.00	28,821,000		
東京ドーム	21,900	998.00	21,856,200		
D T S	6,300	4,380.00	27,594,000		
スクウェア・エニックス・H D	26,900	4,885.00	131,406,500		
シーイーシー	8,000	2,414.00	19,312,000		
カプコン	25,100	2,715.00	68,146,500		
西尾レントオール	5,800	3,565.00	20,677,000		
日本空港ビルデング	16,900	4,825.00	81,542,500		
トランス・コスモス	6,700	2,712.00	18,170,400	貸付株式数	1,800株
乃村工藝社	13,600	2,161.00	29,389,600		
ジャステック	8,100	1,105.00	8,950,500		
S C S K	13,600	5,210.00	70,856,000		
藤田観光	3,000	3,340.00	10,020,000		
K N T - C Tホールディング ス	4,500	1,228.00	5,526,000	貸付株式数	1,100株
日本管財	6,800	2,094.00	14,239,200		
トーカイ	5,800	2,497.00	14,482,600	貸付株式数	100株
セコム	59,500	9,042.00	537,999,000		
セントラル警備保障	3,200	4,255.00	13,616,000		
アイネス	11,100	1,249.00	13,863,900		
丹青社	12,600	1,200.00	15,120,000	貸付株式数	3,000株
メイテック	6,700	5,240.00	35,108,000		
T K C	5,300	4,185.00	22,180,500		
富士ソフト	9,300	5,250.00	48,825,000		
応用地質	7,300	1,525.00	11,132,500	貸付株式数	700株
船井総研ホールディン グ	12,200	2,327.00	28,389,400	貸付株式数	3,200株
N S D	9,900	2,295.00	22,720,500		
オ オ バ	16,300	624.00	10,171,200	貸付株式数	3,900株
コナミホールディングス	23,100	4,385.00	101,293,500	貸付株式数	6,300株
学 究 社	7,000	1,786.00	12,502,000		
ベネッセホールディングス	19,800	3,350.00	66,330,000		
イオンディライト	7,800	3,905.00	30,459,000		
ニチイ学館	11,900	903.00	10,745,700	貸付株式数	1,600株
ダイセキ	9,500	2,787.00	26,476,500		
日鉄住金物産	4,300	5,460.00	23,478,000		

元気寿司	2,400	6,010.00	14,424,000	
トラスコ中山	12,400	2,875.00	35,650,000	
ヤマダ電機	192,900	554.00	106,866,600	貸付株式数 52,300株 (700株)
オートバックスセブン	20,700	1,862.00	38,543,400	
アークランドサカモト	10,000	1,418.00	14,180,000	
ニトリホールディングス	22,900	16,420.00	376,018,000	
吉野家ホールディングス	20,200	1,879.00	37,955,800	貸付株式数 5,400株
加藤産業	9,000	3,550.00	31,950,000	
イノテック	6,500	1,225.00	7,962,500	
イエローハット	5,400	2,916.00	15,746,400	
松屋フーズ	3,000	3,615.00	10,845,000	
JBC Cホールディングス	9,600	1,344.00	12,902,400	
サガミチェーン	10,600	1,400.00	14,840,000	貸付株式数 3,000株 (2,300株)
日 伝	4,500	1,965.00	8,842,500	
関西スーパーマーケット	5,800	1,133.00	6,571,400	
ミロク情報サービス	5,600	2,379.00	13,322,400	
北沢産業	17,100	235.00	4,018,500	
因幡電機産業	6,900	4,670.00	32,223,000	
王将フードサービス	4,500	7,140.00	32,130,000	
プレナス	6,300	1,874.00	11,806,200	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,300	2,055.00	8,836,500	
アークス	10,600	2,680.00	28,408,000	
バローホールディングス	13,100	2,320.00	30,392,000	
バイテックホールディングス	3,300	2,218.00	7,319,400	
ミスミグループ本社	66,800	2,739.00	182,965,200	
ベ ル ク	2,800	5,790.00	16,212,000	
ファーストリテイリング	7,700	53,900.00	415,030,000	貸付株式数 2,100株
ソフトバンクグループ	258,800	9,940.00	2,572,472,000	貸付株式数 27,900株
スズケン	25,900	4,995.00	129,370,500	
サンドラッグ	21,400	3,835.00	82,069,000	
サクスパーホールディング	7,100	890.00	6,319,000	
ジェコス	6,000	1,186.00	7,116,000	
ベルーナ	14,500	1,153.00	16,718,500	
合計			139,864,958,440	

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

トヨタ自動車

100,000株

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	245,695,310	226,861,077
金銭信託	-	4,875,908
コール・ローン	134,451,228	196,933,124
株式	84,403,845,417	102,362,743,718
投資証券	2,394,269,980	2,656,538,100
派生商品評価勘定	5,164,687	12,389,553
未収入金	17,796,046	3,986,228
未収配当金	178,137,991	221,881,854
差入委託証拠金	636,833,562	832,150,645
流動資産合計	88,016,194,221	106,518,360,207
資産合計	88,016,194,221	106,518,360,207
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,389,443	3,381,905
未払解約金	133,853,000	121,966,000
その他未払費用	-	1,727

流動負債合計		135,242,443	125,349,632
負債合計		135,242,443	125,349,632
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,855,140,897	42,459,485,295
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		48,025,810,881	63,933,525,280
元本等合計		87,880,951,778	106,393,010,575
純資産合計		87,880,951,778	106,393,010,575
負債純資産合計		88,016,194,221	106,518,360,207

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7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29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1. 1 期首	平成28年9月8日	平成29年9月8日
期首元本額	40,323,742,556円	39,855,140,897円
期中追加設定元本額	6,008,573,701円	6,718,211,769円
期中一部解約元本額	6,477,175,360円	4,113,867,371円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックス V A	603,705,926円	515,082,035円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	22,157,012円	16,121,330円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	308,276,379円	202,871,058円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	33,823,776円	25,117,867円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,023,159,168円	661,977,720円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジ なし)	378,510,637円	538,714,677円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘ ッジなし)	885,800,099円	1,377,137,596円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	234,557,237円	514,089,154円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,083,376円	1,009,461円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	172,046円	197,089円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	351,885,678円	618,256,777円
i F r e e 8資産バランス	246,793,552円	453,272,929円
i F r e e 年金バランス	- 円	1,657,323円

DCダイワ外国株式インデックス	23,541,947,617円	26,565,620,003円
ダイワ・ライフ・バランス30	520,035,841円	529,771,994円
ダイワ・ライフ・バランス50	707,330,244円	776,610,799円
ダイワ・ライフ・バランス70	557,456,983円	629,910,173円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,442,412,215円	1,473,684,673円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	6,396,162円	4,120,334円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	16,139,262円	12,251,586円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,312,847円	3,860,258円
ダイワつみたてインデックス外国株式	- 円	398,382円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	89,936円	72,012円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	178,417円	147,768円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	3,455,756円	1,141,693円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	21,688,287円	3,571,817円
ダイワ世界バランスファンド40VA	753,674,687円	272,944,755円
ダイワ世界バランスファンド60VA	431,180,890円	361,377,335円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,000,406,306円	3,175,048,786円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	196,749,618円	160,280,254円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	473,363,333円	609,047,733円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	31,669,595円	73,285,872円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	465,205円	454,226円

ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,905,325,880円	2,735,417,240円
ダイワライフスタイル25	21,418,049円	18,926,893円
ダイワライフスタイル50	72,275,283円	68,555,284円
ダイワライフスタイル75	58,243,598円	57,480,409円
計	39,855,140,897円	42,459,485,295円
2. 期末日における受益権の総数	39,855,140,897口	42,459,485,295口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年9月7日現在
-----	-------------

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	8,316,627,468	5,095,402,721
投資証券	175,935,500	21,245,147
合計	8,492,562,968	5,116,647,868

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成28年12月1日から平成29年9月7日まで、及び平成29年12月1日から平成30年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	平成29年9月7日 現在				平成30年9月7日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,073,056,535	-	1,076,831,779	3,775,244	1,263,402,812	-	1,272,633,160	9,230,348
合計	1,073,056,535	-	1,076,831,779	3,775,244	1,263,402,812	-	1,272,633,160	9,230,348

(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29年9月7日 現在				平成30年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	-	-	-	-	55,367,700	-	55,145,000	222,700
アメリカ・ドル	-	-	-	-	55,367,700	-	55,145,000	222,700
合計	-	-	-	-	55,367,700	-	55,145,000	222,700

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,2050円 (22,050円)	2,5058円 (25,058円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	3,050	136.980	417,789.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,350	220.370	517,869.500	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,800	65.740	315,552.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,450	168.800	244,760.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	18,800	31.800	597,840.000	
	ABBOTT LABORATORIES	43,916	65.830	2,890,990.280	
	ARCONIC INC	10,333	21.920	226,499.360	
	VERISK ANALYTICS INC	3,900	120.320	469,248.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	10,000	61.080	610,800.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	7,450	95.530	711,698.500	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,479	107.600	912,340.400	
	QORVO INC	3,100	75.130	232,903.000	
	AFLAC INC	19,600	46.890	919,044.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,150	118.810	374,251.500	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3,500	49.470	173,145.000	
	ADOBE SYSTEMS INC	12,400	259.750	3,220,900.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,950	50.950	303,152.500	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,600	151.000	392,600.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	8,900	18.600	165,540.000	
GARMIN LTD	2,900	69.030	200,187.000		
AETNA INC	8,329	202.620	1,687,621.980		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,600	166.060	929,936.000		
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	18,700	164.010	3,066,987.000		

TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,171	98.960	412,762.160	
WR BERKLEY CORP	2,300	78.770	181,171.000	
AUTOZONE INC	660	771.660	509,295.600	
DOLLAR TREE INC	6,021	82.120	494,444.520	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	24,500	21.750	532,875.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,650	80.200	212,530.000	
CELANESE CORP-SERIES A	3,300	115.310	380,523.000	
DR HORTON INC	8,716	44.770	390,215.320	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,450	60.640	148,568.000	
DENTSPLY SIRONA INC	5,900	38.900	229,510.000	
AUTODESK INC	5,500	148.800	818,400.000	
MOODY'S CORP	4,450	176.650	786,092.500	
DEVON ENERGY CORP	13,150	40.630	534,284.500	
ALBEMARLE CORP	2,800	97.660	273,448.000	
ATMOS ENERGY CORP	2,800	94.060	263,368.000	
ALLIANT ENERGY CORP	5,750	43.860	252,195.000	
CITIGROUP INC	64,473	70.110	4,520,202.030	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	11,150	147.280	1,642,172.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	12,600	73.330	923,958.000	
ALLEGHANY CORP	370	636.360	235,453.200	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	290.530	319,583.000	
HESS CORP	7,200	62.970	453,384.000	
DAVITA INC	3,500	67.830	237,405.000	
DANAHER CORP	15,800	104.600	1,652,680.000	
FORTIVE CORP	7,800	84.160	656,448.000	
AVNET INC	2,800	47.950	134,260.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	14,650	77.380	1,133,617.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,900	20.410	100,009.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,728	19.180	90,683.040	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	14,350	49.410	709,033.500	
BUNGE LTD	3,600	63.290	227,844.000	
TE CONNECTIVITY LTD	8,925	89.600	799,680.000	
APPLE INC	124,550	223.100	27,787,105.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,000	77.730	699,570.000	
BOEING CO/THE	13,940	351.270	4,896,703.800	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,915	77.640	303,960.600	
BECTON DICKINSON AND CO	6,689	255.660	1,710,109.740	

MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,000	21.040	126,240.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,550	70.950	251,872.500	
CDK GLOBAL INC	3,200	60.890	194,848.000	
NISOURCE INC	9,350	27.680	258,808.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,600	97.200	349,920.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	25,171	52.190	1,313,674.490	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	103,354	54.290	5,611,088.660	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	32,000	212.880	6,812,160.000	
ANSYS INC	2,100	185.170	388,857.000	
H&R BLOCK INC	5,100	26.460	134,946.000	
BB&T CORP	20,000	52.250	1,045,000.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	41,250	60.940	2,513,775.000	
JPMORGAN CHASE & CO	85,370	114.100	9,740,717.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,000	113.260	679,560.000	
CIGNA CORP	6,050	185.180	1,120,339.000	
LKQ CORP	7,800	33.710	262,938.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,000	131.060	131,060.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,462	53.760	347,397.120	
CADENCE DESIGN SYS INC	7,250	46.540	337,415.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,610	143.190	516,915.900	
DOLLAR GENERAL CORP	6,650	111.120	738,948.000	
SERVICENOW INC	4,450	193.180	859,651.000	
CATERPILLAR INC	15,000	141.570	2,123,550.000	
CMS ENERGY CORP	7,200	50.620	364,464.000	
MOSAIC CO/THE	9,050	30.280	274,034.000	
DELTA AIR LINES INC	4,350	56.440	245,514.000	
CORNING INC	21,300	33.530	714,189.000	
CISCO SYSTEMS INC	120,400	47.280	5,692,512.000	
MORGAN STANLEY	33,700	47.930	1,615,241.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,250	124.240	155,300.000	
MSCI INC	2,300	179.240	412,252.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	900	225.820	203,238.000	
MIDDLEBY CORP	1,300	125.450	163,085.000	
COTY INC-CL A	11,839	12.300	145,619.700	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	5,200	55.150	286,780.000	
BROADCOM INC	10,252	215.970	2,214,124.440	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,050	118.480	124,404.000	
ACUITY BRANDS INC	1,000	150.460	150,460.000	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,180	112.130	244,443.400	
ARAMARK	6,450	40.560	261,612.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5,350	29.550	158,092.500	
DTE ENERGY COMPANY	4,650	114.000	530,100.000	
CENTENE CORP	5,250	145.310	762,877.500	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,800	102.900	288,120.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,150	41.190	500,458.500	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,650	73.860	343,449.000	
GARTNER INC	2,350	153.600	360,960.000	
SPLUNK INC	3,550	123.430	438,176.500	
AGCO CORP	1,450	60.570	87,826.500	
DOMINION ENERGY INC	16,200	72.250	1,170,450.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	10,550	61.340	647,137.000	
SMITH (A.O.) CORP	3,650	57.980	211,627.000	
DEERE & CO	7,750	145.100	1,124,525.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	4,000	124.280	497,120.000	
VMWARE INC-CLASS A	1,800	153.830	276,894.000	
CHEMOURS CO/THE	4,550	43.650	198,607.500	
NASDAQ INC	2,900	93.080	269,932.000	
VAIL RESORTS INC	1,020	291.640	297,472.800	
EAST WEST BANCORP INC	3,650	63.360	231,264.000	
TARGA RESOURCES CORP	5,350	53.940	288,579.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,650	141.590	233,623.500	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,800	112.910	203,238.000	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,050	92.000	96,600.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	8,000	81.350	650,800.000	
COGNEX CORP	4,150	52.640	218,456.000	
TELEFLEX INC	1,130	248.000	280,240.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,100	123.080	258,468.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,150	101.710	320,386.500	
IDEX CORP	1,950	152.570	297,511.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	21,150	67.000	1,417,050.000	
ROLLINS INC	2,550	61.130	155,881.500	
AMETEK INC	5,775	78.290	452,124.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,100	58.120	354,532.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,200	34.930	111,776.000	
XPO LOGISTICS INC	3,100	106.560	330,336.000	

LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,250	112.240	925,980.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	11,000	236.680	2,603,480.000	
SCANA CORP	3,500	36.680	128,380.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,350	143.840	194,184.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	650	481.050	312,682.500	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	7,600	23.190	176,244.000	
UGI CORP	4,200	55.140	231,588.000	
CUMMINS INC	3,850	140.910	542,503.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	18,150	71.960	1,306,074.000	
SABRE CORP	6,100	25.630	156,343.000	
CDW CORP/DE	3,750	87.470	328,012.500	
SIGNATURE BANK	1,300	119.150	154,895.000	
COSTAR GROUP INC	900	437.210	393,489.000	
SVB FINANCIAL GROUP	1,300	320.470	416,611.000	
AMERCO	220	359.410	79,070.200	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,500	165.350	248,025.000	
MERCADOLIBRE INC	1,090	320.760	349,628.400	
HANESBRANDS INC	8,500	17.660	150,110.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,950	159.570	311,161.500	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7,066	75.690	534,825.540	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,600	30.900	142,140.000	
IPG PHOTONICS CORP	900	157.000	141,300.000	
COPART INC	5,400	65.100	351,540.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,450	114.490	280,500.500	
SEATTLE GENETICS INC	2,900	76.450	221,705.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,950	370.820	723,099.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,280	353.750	452,800.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,000	25.970	233,730.000	
KINDER MORGAN INC	50,981	17.670	900,834.270	
HCA HEALTHCARE INC	7,100	132.300	939,330.000	
CABOT OIL & GAS CORP	11,150	21.910	244,296.500	
T-MOBILE US INC	8,550	65.520	560,196.000	
ZILLOW GROUP INC - C	2,900	44.630	129,427.000	
COCA-COLA CO/THE	101,100	45.770	4,627,347.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,300	42.590	225,727.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,250	75.480	320,790.000	
EATON VANCE CORP	3,050	52.170	159,118.500	

FRANKLIN RESOURCES INC	7,950	30.260	240,567.000	
CSX CORP	21,400	74.060	1,584,884.000	
FLUOR CORP	3,650	56.380	205,787.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,600	169.710	441,246.000	
EXPEDIA GROUP INC	3,025	124.530	376,703.250	
AUTOLIV INC	2,150	85.740	184,341.000	
AMAZON.COM INC	10,390	1,958.310	20,346,840.900	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	6,050	26.440	159,962.000	
FLOWERVE CORP	3,200	52.460	167,872.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,200	140.550	730,860.000	
EXXON MOBIL CORP	106,605	80.460	8,577,438.300	
FLIR SYSTEMS INC	3,400	63.050	214,370.000	
AES CORP	17,000	13.280	225,760.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	2,050	211.600	433,780.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,020	219.310	223,696.200	
EOG RESOURCES INC	14,550	115.500	1,680,525.000	
EQT CORP	6,650	46.910	311,951.500	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,150	74.280	308,262.000	
ABIOMED INC	1,080	383.100	413,748.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,000	88.380	353,520.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,990	67.360	538,206.400	
FORD MOTOR CO	92,123	9.430	868,719.890	
MACY'S INC	7,498	35.360	265,129.280	
DISCOVERY INC - A	3,990	27.620	110,203.800	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	26.310	128,576.970	
DISCOVERY INC-C	7,289	25.430	185,359.270	
AERCAP HOLDINGS NV	3,400	56.790	193,086.000	
FORTINET INC	3,500	85.000	297,500.000	
MARKEL CORP	340	1,208.520	410,896.800	
NEXTERA ENERGY INC	12,000	173.820	2,085,840.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	34,108	13.570	462,845.560	
US BANCORP	40,350	54.330	2,192,215.500	
UNITED RENTALS INC	2,150	153.820	330,713.000	
F5 NETWORKS INC	1,600	190.180	304,288.000	
FASTENAL CO	7,200	59.010	424,872.000	
FISERV INC	10,250	80.370	823,792.500	
GENERAL ELECTRIC CO	219,250	12.510	2,742,817.500	
NEKTAR THERAPEUTICS	4,450	66.000	293,700.000	

NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	5,200	53.200	276,640.000	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	6,050	23.480	142,054.000	
GENERAL MOTORS CO	32,500	34.380	1,117,350.000	
TRIPADVISOR INC	2,750	50.630	139,232.500	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,450	195.240	1,259,298.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,940	234.520	2,096,608.800	
ALPHABET INC-CL A	7,470	1,183.990	8,844,405.300	
ALPHABET INC-CL C	7,917	1,171.440	9,274,290.480	
OWENS CORNING	2,750	57.140	157,135.000	
GENERAL MILLS INC	15,000	47.010	705,150.000	
FIRSTENERGY CORP	11,868	37.960	450,509.280	
GENUINE PARTS CO	3,750	101.240	379,650.000	
IHS MARKIT LTD	10,184	54.820	558,286.880	
FIFTH THIRD BANCORP	17,600	29.500	519,200.000	
HARRIS CORP	3,050	161.520	492,636.000	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	38.480	115,440.000	
HALLIBURTON CO	21,700	36.860	799,862.000	
HOME DEPOT INC	29,000	205.890	5,970,810.000	
ASSURANT INC	1,250	103.350	129,187.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	27,200	16.340	444,448.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,090	248.130	270,461.700	
HERSHEY CO/THE	3,500	104.240	364,840.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,000	44.070	176,280.000	
HUMANA INC	3,500	333.880	1,168,580.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,700	93.990	817,713.000	
HELMERICH & PAYNE	2,600	62.900	163,540.000	
HENRY SCHEIN INC	3,800	80.540	306,052.000	
HP INC	41,900	24.680	1,034,092.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	39,400	16.520	650,888.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,300	46.260	198,918.000	
HOLLYFRONTIER CORP	4,300	72.010	309,643.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	4,900	35.950	176,155.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,100	46.110	96,831.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,350	30.360	314,226.000	

KRAFT HEINZ CO/THE	15,603	56.800	886,250.400	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	22,950	146.390	3,359,650.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	10,000	51.830	518,300.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,600	53.900	194,040.000	
ZOETIS INC	12,200	89.740	1,094,828.000	
INGERSOLL-RAND PLC	6,279	101.240	635,685.960	
CHENIERE ENERGY INC	5,450	65.130	354,958.500	
ALLEGION PLC	2,450	88.930	217,878.500	
LEGGETT & PLATT INC	3,100	45.570	141,267.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	13,673	25.430	347,704.390	
WASTE CONNECTIONS INC	6,457	80.900	522,371.300	
JUNIPER NETWORKS INC	8,900	27.700	246,530.000	
JM SMUCKER CO/THE	2,920	109.770	320,528.400	
JOHNSON & JOHNSON	67,650	136.870	9,259,255.500	
ABBVIE INC	38,979	93.740	3,653,891.460	
HOLOGIC INC	7,100	38.740	275,054.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	8,650	116.050	1,003,832.500	
KROGER CO	21,850	32.560	711,436.000	
KLA-TENCOR CORP	3,850	107.280	413,028.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	6,420	328.910	2,111,602.200	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,200	216.180	475,596.000	
L BRANDS INC	5,900	26.550	156,645.000	
LOWE'S COS INC	20,800	109.380	2,275,104.000	
ELI LILLY & CO	24,550	105.370	2,586,833.500	
LAM RESEARCH CORP	4,230	160.050	677,011.500	
JONES LANG LASALLE INC	1,100	148.840	163,724.000	
LOEWS CORP	7,250	49.890	361,702.500	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,449	65.350	356,092.150	
MCDONALD'S CORP	19,800	163.740	3,242,052.000	
3M CO	14,800	212.740	3,148,552.000	
FACEBOOK INC-A	60,000	162.530	9,751,800.000	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	5,104	95.880	489,371.520	
MANPOWERGROUP INC	1,600	91.850	146,960.000	
S&P GLOBAL INC	6,300	207.020	1,304,226.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,600	198.300	317,280.000	
CONCHO RESOURCES INC	5,050	132.750	670,387.500	
FIRST DATA CORP- CLASS A	13,450	25.380	341,361.000	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,300	34.400	182,320.000	

PHILLIPS 66	11,300	116.700	1,318,710.000	
TECHNIPFMC PLC	11,150	28.510	317,886.500	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	13,400	27.000	361,800.000	
MATTEL INC	8,700	15.330	133,371.000	
DXC TECHNOLOGY CO	7,038	90.830	639,261.540	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,000	129.560	388,680.000	
MYLAN NV	12,850	38.930	500,250.500	
METLIFE INC	21,900	45.830	1,003,677.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	15,700	19.460	305,522.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,290	267.770	345,423.300	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	3,800	49.010	186,238.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,028	127.610	514,013.080	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	640	588.000	376,320.000	
BAKER HUGHES A GE CO	10,273	30.990	318,360.270	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,230	182.090	588,150.700	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,940	40.210	118,217.400	
MERCK & CO. INC.	67,221	69.380	4,663,792.980	
DOWDUPONT INC	58,505	70.080	4,100,030.400	
MASCO CORP	7,900	37.920	299,568.000	
M & T BANK CORP	3,519	178.640	628,634.160	
MARSH & MCLENNAN COS	12,800	85.340	1,092,352.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,472	124.980	933,850.560	
WORKDAY INC-CLASS A	3,750	144.520	541,950.000	
SQUARE INC - A	7,450	88.540	659,623.000	
TRANSUNION	4,700	75.350	354,145.000	
VISTRA ENERGY CORP	8,700	22.460	195,402.000	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,850	72.810	280,318.500	
WORLDPAY INC-CLASS A	7,650	96.740	740,061.000	
NETAPP INC	6,850	83.410	571,358.500	
NIKE INC -CL B	32,200	80.400	2,588,880.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,150	174.610	1,248,461.500	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,000	83.900	503,400.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,200	91.820	293,824.000	
ALLY FINANCIAL INC	10,700	26.770	286,439.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,160	301.690	1,255,030.400	
APTIV PLC	6,500	84.780	551,070.000	

NEWMONT MINING CORP	13,000	30.240	393,120.000	
MCKESSON CORP	5,050	125.500	633,775.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,100	60.290	428,059.000	
XYLEM INC	4,500	78.410	352,845.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	39,150	78.620	3,077,973.000	
NUCOR CORP	8,200	63.310	519,142.000	
WESTERN UNION CO	11,746	18.960	222,704.160	
GODADDY INC - CLASS A	4,100	79.450	325,745.000	
NEWELL BRANDS INC	12,292	21.270	261,450.840	
EVERGY INC	6,950	58.950	409,702.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	19,200	77.570	1,489,344.000	
LIBERTY BROADBAND-C	2,550	79.610	203,005.500	
PAYCHEX INC	8,350	74.610	622,993.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,120	344.700	730,764.000	
ALTRIA GROUP INC	47,200	60.790	2,869,288.000	
P G & E CORP	13,250	45.530	603,272.500	
PFIZER INC	147,663	41.780	6,169,360.140	
ALKERMES PLC	4,000	42.950	171,800.000	
XCEL ENERGY INC	13,150	49.290	648,163.500	
STRYKER CORP	8,450	171.250	1,447,062.500	
PARKER HANNIFIN CORP	3,300	177.830	586,839.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,300	164.630	707,909.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,550	110.250	170,887.500	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	62,967	82.650	5,204,222.550	
EXELON CORP	23,922	44.360	1,061,179.920	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,500	117.410	645,755.000	
NVR INC	90	2,653.880	238,849.200	
CONOCOPHILLIPS	29,300	70.540	2,066,822.000	
PEPSICO INC	35,750	113.500	4,057,625.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,600	98.730	1,046,538.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,550	89.090	405,359.500	
ACCENTURE PLC-CL A	16,250	169.360	2,752,100.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,950	56.870	110,896.500	
PENTAIR PLC	4,205	43.480	182,833.400	
QUALCOMM INC	36,950	70.360	2,599,802.000	
INVESCO LTD	10,150	24.220	245,833.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,900	167.220	317,718.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,200	55.720	401,184.000	

RAYTHEON COMPANY	7,320	202.210	1,480,177.200	
RED HAT INC	4,550	145.930	663,981.500	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,000	397.930	795,860.000	
REPUBLIC SERVICES INC	5,600	74.400	416,640.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,210	1,909.500	2,310,495.000	
ROSS STORES INC	9,650	97.350	939,427.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,400	111.560	267,744.000	
RESMED INC	3,700	111.930	414,141.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,300	109.770	362,241.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,050	75.330	229,756.500	
RALPH LAUREN CORP	1,450	131.060	190,037.000	
ROCKWELL COLLINS INC	4,163	139.000	578,657.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	28,835	19.580	564,589.300	
CHEVRON CORP	48,168	115.230	5,550,398.640	
EDISON INTERNATIONAL	8,300	67.470	560,001.000	
TESLA INC	3,300	280.950	927,135.000	
SYMANTEC CORP	15,050	19.810	298,140.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,922	140.920	552,688.240	
SYNOPSYS INC	3,750	101.780	381,675.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,505	305.190	1,374,880.950	
CBRE GROUP INC - A	8,100	46.880	379,728.000	
TWITTER INC	16,800	30.810	517,608.000	
SOUTHERN CO/THE	25,300	45.760	1,157,728.000	
SYSCO CORP	12,700	74.970	952,119.000	
TRAVELERS COS INC/THE	6,873	132.570	911,153.610	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,200	61.970	198,304.000	
STERICYCLE INC	2,150	61.950	133,192.500	
STEEL DYNAMICS INC	5,700	47.360	269,952.000	
SCHLUMBERGER LTD	34,652	60.210	2,086,396.920	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,150	52.240	216,796.000	
AT&T INC	181,491	32.180	5,840,380.380	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,650	61.030	222,759.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	11,000	19.860	218,460.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,110	462.390	975,642.900	
SEMPRA ENERGY	6,450	118.030	761,293.500	
TIFFANY & CO	2,950	123.370	363,941.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,050	49.390	348,199.500	

TEXAS INSTRUMENTS INC	24,450	110.890	2,711,260.500	
SALESFORCE.COM INC	17,800	148.830	2,649,174.000	
WESTROCK CO	6,630	54.880	363,854.400	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	22,984	38.830	892,468.720	
ANDEAVOR	3,650	153.800	561,370.000	
UNION PACIFIC CORP	19,600	154.650	3,031,140.000	
MARATHON OIL CORP	21,300	20.360	433,668.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	11,900	82.800	985,320.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	19,200	133.520	2,563,584.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	17,500	123.700	2,164,750.000	
UNUM GROUP	5,400	36.660	197,964.000	
SPRINT CORP	20,765	6.090	126,458.850	
ANTERO RESOURCES CORP	5,100	17.110	87,261.000	
IQVIA HOLDINGS INC	3,944	126.880	500,414.720	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	49.040	213,324.000	
AMEREN CORPORATION	6,250	65.620	410,125.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	24,226	269.650	6,532,540.900	
VERISIGN INC	2,900	158.140	458,606.000	
VALERO ENERGY CORP	10,892	116.070	1,264,234.440	
ULTA BEAUTY INC	1,410	275.660	388,680.600	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	6,838	40.270	275,366.260	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,100	126.720	266,112.000	
ANTHEM INC	6,440	270.890	1,744,531.600	
WALT DISNEY CO/THE	37,200	110.260	4,101,672.000	
WELLS FARGO & CO	116,222	57.930	6,732,740.460	
WASTE MANAGEMENT INC	11,050	91.880	1,015,274.000	
WILLIAMS COS INC	30,500	28.500	869,250.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,200	89.910	287,712.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	126.470	214,999.000	
WALMART INC	36,900	96.450	3,559,005.000	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	85.790	248,791.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,050	123.560	623,978.000	
WYNN RESORTS LTD	2,400	127.850	306,840.000	
XEROX CORP	5,911	27.020	159,715.220	
WABTEC CORP	2,250	113.000	254,250.000	
TJX COMPANIES INC	15,650	110.600	1,730,890.000	
WATERS CORP	1,900	191.730	364,287.000	

UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,800	87.130	156,834.000	
ALLERGAN PLC	8,657	190.500	1,649,158.500	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,100	68.030	1,435,433.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,333	149.570	498,516.810	
WESTERN DIGITAL CORP	7,300	57.790	421,867.000	
WEC ENERGY GROUP INC	7,830	69.290	542,540.700	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	12,800	53.080	679,424.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	44,900	144.500	6,488,050.000	
PPL CORP	17,700	30.920	547,284.000	
PULTEGROUP INC	6,900	28.070	193,683.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,150	112.000	688,800.000	
NORTHERN TRUST CORP	5,350	106.130	567,795.500	
NVIDIA CORP	14,800	272.720	4,036,256.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,050	195.500	400,775.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,943	143.200	1,710,237.600	
QURATE RETAIL INC	11,450	20.660	236,557.000	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4,700	43.620	205,014.000	
TYSON FOODS INC-CL A	7,450	63.080	469,946.000	
NETFLIX INC	10,870	346.460	3,766,020.200	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10,100	235.730	2,380,873.000	
TORCHMARK CORP	2,675	88.610	237,031.750	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,950	102.800	406,060.000	
TEXTRON INC	6,350	69.610	442,023.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	26,600	45.340	1,206,044.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	11,000	44.880	493,680.000	
NEWS CORP - CLASS A	9,237	12.700	117,309.900	
OGE ENERGY CORP	4,700	37.500	176,250.000	
OMNICOM GROUP	5,700	69.250	394,725.000	
ORACLE CORP	77,333	47.710	3,689,557.430	
MASTERCARD INC - A	23,200	212.770	4,936,264.000	
ONEOK INC	10,250	66.010	676,602.500	
CENTURYLINK INC	23,952	22.000	526,944.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,600	303.110	788,086.000	
YUM! BRANDS INC	8,300	87.920	729,736.000	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,850	130.350	371,497.500	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,230	237.980	292,715.400	
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,600	66.410	305,486.000	
NOBLE ENERGY INC	12,400	29.340	363,816.000	
BANK OF AMERICA CORP	241,301	30.850	7,444,135.850	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,300	96.160	413,488.000	
NORDSTROM INC	3,000	65.110	195,330.000	
AMERICAN EXPRESS CO	18,350	105.400	1,934,090.000	
ANALOG DEVICES INC	9,199	97.090	893,130.910	
ADVANCED MICRO DEVICES	22,800	27.840	634,752.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	7,200	56.130	404,136.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	22,322	53.900	1,203,155.800	
ANADARKO PETROLEUM CORP	13,500	63.680	859,680.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,500	88.660	398,970.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,200	124.040	520,968.000	
NEWFIELD EXPLORATION CO	5,100	26.660	135,966.000	
AVERY DENNISON CORP	2,100	105.130	220,773.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	14,550	75.720	1,101,726.000	
EMERSON ELECTRIC CO	15,700	76.210	1,196,497.000	
AON PLC	6,050	150.430	910,101.500	
AMGEN INC	17,250	196.150	3,383,587.500	
TAPESTRY INC	7,100	49.960	354,716.000	
EATON CORP PLC	11,086	84.670	938,651.620	
CELGENE CORP	19,200	89.890	1,725,888.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,330	208.620	903,324.600	
APPLIED MATERIALS INC	26,300	40.270	1,059,101.000	
CIT GROUP INC	3,300	54.270	179,091.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,500	85.470	213,675.000	
CME GROUP INC	8,700	173.500	1,509,450.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	9,894	45.060	445,823.640	
ECOLAB INC	6,650	153.200	1,018,780.000	
EQUIFAX INC	3,150	135.760	427,644.000	
GAP INC/THE	5,950	29.020	172,669.000	
GILEAD SCIENCES INC	32,650	72.880	2,379,532.000	
HORMEL FOODS CORP	7,350	41.280	303,408.000	
STATE STREET CORP	9,293	86.410	803,008.130	
SUNTRUST BANKS INC	11,548	74.210	856,977.080	

SCHWAB (CHARLES) CORP	30,400	49.510	1,505,104.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	12,700	74.520	946,404.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,400	40.050	176,220.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,450	42.950	148,177.500	
CARDINAL HEALTH INC	7,800	52.110	406,458.000	
FEDEX CORP	6,400	246.190	1,575,616.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	12,254	98.150	1,202,730.100	
FMC CORP	3,350	82.940	277,849.000	
FLEX LTD	12,900	13.230	170,667.000	
CERNER CORP	7,300	64.890	473,697.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,900	129.880	246,772.000	
CITRIX SYSTEMS INC	3,700	112.290	415,473.000	
INTEL CORP	116,600	47.260	5,510,516.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	9,400	22.600	212,440.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,100	49.880	453,908.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	7,650	141.070	1,079,185.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,500	7.020	270,270.000	
ILLUMINA INC	3,650	348.290	1,271,258.500	
SEALED AIR CORP	4,400	40.500	178,200.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,890	541.860	1,565,975.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,450	115.540	398,613.000	
SNAP-ON INC	1,400	181.400	253,960.000	
CARMAX INC	4,600	78.240	359,904.000	
COMERICA INC	4,200	97.880	411,096.000	
INGREDION INC	1,700	102.400	174,080.000	
DUKE ENERGY CORP	17,878	83.470	1,492,276.660	
TARGET CORP	12,800	88.880	1,137,664.000	
DOVER CORP	3,900	86.340	336,726.000	
WW GRAINGER INC	1,300	353.140	459,082.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,100	73.840	228,904.000	
CINTAS CORP	2,350	216.400	508,540.000	
CA INC	8,055	43.850	353,211.750	
CONAGRA BRANDS INC	10,000	36.250	362,500.000	
CLOROX COMPANY	3,300	149.720	494,076.000	
ENTERGY CORP	4,400	85.530	376,332.000	
MICROSOFT CORP	182,700	108.740	19,866,798.000	
INCYTE CORP	4,600	72.210	332,166.000	

CVS HEALTH CORP	25,874	76.070	1,968,235.180	
MEDTRONIC PLC	34,138	96.490	3,293,975.620	
MICRON TECHNOLOGY INC	29,000	44.650	1,294,850.000	
BLACKROCK INC	3,030	471.960	1,430,038.800	
CENTERPOINT ENERGY INC	10,300	28.900	297,670.000	
HASBRO INC	2,850	101.030	287,935.500	
KELLOGG CO	6,450	73.650	475,042.500	
KEYCORP	26,700	21.180	565,506.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,550	118.650	302,557.500	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	37,561	43.490	1,633,527.890	
KOHL'S CORP	4,150	81.060	336,399.000	
COOPER COS INC/THE	1,200	259.810	311,772.000	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	12,000	11.020	132,240.000	
APACHE CORP	9,860	42.660	420,627.600	
CHUBB LTD	11,699	137.340	1,606,740.660	
ARROW ELECTRONICS INC	2,150	75.830	163,034.500	
ALLSTATE CORP	8,900	101.100	899,790.000	
EBAY INC	23,900	33.660	804,474.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	28,400	89.000	2,527,600.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	3,450	97.450	336,202.500	
XILINX INC	6,550	78.040	511,162.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	14,360	90.230	1,295,702.800	
DISH NETWORK CORP-A	5,750	34.520	198,490.000	
ZIONS BANCORPORATION	4,800	53.320	255,936.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,750	138.680	797,410.000	
TOLL BROTHERS INC	3,800	36.830	139,954.000	
TRIMBLE INC	6,400	41.970	268,608.000	
LENNAR CORP-A	7,100	52.340	371,614.000	
LEAR CORP	1,650	158.960	262,284.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	6,500	55.420	360,230.000	
PROGRESSIVE CORP	14,900	68.820	1,025,418.000	
PRAXAIR INC	7,250	156.670	1,135,857.500	
PACCAR INC	8,687	69.180	600,966.660	
PVH CORP	1,850	136.400	252,340.000	
BIOGEN INC	5,310	341.340	1,812,515.400	
IDEXX LABORATORIES INC	2,220	244.260	542,257.200	
STARBUCKS CORP	34,600	54.210	1,875,666.000	
PERRIGO CO PLC	3,400	76.000	258,400.000	

	EVERSOURCE ENERGY	8,130	63.510	516,336.300	
	INTUIT INC	6,150	219.860	1,352,139.000	
	BORGWARNER INC	5,100	44.170	225,267.000	
	BEST BUY CO INC	6,500	79.230	514,995.000	
	BALL CORP	8,034	42.140	338,552.760	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	35,247	35.990	1,268,539.530	
	XL GROUP LTD	6,600	57.170	377,322.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	7,850	113.200	888,620.000	
	VULCAN MATERIALS CO	3,200	110.220	352,704.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,400	180.050	1,152,320.000	
	VF CORP	8,350	91.290	762,271.500	
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	8,371	54.620	457,224.020	
	VIACOM INC-CLASS B	8,671	29.260	253,713.460	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,570	190.720	299,430.400	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,200	109.050	239,910.000	
	CARNIVAL CORP	10,650	61.740	657,531.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	115,290	35.920	4,141,216.800	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	5,600	35.130	196,728.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,600	60.540	339,024.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	8.900	80,100.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	31,300	6.740	210,962.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 628,272,252.760 (69,430,366,652)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	MERLIN ENTERTAINMENT	16,300	3.783	61,662.900	
	TUI AG-DI	10,947	13.525	148,058.170	
	BP PLC	514,000	5.412	2,781,768.000	
	UNILEVER PLC	31,460	42.235	1,328,713.100	
	BARCLAYS PLC	437,000	1.762	769,994.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	44,000	9.742	428,648.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	42,100	2.973	125,163.300	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,280	48.890	111,469.200	
	PRUDENTIAL PLC	65,700	17.005	1,117,228.500	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	120,391	2.481	298,690.070	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,964	34.750	172,499.000	
	BAE SYSTEMS PLC	81,400	6.100	496,540.000	

AVIVA PLC	102,566	4.859	498,368.190	
GLAXOSMITHKLINE PLC	126,352	15.254	1,927,373.400	
INFORMA PLC	32,000	7.534	241,088.000	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	10,500	12.800	134,400.000	
MELROSE INDUSTRIES PLC	126,300	2.300	290,490.000	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	9,300	4.850	45,105.000	
AUTO TRADER GROUP PLC	22,400	4.270	95,648.000	
DCC PLC	2,150	67.350	144,802.500	
GVC HOLDINGS PLC	14,000	10.920	152,880.000	
CONVATEC GROUP PLC	33,000	2.124	70,092.000	
ROYAL MAIL PLC	22,300	4.662	103,962.600	
NMC HEALTH PLC	2,700	36.380	98,226.000	
RELX PLC	26,746	16.815	449,733.990	
DIAGEO PLC	63,000	26.855	1,691,865.000	
RIO TINTO PLC	30,650	35.445	1,086,389.250	
STANDARD CHARTERED PLC	81,300	6.223	505,929.900	
TESCO PLC	254,800	2.399	611,265.200	
FRESNILLO PLC	5,600	8.630	48,328.000	
SMITH & NEPHEW PLC	22,100	13.545	299,344.500	
GLENCORE PLC	306,625	3.041	932,446.620	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	16,200	6.966	112,849.200	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	7,400	21.710	160,654.000	
SMITHS GROUP PLC	10,233	15.880	162,500.040	
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	7.122	43,444.200	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	33,483	3.277	109,723.790	
PEARSON PLC	20,163	8.960	180,660.480	
SAINSBURY (J) PLC	45,225	3.201	144,765.220	
NEXT PLC	3,550	54.900	194,895.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	84,200	1.680	141,456.000	
WHITBREAD PLC	4,611	47.000	216,717.000	
BUNZL PLC	8,255	23.760	196,138.800	
VODAFONE GROUP PLC	684,183	1.640	1,122,060.120	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,193	50.100	159,969.300	
KINGFISHER PLC	55,411	2.685	148,778.530	
WPP PLC	33,100	11.445	378,829.500	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	17,127	7.236	123,930.970	
SEVERN TRENT PLC	5,733	19.515	111,879.490	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	17,150	64.730	1,110,119.500	

ST JAMES'S PLACE PLC	13,600	11.235	152,796.000	
SCHRODERS PLC	3,050	29.990	91,469.500	
SSE PLC	26,400	12.685	334,884.000	
WEIR GROUP PLC/THE	6,150	16.320	100,368.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	25,900	5.532	143,278.800	
ASTRAZENECA PLC	32,150	56.350	1,811,652.500	
FERGUSON PLC	5,887	62.760	369,468.120	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	155,100	2.543	394,419.300	
3I GROUP PLC	23,891	9.162	218,889.340	
SKY PLC	27,100	15.420	417,882.000	
ASHTED GROUP PLC	12,700	23.190	294,513.000	
SAGE GROUP PLC/THE	27,614	5.702	157,455.020	
NATIONAL GRID PLC	87,534	8.103	709,288.000	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,830,965	0.599	1,096,931.130	
RSA INSURANCE GROUP PLC	26,260	6.148	161,446.480	
IMPERIAL BRANDS PLC	24,450	26.925	658,316.250	
CENTRICA PLC	143,660	1.505	216,280.130	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,200	35.760	114,432.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	59,210	36.825	2,180,408.250	
BHP BILLITON PLC	53,977	15.448	833,836.690	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	9,100	23.000	209,300.000	
HSBC HOLDINGS PLC	511,700	6.604	3,379,266.800	
SHIRE PLC	23,174	43.315	1,003,781.810	
ANGLO AMERICAN PLC	32,883	15.020	493,902.660	
MONDI PLC	9,350	21.140	197,659.000	
WM MORRISON SUPERMARKETS	54,900	2.617	143,673.300	
CARNIVAL PLC	4,511	46.180	208,317.980	
EASYJET PLC	4,000	14.610	58,440.000	
COMPASS GROUP PLC	40,639	16.355	664,650.840	
PERSIMMON PLC	7,900	23.920	188,968.000	
BT GROUP PLC	213,400	2.204	470,333.600	
COCA-COLA HBC AG-DI	5,200	25.420	132,184.000	
BURBERRY GROUP PLC	10,489	20.940	219,639.660	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,636	46.140	213,905.040	
TRAVIS PERKINS PLC	5,900	11.325	66,817.500	
INTERTEK GROUP PLC	4,050	50.720	205,416.000	

	ITV PLC	93,100	1.589	147,935.900	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	7,899	46.630	368,330.370	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	118,300	24.625	2,913,137.500	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	96,618	25.005	2,415,933.090	
	MEGGITT PLC	19,500	5.330	103,935.000	
	G4S PLC	37,800	2.333	88,187.400	
	ADMIRAL GROUP PLC	4,950	20.280	100,386.000	
	INVESTEC PLC	16,000	4.881	78,096.000	
	ANTOFAGASTA PLC	9,800	7.764	76,087.200	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	67,157	3.184	213,827.880	
	EXPERIAN PLC	24,054	18.820	452,696.280	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 47,360,366.850 (6,762,586,783)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	186.000	186,000.000	
	FRUTAROM	900	366.000	329,400.000	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,300	4.100	198,030.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	17,600	20.090	353,584.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	458.100	274,860.000	
	BANK HAPOALIM BM	26,600	26.000	691,600.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	35,400	23.240	822,696.000	
	NICE LTD	1,650	417.800	689,370.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,000	64.600	193,800.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 3,739,340.000 (115,209,065)	
オーストラリ ア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	HEALTHSCOPE LTD	45,500	2.110	96,005.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	72,800	2.920	212,576.000	
	BHP BILLITON LIMITED	82,950	31.400	2,604,630.000	
	SOUTH32 LTD	134,100	3.470	465,327.000	
	ALUMINA LTD	62,300	2.760	171,948.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	24,500	35.720	875,140.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	38,800	3.680	142,784.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	10.740	126,732.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	69,850	27.950	1,952,307.500	

WESTPAC BANKING CORP	88,348	27.840	2,459,608.320	
SANTOS LTD	45,200	6.690	302,388.000	
AUSNET SERVICES	41,000	1.605	65,805.000	
AUST AND NZ BANKING GROUP	73,600	28.530	2,099,808.000	
RIO TINTO LTD	10,450	70.300	734,635.000	
ORIGIN ENERGY LTD	46,200	7.690	355,278.000	
AMCOR LIMITED	29,700	14.320	425,304.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	49,500	4.180	206,910.000	
OIL SEARCH LTD	35,300	8.600	303,580.000	
SEEK LTD	8,300	21.510	178,533.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	18,000	18.210	327,780.000	
NEWCREST MINING LTD	19,750	18.690	369,127.500	
INCITEC PIVOT LTD	42,300	3.850	162,855.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	45,350	70.140	3,180,849.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,450	30.190	194,725.500	
ORICA LTD	9,200	16.650	153,180.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	34,300	10.980	376,614.000	
CIMIC GROUP LTD	2,400	48.700	116,880.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	33,900	28.240	957,336.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	9.190	125,903.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	48,400	4.800	232,320.000	
CROWN RESORTS LTD	9,600	13.850	132,960.000	
TELSTRA CORP LTD	104,600	3.120	326,352.000	
AMP LTD	75,000	3.310	248,250.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CD1	11,100	20.870	231,657.000	
MACQUARIE GROUP LTD	8,284	124.520	1,031,523.680	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	14,550	30.220	439,701.000	
BANK OF QUEENSLAND LTD	9,100	11.130	101,283.000	
CSL LTD	11,550	217.160	2,508,198.000	
WESFARMERS LTD	28,895	50.960	1,472,489.200	
COCHLEAR LTD	1,500	204.190	306,285.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	14,400	17.170	247,248.000	
SUNCORP GROUP LTD	34,300	14.890	510,727.000	
BORAL LTD	30,500	6.960	212,280.000	
ASX LTD	5,000	64.630	323,150.000	
COMPUTERSHARE LTD	11,400	18.680	212,952.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	3.480	48,720.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	61,000	7.460	455,060.000	

	SONIC HEALTHCARE LTD	10,400	25.450	264,680.000	
	CHALLENGER LTD	13,900	10.220	142,058.000	
	AGL ENERGY LTD	17,400	20.030	348,522.000	
	BRAMBLES LTD	41,500	10.960	454,840.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	57.990	81,186.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,550	54.260	192,623.000	
	TPG TELECOM LTD	8,700	8.210	71,427.000	
	REA GROUP LTD	1,350	87.000	117,450.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,400	52.330	73,262.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 30,531,752.700 (2,424,526,483)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,100	39.990	283,929.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	500	944.310	472,155.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,096	23.500	119,756.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	5,987	74.650	446,929.550	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	12,000	20.950	251,400.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,550	102.540	364,017.000	
	BCE INC	3,730	53.140	198,212.200	
	FRANCO-NEVADA CORP	4,700	80.100	376,470.000	
	SUNCOR ENERGY INC	41,930	51.660	2,166,103.800	
	METRO INC	6,200	40.720	252,464.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	8,500	64.720	550,120.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	30,500	75.240	2,294,820.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,550	123.300	1,424,115.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	47,500	79.630	3,782,425.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	7,600	31.390	238,564.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	37,150	104.060	3,865,829.000	
	TOURMALINE OIL CORP	6,600	19.570	129,162.000	
	VERMILION ENERGY INC	3,700	40.680	150,516.000	
	TRANSCANADA CORP	23,150	55.870	1,293,390.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	12,729	43.660	555,748.140	
	BOMBARDIER INC-B	53,000	4.290	227,370.000	
	BARRICK GOLD CORP	30,400	13.030	396,112.000	
	CAE INC	6,500	26.740	173,810.000	
	THOMSON REUTERS CORP	7,104	59.030	419,349.120	

EMPIRE CO LTD 'A'	4,600	25.060	115,276.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	85.150	136,240.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,850	64.490	248,286.500	
LINAMAR CORP	1,300	55.080	71,604.000	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	6,400	14.430	92,352.000	
HYDRO ONE LTD	8,400	19.070	160,188.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	68.060	371,607.600	
WSP GLOBAL INC	2,700	73.340	198,018.000	
EMERA INC	1,300	41.270	53,651.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,300	31.320	103,356.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,500	68.020	646,190.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,900	42.950	253,405.000	
KINROSS GOLD CORP	29,500	3.660	107,970.000	
BANK OF MONTREAL	16,300	107.870	1,758,281.000	
POWER CORP OF CANADA	8,600	28.350	243,810.000	
METHANEX CORP	2,200	94.410	207,702.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	2,200	176.080	387,376.000	
NUTRIEN LTD	16,519	71.940	1,188,376.860	
AURORA CANNABIS INC	17,500	8.190	143,325.000	
AUSTRALIS CAPITAL INC	514	3.060	1,572.840	
CAMECO CORP	9,200	12.800	117,760.000	
TELUS CORP	5,400	49.100	265,140.000	
POWER FINANCIAL CORP	6,200	30.060	186,372.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	14,000	29.100	407,400.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,600	161.430	258,288.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	24,800	2.920	72,416.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	31,900	43.100	1,374,890.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	700	695.900	487,130.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,700	69.230	602,301.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,300	99.330	129,129.000	
BLACKBERRY LTD	11,900	12.930	153,867.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	15,850	51.460	815,641.000	
ENBRIDGE INC	43,700	44.990	1,966,063.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	21,550	56.120	1,209,386.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	51,000	23.300	1,188,300.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	8,700	27.420	238,554.000	

	GOLDCORP INC	21,859	13.410	293,129.190	
	ENCANA CORP	24,300	16.440	399,492.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,700	274.270	1,014,799.000	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,500	54.000	135,000.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,600	38.090	213,304.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	18,850	114.200	2,152,670.000	
	CGI GROUP INC - CLASS A	6,500	85.130	553,345.000	
	HUSKY ENERGY INC	8,458	21.700	183,538.600	
	ONEX CORPORATION	2,200	89.990	197,978.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	11,600	25.170	291,972.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	4,400	30.000	132,000.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	53.450	240,525.000	
	IGM FINANCIAL INC	1,900	35.790	68,001.000	
	OPEN TEXT CORP	7,000	50.550	353,850.000	
	CI FINANCIAL CORP	7,000	20.570	143,990.000	
	SAPUTO INC	5,800	38.640	224,112.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,700	14.750	261,075.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	11,000	66.010	726,110.000	
	FORTIS INC	11,000	42.950	472,450.000	
	LUNDIN MINING CORP	16,100	6.200	99,820.000	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	13,300	7.020	93,366.000	
	CENOVUS ENERGY INC	27,200	11.610	315,792.000	
	DOLLARAMA INC	7,800	50.290	392,262.000	
	ATCO LTD -CLASS I	1,700	37.650	64,005.000	
	ALTAGAS LTD	6,900	23.630	163,047.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	3,800	20.340	77,292.000	
	KEYERA CORP	5,300	34.590	183,327.000	
	INTER PIPELINE LTD	9,500	23.190	220,305.000	
	ARC RESOURCES LTD	8,300	13.000	107,900.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 46,168,448.900 (3,876,764,654)	
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	34,500	26.210	904,245.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	46,000	24.580	1,130,680.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	13,670	9.580	130,958.600	
	KEPPEL CORP LTD	36,300	6.390	231,957.000	

	UOL GROUP LTD	14,000	6.730	94,220.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,400	8.800	91,520.000	
	CAPITALAND LTD	63,000	3.300	207,900.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	56,800	1.080	61,344.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	2.760	113,160.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	30.880	83,376.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	79,000	11.120	878,480.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	153,000	1.080	165,240.000	
	VENTURE CORP LTD	7,200	16.880	121,536.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	213,450	3.140	670,233.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	39,500	3.300	130,350.000	
	SEBICORP INDUSTRIES LTD	22,700	2.730	61,971.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.275	45,210.000	
	SATS LTD	16,000	5.030	80,480.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,800	7.360	153,088.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	55,300	2.270	125,531.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	49,200	3.140	154,488.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 5,635,967.600 (453,019,076)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFREY AG-REG	850	114.700	97,495.000	
	UBS GROUP AG-REG	97,700	15.300	1,494,810.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	200	602.000	120,400.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,900	57.680	224,952.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	18,090	235.300	4,256,577.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	950	76.350	72,532.500	
	SIKA AG-REG	3,360	136.500	458,640.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	77,500.000	232,500.000	
	ABB LTD-REG	47,300	22.620	1,069,926.000	
	SWISS RE AG	8,050	87.980	708,239.000	
	NESTLE SA-REG	79,100	79.960	6,324,836.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	450	744.500	335,025.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,050	228.000	239,400.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	65,120	14.560	948,147.200	

	JULIUS BAER GROUP LTD	5,550	50.200	278,610.000	
	SGS SA-REG	140	2,523.000	353,220.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	500	223.400	111,700.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,200	169.600	203,520.000	
	TEMENOS AG - REG	1,550	149.400	231,570.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	790	386.100	305,019.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,932	296.800	1,167,017.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,200	148.000	177,600.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	23.470	133,779.000	
	NOVARTIS AG-REG	56,150	78.680	4,417,882.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	60	1,764.000	105,840.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	13,560	82.280	1,115,716.800	
	SWISSCOM AG-REG	660	431.100	284,526.000	
	GEBERIT AG-REG	910	432.500	393,575.000	
	GIVAUDAN-REG	240	2,320.000	556,800.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	270	739.500	199,665.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,420	194.550	276,261.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,930	305.100	588,843.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,300	74.400	96,720.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	12,290	45.000	553,050.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	900	352.000	316,800.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,350	155.400	209,790.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,850	87.500	161,875.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	25	6,610.000	165,250.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 28,988,109.100 (3,318,558,730)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クロー ナ	
	ICA GRUPPEN AB	1,900	270.600	514,140.000	
	ERICSSON LM-B SHS	78,130	78.880	6,162,894.400	
	VOLVO AB-B SHS	40,400	154.650	6,247,860.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,500	505.500	758,250.000	
	SKF AB-B SHARES	9,750	168.650	1,644,337.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	5,950	194.500	1,157,275.000	
	NORDEA BANK AB	79,400	97.700	7,757,380.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,600	476.000	2,189,600.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	114.350	1,023,432.500	

SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	41,450	98.300	4,074,535.000	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	39,450	109.900	4,335,555.000	
SWEDBANK AB - A SHARES	23,500	213.000	5,005,500.000	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	23,550	123.120	2,899,476.000	
SKANSKA AB-B SHS	8,350	168.500	1,406,975.000	
SANDVIK AB	29,850	152.350	4,547,647.500	
INVESTOR AB-B SHS	11,750	408.200	4,796,350.000	
ATLAS COPCO AB-A SHS	17,350	254.000	4,406,900.000	
SECURITAS AB-B SHS	7,400	156.600	1,158,840.000	
TELIA CO AB	71,600	39.870	2,854,692.000	
ALFA LAVAL AB	7,000	238.600	1,670,200.000	
ATLAS COPCO AB-B SHS	9,700	235.500	2,284,350.000	
ASSA ABLOY AB-B	25,900	184.000	4,765,600.000	
LUNDBERGS AB-B SHS	1,800	296.000	532,800.000	
LUNDIN PETROLEUM AB	4,650	305.700	1,421,505.000	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	15,700	234.400	3,680,080.000	
BOLIDEN AB	7,000	232.300	1,626,100.000	
EPIROC AB-A	16,550	93.130	1,541,301.500	
EPIROC AB-B	9,700	85.560	829,932.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	9,750	73.280	714,480.000	
KINNEVIK AB - B	6,050	287.900	1,741,795.000	
HEXAGON AB-B SHS	6,500	526.600	3,422,900.000	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,000	189.200	756,800.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 87,929,483.400 (1,067,463,929)	
デンマーク・クローネ	株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
NOVO NORDISK A/S-B	46,400	306.850	14,237,840.000	
DANSKE BANK A/S	18,800	184.750	3,473,300.000	
ISS A/S	3,900	218.100	850,590.000	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	8,650.000	821,750.000	
H LUNDBECK A/S	1,700	368.400	626,280.000	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,250	430.200	2,258,550.000	
CARLSBERG AS-B	2,750	770.200	2,118,050.000	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,800	343.700	1,993,460.000	
COLOPLAST-B	3,100	666.000	2,064,600.000	
DSV A/S	4,750	598.000	2,840,500.000	

	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,675	251.800	673,565.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	160	9,256.000	1,480,960.000	
	TRYG A/S	3,300	156.300	515,790.000	
	PANDORA A/S	2,750	391.600	1,076,900.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,550	622.600	1,587,630.000	
	GENMAB A/S	1,550	1,055.000	1,635,250.000	
	ORSTED A/S	4,700	399.300	1,876,710.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 40,131,725.000 (691,068,304)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	34,500	3.220	111,090.000	
	A2 MILK CO LTD	19,000	11.880	225,720.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.885	204,696.760	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	6.880	160,992.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	6.200	124,620.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	15,100	14.790	223,329.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,800	13.300	117,040.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 1,167,487.760 (84,829,661)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	35,200	47.110	1,658,272.000	
	DNB ASA	25,150	170.700	4,293,105.000	
	ORKLA ASA	20,850	68.700	1,432,395.000	
	TELENOR ASA	18,600	159.700	2,970,420.000	
	EQUINOR ASA	30,123	210.800	6,349,928.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,560	378.500	1,725,960.000	
	MARINE HARVEST	9,900	182.800	1,809,720.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,850	139.300	675,605.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,400	267.500	642,000.000	
	AKER BP ASA	2,900	284.600	825,340.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 22,382,745.400 (293,661,619)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	

BAYER AG-REG	24,150	74.890	1,808,593.500	
EVONIK INDUSTRIES AG	4,250	31.000	131,750.000	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	50,650	9.764	494,546.600	
COMMERZBANK AG	26,335	8.296	218,475.160	
VOLKSWAGEN AG	800	134.000	107,200.000	
VOLKSWAGEN AG-PREF	4,820	136.240	656,676.800	
MAN SE	850	93.450	79,432.500	
SIEMENS AG-REG	19,500	108.540	2,116,530.000	
E.ON SE	57,000	8.897	507,129.000	
UNIPER SE	4,900	25.730	126,077.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8,650	80.730	698,314.500	
GEA GROUP AG	4,500	31.570	142,065.000	
OSRAM LICHT AG	2,560	35.900	91,904.000	
CONTINENTAL AG	2,820	151.400	426,948.000	
BASF SE	23,350	76.830	1,793,980.500	
K+S AG-REG	4,800	18.495	88,776.000	
ALLIANZ SE-REG	11,210	180.540	2,023,853.400	
THYSSENKRUPP AG	10,700	19.365	207,205.500	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,650	106.500	495,225.000	
RWE AG	13,150	21.570	283,645.500	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,100	22.330	136,213.000	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,000	77.260	77,260.000	
BRENNTAG AG	3,950	52.000	205,400.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	10,500	63.620	668,010.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,000	43.270	129,810.000	
HOCHTIEF AG	450	136.400	61,380.000	
SAP SE	25,342	98.760	2,502,775.920	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,980	184.750	735,305.000	
SCHAEFFLER AG	3,800	10.430	39,634.000	
ZALANDO SE	2,900	40.920	118,668.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,700	67.420	249,454.000	
KION GROUP AG	1,850	55.920	103,452.000	
WIRECARD AG	2,950	184.500	544,275.000	
COVESTRO AG	4,900	69.320	339,668.000	
INNOGY SE	3,400	37.550	127,670.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	950	144.600	137,370.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	4,000	52.220	208,880.000	

DELIVERY HERO SE	2,500	45.440	113,600.000	
METRO AG	4,100	13.520	55,432.000	
1&1 DRILLISCH AG	1,300	42.180	54,834.000	
LINDE AG - TENDER	4,780	188.850	902,703.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,000	38.095	152,380.000	
BEIERSDORF AG	2,550	97.420	248,421.000	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,700	48.560	82,552.000	
MERCK KGAA	3,250	87.680	284,960.000	
ADIDAS AG	4,810	206.100	991,341.000	
PUMA SE	206	438.500	90,331.000	
HENKEL AG & CO KGAA	2,650	92.800	245,920.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	85,400	13.435	1,147,349.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,550	85.800	476,190.000	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	23,850	54.320	1,295,532.000	
QIAGEN N.V.	5,598	32.490	181,879.020	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	28,750	20.470	588,512.500	
HANNOVER RUECK SE	1,500	118.500	177,750.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	25,450	30.810	784,114.500	
DEUTSCHE BOERSE AG	4,900	116.700	571,830.000	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	5,950	21.930	130,483.500	
LANXESS AG	2,200	65.640	144,408.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,330	184.200	244,986.000	
AXEL SPRINGER SE	1,200	60.750	72,900.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	9,400	43.010	404,294.000	
SYMRISE AG	3,200	77.180	246,976.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	18,800	3.512	66,025.600	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,350	69.400	93,690.000	
HUGO BOSS AG -ORD	1,590	67.980	108,088.200	
RTL GROUP	1,000	62.200	62,200.000	
VONOVIA SE	12,750	42.860	546,465.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	23,726	37.145	881,302.270	
NN GROUP NV	7,600	37.130	282,188.000	
ARCELORMITTAL	16,900	24.715	417,683.500	
UNILEVER NV-CVA	40,300	47.405	1,910,421.500	
HEINEKEN NV	6,700	82.760	554,492.000	
RELX NV	24,719	18.685	461,874.510	

AEGON NV	44,744	5.202	232,758.280
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZEN	31,983	20.850	666,845.550
AKZO NOBEL	6,600	81.520	538,032.000
KONINKLIJKE DSM NV	4,550	87.000	395,850.000
WOLTERS KLUWER	7,300	53.260	388,798.000
ING GROEP NV	100,250	11.496	1,152,474.000
KONINKLIJKE KPN NV	84,250	2.190	184,507.500
ASML HOLDING NV	10,600	159.660	1,692,396.000
ABN AMRO GROUP NV-CVA	10,300	23.380	240,814.000
VOPAK	1,900	42.930	81,567.000
RANDSTAD NV	2,850	51.680	147,288.000
HEINEKEN HOLDING NV	2,850	80.300	228,855.000
JCDECAUX SA	1,900	29.220	55,518.000
TOTAL SA	61,250	52.030	3,186,837.500
MICHELIN (CGDE)	4,500	99.620	448,290.000
AIR LIQUIDE SA	10,982	105.100	1,154,208.200
KERING	1,930	430.100	830,093.000
SCHNEIDER ELECTRIC SE	14,100	67.840	956,544.000
BOUYGUES SA	5,600	35.100	196,560.000
BNP PARIBAS	28,750	50.990	1,465,962.500
PEUGEOT SA	15,450	22.970	354,886.500
NATIXIS	22,950	5.804	133,201.800
THALES SA	2,680	117.800	315,704.000
DANONE	15,800	65.420	1,033,636.000
CARREFOUR SA	14,900	15.185	226,256.500
SUEZ	8,875	12.215	108,408.120
VIVENDI	27,191	21.550	585,966.050
L'OREAL	6,450	197.250	1,272,262.500
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	13,050	35.860	467,973.000
LEGRAND SA	6,867	63.040	432,895.680
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,300	27.570	35,841.000
PERNOD RICARD SA	5,417	132.750	719,106.750
SOCIETE BIC SA	700	76.250	53,375.000
EURAZEO SA	1,195	64.600	77,197.000
REXEL SA	7,850	13.525	106,171.250
SOCIETE GENERALE SA	20,050	35.900	719,795.000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,120	280.650	1,998,228.000

ACCOR SA	4,650	42.680	198,462.000	
CAPGEMINI SE	4,220	105.050	443,311.000	
VALEO SA	5,950	36.980	220,031.000	
PUBLICIS GROUPE	5,250	50.980	267,645.000	
BUREAU VERITAS SA	6,500	21.970	142,805.000	
EIFFAGE	2,000	97.320	194,640.000	
SODEXO SA	2,300	88.240	202,952.000	
IPSEN	1,000	147.050	147,050.000	
INGENICO GROUP	1,600	58.220	93,152.000	
AMUNDI SA	1,500	62.220	93,330.000	
TELEPERFORMANCE	1,500	166.000	249,000.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,000	86.860	173,720.000	
FAURECIA	1,900	51.000	96,900.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	290	464.400	134,676.000	
SEB SA	560	156.900	87,864.000	
ESSILOR INTERNATIONAL	5,430	118.900	645,627.000	
DASSAULT AVIATION SA	60	1,536.000	92,160.000	
AXA SA	49,500	21.965	1,087,267.500	
EDENRED	5,950	33.390	198,670.500	
RENAULT SA	5,000	71.840	359,200.000	
HERMES INTERNATIONAL	820	528.800	433,616.000	
STMICROELECTRONICS NV	17,350	16.240	281,764.000	
REMY COINTREAU	550	116.300	63,965.000	
ATOS SE	2,500	99.220	248,050.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,380	128.500	434,330.000	
WENDEL	680	128.100	87,108.000	
ORANGE	52,050	13.500	702,675.000	
ALSTOM	4,050	37.650	152,482.500	
CNP ASSURANCES	4,300	19.730	84,839.000	
SANOFI	28,725	72.270	2,075,955.750	
VINCI SA	13,050	80.400	1,049,220.000	
AIRBUS SE	14,800	104.280	1,543,344.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,650	17.875	243,993.750	
CREDIT AGRICOLE SA	30,100	12.268	369,266.800	
BIOMERIEUX	1,000	76.400	76,400.000	
ENGIE	47,873	12.280	587,880.440	
IMERYS SA	900	60.550	54,495.000	
EDF	15,050	14.215	213,935.750	
SES	9,000	16.570	149,130.000	

SAFRAN SA	8,550	116.050	992,227.500	
ILIAD SA	650	104.850	68,152.500	
ARKEMA	1,770	104.200	184,434.000	
ADP	740	190.100	140,674.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	20.100	81,405.000	
SCOR SE	4,150	37.240	154,546.000	
GETLINK	11,250	10.815	121,668.750	
BOLLORE	21,300	3.758	80,045.400	
UCB SA	3,250	76.460	248,495.000	
KBC GROUP NV	6,500	62.700	407,550.000	
COLRUYT SA	1,600	50.400	80,640.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,000	87.740	175,480.000	
SOLVAY SA	1,950	111.000	216,450.000	
UMICORE	5,400	45.750	247,050.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	19,350	77.450	1,498,657.500	
AGEAS	4,540	44.500	202,030.000	
PROXIMUS	3,500	19.910	69,685.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,200	47.400	56,880.000	
PRYSMIAN SPA	6,150	21.570	132,655.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	31,343	14.825	464,659.970	
MEDIOBANCA SPA	15,265	8.682	132,530.730	
TENARIS SA	12,000	13.780	165,360.000	
UNICREDIT SPA	51,456	13.088	673,456.120	
TELECOM ITALIA SPA	282,782	0.523	148,008.090	
TELECOM ITALIA-RSP	146,950	0.464	68,317.050	
INTESA SANPAOLO	382,237	2.300	879,145.100	
ATLANTIA SPA	12,407	18.160	225,311.120	
POSTE ITALIANE SPA	13,500	7.012	94,662.000	
MONCLER SPA	4,700	37.100	174,370.000	
RECORDATI SPA	2,600	30.050	78,130.000	
ENI SPA	65,200	15.826	1,031,855.200	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	14,300	7.410	105,963.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	6.740	74,140.000	
LEONARDO SPA	9,525	9.768	93,040.200	
ENEL SPA	208,434	4.378	912,524.050	
SNAM SPA	56,600	3.636	205,797.600	
LUXOTTICA GROUP SPA	4,500	54.600	245,700.000	
TERNA SPA	34,900	4.675	163,157.500	
EXOR NV	2,680	55.400	148,472.000	

CNH INDUSTRIAL NV	25,200	10.025	252,630.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	28,550	14.400	411,120.000	
FERRARI NV	3,145	109.000	342,805.000	
TELEFONICA SA	121,827	6.742	821,357.630	
ENDESA SA	7,650	19.420	148,563.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	170,612	5.228	891,959.530	
IBERDROLA SA	153,034	6.300	964,114.200	
BANCO DE SABADELL SA	144,909	1.340	194,178.060	
BANKINTER SA	16,600	7.768	128,948.800	
REPSOL SA	35,150	16.330	573,999.500	
GRIFOLS SA	7,750	24.310	188,402.500	
BANCO SANTANDER SA	410,250	4.228	1,734,742.120	
AMADEUS IT GROUP SA	11,350	76.060	863,281.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,050	23.220	210,141.000	
MAPFRE SA	25,450	2.540	64,643.000	
CAIXABANK S.A	94,100	3.991	375,553.100	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE- DI	15,200	7.584	115,276.800	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,726	34.960	235,140.960	
AENA SME SA	1,700	147.600	250,920.000	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	28,500	25.010	712,785.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	5,600	12.490	69,944.000	
ENAGAS SA	5,400	24.000	129,600.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,700	18.120	193,884.000	
FERROVIAL SA	12,300	18.010	221,523.000	
BANKIA SA	30,105	3.380	101,754.900	
UPM-KYMMENE OYJ	13,700	32.570	446,209.000	
NOKIA OYJ	146,750	4.653	682,827.750	
WARTSILA OYJ ABP	10,800	16.760	181,008.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	13,800	15.275	210,795.000	
METSO OYJ	2,800	28.470	79,716.000	
ELISA OYJ	3,650	36.780	134,247.000	
SAMPO OYJ-A SHS	11,100	43.650	484,515.000	
FORTUM OYJ	11,150	21.300	237,495.000	
KONE OYJ-B	8,800	45.150	397,320.000	

	NOKIAN RENKAAT OYJ	3,050	34.790	106,109.500	
	NESTE OYJ	3,150	70.580	222,327.000	
	ORION OYJ-CLASS B	2,450	30.080	73,696.000	
	OMV AG	3,550	44.830	159,146.500	
	ERSTE GROUP BANK AG	7,400	34.660	256,484.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	36.760	104,766.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	23.720	80,648.000	
	ANDRITZ AG	2,100	49.980	104,958.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,000	35.660	213,960.000	
	AIB GROUP PLC	20,000	4.700	94,000.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	23,660	7.215	170,706.900	
	JERONIMO MARTINS	6,000	12.430	74,580.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	66,000	3.294	217,404.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	11,650	16.405	191,118.250	
	KERRY GROUP PLC-A	4,220	95.950	404,909.000	
	CRH PLC	22,300	28.280	630,644.000	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	2,200	76.550	168,410.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 98,392,271.530 (12,630,615,896)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	35,000	55.000	1,925,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	61,000	54.050	3,297,050.000	
	MTR CORP	38,000	39.800	1,512,400.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	42,000	111.700	4,691,400.000	
	SINO LAND CO	82,000	12.920	1,059,440.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	68,669	89.450	6,142,442.050	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	21.700	694,400.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	12,500	86.100	1,076,250.000	
	CLP HOLDINGS LTD	43,500	90.100	3,919,350.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	32,916	39.350	1,295,244.600	
	HANG LUNG GROUP LTD	21,000	20.900	438,900.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	239,181	15.780	3,774,276.180	
	HANG SENG BANK LTD	19,600	203.200	3,982,720.000	
	WHEELOCK & CO LTD	20,000	47.650	953,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	159,000	10.040	1,596,360.000	
	WH GROUP LTD	222,500	5.760	1,281,600.000	

HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	30,300	217.400	6,587,220.000	
MINTH GROUP LTD	18,000	29.600	532,800.000	
LI & FUNG LTD	152,000	2.080	316,160.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	50,000	15.100	755,000.000	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	7,600	78.850	599,260.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	19,000	21.900	416,100.000	
NWS HOLDINGS LTD	35,500	13.580	482,090.000	
KERRY PROPERTIES LTD	17,500	27.850	487,375.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	32,640	28.100	917,184.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	17,000	38.600	656,200.000	
SJM HOLDINGS LTD	47,000	8.180	384,460.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	28,800	29.700	855,360.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	66,669	56.250	3,750,131.250	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	16,000	58.750	940,000.000	
PCCW LTD	95,000	4.210	399,950.000	
AIA GROUP LTD	308,800	64.500	19,917,600.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	33,000	49.900	1,646,700.000	
SANDS CHINA LTD	64,400	35.700	2,299,080.000	
SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	11.920	357,600.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	35,500	47.650	1,691,575.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	23,600	13.880	327,568.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	96,000	36.600	3,513,600.000	
WYNN MACAU LTD	38,000	19.840	753,920.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 86,226,766.080 (1,214,072,866)	
合計			102,362,743,718 [102,362,743,718]	

(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	3,447	635,075.280	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,937	1,464,535.240	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,000	519,560.000	
		VORNADO REALTY TRUST	4,347	330,850.170	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,850	450,471.000	

EQUITY RESIDENTIAL	9,400	639,106.000	
EQUINIX INC	1,998	862,436.700	
AMERICAN TOWER CORP	11,150	1,651,203.500	
HOST HOTELS & RESORTS INC	18,593	395,473.110	
KIMCO REALTY CORP	10,000	174,800.000	
INVITATION HOMES INC	7,400	172,568.000	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,279	122,126.550	
VENTAS INC	9,150	550,098.000	
WEYERHAEUSER CO	19,064	658,470.560	
AGNC INVESTMENT CORP	12,300	235,914.000	
CROWN CASTLE INTL CORP	10,600	1,211,898.000	
IRON MOUNTAIN INC	6,760	245,185.200	
VEREIT INC	24,400	190,564.000	
PROLOGIS INC	15,862	1,065,609.160	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,570	330,527.700	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2,350	221,652.000	
DUKE REALTY CORP	8,700	248,211.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,700	418,727.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,850	242,794.000	
WELLTOWER INC	9,200	620,632.000	
HCP INC	11,300	304,874.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,600	156,672.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,750	285,065.000	
MACERICH CO/THE	2,900	165,909.000	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	28,100	296,736.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3,750	173,137.500	
REALTY INCOME CORP	7,150	420,348.500	
PUBLIC STORAGE	4,000	859,000.000	
REGENCY CENTERS CORP	3,700	245,569.000	
SL GREEN REALTY CORP	2,400	247,152.000	
UDR INC	6,800	272,884.000	
DIGITAL REALTY TRUST INC	5,250	652,102.500	
EXTRA SPACE STORAGE INC	3,250	301,307.500	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 18,039,245.170 (1,993,516,984)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
LAND SECURITIES GROUP PLC	18,062	160,209.940	

	SEGRO PLC	25,750	167,581.000	
	HAMMERSON PLC	19,200	85,516.800	
	BRITISH LAND CO PLC	23,400	143,769.600	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 557,077.340 (79,545,073)	
オーストラリア・ドル	LENLEASE GROUP	14,900	290,550.000	
	TRANSURBAN GROUP-RIGHT	10,192	6,726.720	
	TRANSURBAN GROUP	58,100	664,083.000	
	SYDNEY AIRPORT	27,500	201,575.000	
	APA GROUP	31,200	300,768.000	
	SCENTRE GROUP	135,822	560,944.860	
	DEXUS	25,850	277,629.000	
	GPT GROUP	47,560	245,409.600	
	MIRVAC GROUP	91,400	225,758.000	
	STOCKLAND	61,500	259,530.000	
	GOODMAN GROUP	43,900	461,389.000	
	VICINITY CENTRES	83,173	227,894.020	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 3,722,257.200 (295,584,444)	
カナダ・ドル	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,500	47,070.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,700	74,666.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,900	98,553.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 220,289.000 (18,497,667)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	60,100	105,175.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	62,500	168,125.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	63,200	133,984.000	
	SUNTEC REIT	63,000	117,810.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 525,094.000 (42,207,056)	
ユーロ			ユーロ	

	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,610	624,746.600	
	ICADE	800	66,040.000	
	GECINA SA	1,250	183,625.000	
	KLEPIERRE	5,650	170,856.000	
	COVIVIO	970	86,863.500	
ユーロ 小計			ユーロ 1,132,131.100 (145,331,670)	
香港・ドル	LINK REIT	57,000	4,312,050.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	64,500	509,550.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	99,000	991,980.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 5,813,580.000 (81,855,206)	
投資証券 合計			2,656,538,100 [2,656,538,100]	
合計			2,656,538,100 [2,656,538,100]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 597銘柄	97.2%	2.8%	67.9%
	投資証券 38銘柄			
イギリス・ポンド	株式 97銘柄	98.8%	1.2%	6.5%
	投資証券 4銘柄			
イスラエル・シュケル	株式 9銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 56銘柄	89.1%	10.9%	2.6%
	投資証券 12銘柄			
カナダ・ドル	株式 89銘柄	99.5%	0.5%	3.7%
	投資証券 3銘柄			
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	91.5%	8.5%	0.5%
	投資証券 4銘柄			
スイス・フラン	株式 38銘柄	100%	-%	3.2%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	100%	-%	1.0%

デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	100%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	100%	-%	0.3%
ユーロ	株式	239銘柄	98.9%	1.1%	12.2%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	株式	39銘柄	93.7%	6.3%	1.2%
	投資証券	3銘柄			

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	38,641,770	68,262,420
金銭信託	-	983,417
コール・ローン	34,191,203	39,719,226
株式	3,415,731,319	4,975,961,569
投資証券	229,607,180	450,313,402
派生商品評価勘定	-	331,071
未収入金	-	438,074
未収配当金	8,568,445	15,618,459
差入委託証拠金	7,268,284	25,976,790
流動資産合計	3,734,008,201	5,577,604,428
資産合計	3,734,008,201	5,577,604,428
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	720	1,752,334
未払金	12,004,673	40,811,781
未払解約金	8,540,000	4,820,000

その他未払費用		47,488	69,768
流動負債合計		20,592,881	47,453,883
負債合計		20,592,881	47,453,883
純資産の部			
元本等			
元本	1	2,419,936,327	3,687,560,092
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,293,478,993	1,842,590,453
元本等合計		3,713,415,320	5,530,150,545
純資産合計		3,713,415,320	5,530,150,545
負債純資産合計		3,734,008,201	5,577,604,428

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7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29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1. 1 期首	平成28年9月8日	平成29年9月8日
期首元本額	1,433,488,534円	2,419,936,327円
期中追加設定元本額	2,077,732,404円	1,573,745,055円
期中一部解約元本額	1,091,284,611円	306,121,290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 株式インデックス エマー ジ ングプラス（為替ヘッジな し）	135,933,285円	215,019,194円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替 ヘッジなし）	84,478,264円	203,771,119円
D - I ' s 新興国株式イン デックス	53,056,467円	80,737,476円
i F r e e 新興国株式イン デックス	670,671,594円	1,152,779,835円
i F r e e 8資産バランス	357,159,953円	755,702,065円
D Cダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデックス ファンド	775,909,030円	862,179,482円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国株式	300,378,480円	354,139,398円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	42,349,254円	63,231,523円
計	2,419,936,327円	3,687,560,092円
2. 期末日における受益権の総数	2,419,936,327口	3,687,560,092口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	218,506,023	24,487,656
投資証券	11,255,611	2,895,917
合計	229,761,634	21,591,739

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年7月6日から平成29年9月7日まで、及び平成30年7月6日から平成30年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	平成29年9月7日 現在				平成30年9月7日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引								
株値指数 先物取引								
買 建	-	-	-	-	57,973,546	-	56,332,473	1,641,073
合計	-	-	-	-	57,973,546	-	56,332,473	1,641,073

（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。

- 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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
- 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種 類	平成29年9月7日 現在			平成30年9月7日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	17,014,080	-	16,884,000	130,080
香港・ドル	-	-	-	-	17,014,080	-	16,884,000	130,080
買 建	21,836,720	-	21,836,000	720	38,566,270	-	38,656,000	89,730
アメリカ・ドル	21,836,720	-	21,836,000	720	38,566,270	-	38,656,000	89,730
合計	21,836,720	-	21,836,000	720	55,580,350	-	55,540,000	219,810

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.5345円	1.4997円
(1万口当たり純資産額)	(15,345円)	(14,997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	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	15,100	5.420	81,842.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	900	159.870	143,883.000	
	BAIDU INC - SPON ADR	500	215.050	107,525.000	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	16,850	7.530	126,880.500	
	JD.COM INC-ADR	1,200	27.250	32,700.000	
	NETEASE INC-ADR	100	191.190	19,119.000	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	900	38.980	35,082.000	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	79,714	1.220	97,251.080	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,290	68.200	224,378.000	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	14,050	3.950	55,497.500	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	6,700	16.250	108,875.000	
	SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	12,020	2.298	27,621.960	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	10,760	14.150	152,254.000	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	32,910	0.849	27,940.590	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	41,930	10.260	430,201.800	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	860	173.500	149,210.000	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	14,870	66.560	989,747.200	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	38,040	6.270	238,510.800	
	GAZPROM PAO -SPON ADR	266,010	4.250	1,130,542.500	
SEVERSTAL - GDR REG S	3,930	15.310	60,168.300		
TATNEFT-PREF 3 SERIES	2,000	7.625	15,251.100		
ALROSA PJSC	31,590	1.453	45,905.670		
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	17,509	1.375	24,085.740		
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	17,700	1.157	20,478.900		
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 4,344,951.640 (480,160,604)	
インド・ルピー		株	インド・ルピー	インド・ルピー	
	RAJESH EXPORTS LTD	3,400	674.600	2,293,640.000	

TATA STEEL LTD	5,320	600.300	3,193,596.000	
AXIS BANK LTD	17,810	638.200	11,366,342.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	400	8,759.850	3,503,940.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	2,260	1,608.600	3,635,436.000	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	19,870	251.850	5,004,259.500	
STATE BANK OF INDIA	42,820	296.450	12,693,989.000	
NTPC LTD	40,950	168.900	6,916,455.000	
JSW STEEL LTD	11,360	398.800	4,530,368.000	
INDIAN OIL CORP LTD	65,280	153.600	10,027,008.000	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	24,685	353.600	8,728,616.000	
IDEA CELLULAR LTD	30,430	46.550	1,416,516.500	
YES BANK LTD	9,450	339.200	3,205,440.000	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	8,700	144.200	1,254,540.000	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	20,020	117.550	2,353,351.000	
COAL INDIA LTD	27,050	283.650	7,672,732.500	
BHARTI INFRATEL LTD	7,240	270.950	1,961,678.000	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	2,530	1,211.250	3,064,462.500	
GAIL INDIA LTD	6,493	365.600	2,373,840.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	21,680	235.400	5,103,472.000	
GRASIM INDUSTRIES LTD	2,640	1,030.900	2,721,576.000	
WIPRO LTD	9,720	321.200	3,122,064.000	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	6,586	2,075.300	13,667,925.800	
INFOSYS LTD	34,420	727.150	25,028,503.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	2,552	1,347.100	3,437,799.200	
TATA MOTORS LTD	27,530	269.950	7,431,723.500	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	9,220	1,956.150	18,035,703.000	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	33,980	1,261.400	42,862,372.000	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	74,175	174.500	12,943,537.500	
ITC LTD	19,830	310.800	6,163,164.000	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	6,450	934.950	6,030,427.500	
HERO MOTOCORP LTD	770	3,164.850	2,436,934.500	
BHARTI AIRTEL LTD	18,280	372.300	6,805,644.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	5,520	677.400	3,739,248.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	3,990	1,088.800	4,344,312.000	
VEDANTA LTD	25,390	229.900	5,837,161.000	
インド・ルピー 小計			インド・ルピー 264,907,777.800 (410,607,055)	

インドネシア・ルピア		株	インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
	UNITED TRACTORS TBK PT	15,100	33,000.000	498,300,000.000	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	223,100	6,800.000	1,517,080,000.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	63,500	5,950.000	377,825,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	641,300	3,360.000	2,154,768,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	79,000	7,275.000	574,725,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	51,500	24,700.000	1,272,050,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	210,800	6,550.000	1,380,740,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	298,700	2,020.000	603,374,000.000	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	552,400	2,960.000	1,635,104,000.000		
インドネシア・ルピア 小計				インドネシア・ルピア 10,013,966,000.000 (75,104,745)	
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	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	32,500	1.080	35,100.000		
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 35,100.000 (2,821,338)	
タイ・パーツ		株	タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	7,300	210.000	1,533,000.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	13,900	440.000	6,116,000.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	16,400	212.000	3,476,800.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	11,700	210.000	2,457,000.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	38,500	144.500	5,563,250.000	
	THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	21,100	53.000	1,118,300.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	20,000	198.000	3,960,000.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	141,200	19.200	2,711,040.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	74,800	19.800	1,481,040.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	33,500	140.500	4,706,750.000	
	IRPC PCL - NVDR	155,800	6.750	1,051,650.000	
	BANGCHAK CORP PCL-NVDR	29,100	35.250	1,025,775.000	
PTT PCL-NVDR	337,900	50.500	17,063,950.000		

	THAI OIL PCL-NVDR	19,300	86.250	1,664,625.000	
	CP ALL PCL-NVDR	31,800	67.000	2,130,600.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	128,600	26.000	3,343,600.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	40,100	78.500	3,147,850.000	
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 62,551,230.000 (210,797,645)	
チリ・ペソ		株	チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	ENEL CHILE SA	487,797	65.670	32,033,628.990	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	475	42,627.000	20,247,825.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	4,090	6,011.700	24,587,853.000	
	CENCOSUD SA	27,870	1,521.500	42,404,205.000	
	BANCO SANTANDER CHILE	752,680	52.010	39,146,886.800	
	ENEL AMERICAS SA	346,820	98.450	34,144,429.000	
	EMPRESAS CMPC SA	13,820	2,635.800	36,426,756.000	
	S.A.C.I. FALABELLA	4,110	5,241.600	21,542,976.000	
	EMPRESAS COPEC SA	3,700	10,249.000	37,921,300.000	
	BANCO DE CHILE	270,262	97.310	26,299,195.220	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ 314,755,055.010 (50,455,235)	
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	36,800	6.010	221,168.000	
	AKBANK T.A.S.	40,850	5.600	228,760.000	
	TURKIYE IS BANKASI-C	41,120	3.980	163,657.600	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,430	10.300	200,129.000	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,870	126.200	362,194.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	19,741	11.260	222,283.660	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	29,440	7.080	208,435.200	
	TURKIYE HALK BANKASI	29,490	6.060	178,709.400	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T- D	27,170	3.370	91,562.900	
	KOC HOLDING AS	20,315	14.930	303,302.950	
	TURK HAVA YOLLARI AO	10,870	17.060	185,442.200	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,270	72.000	163,440.000	
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ	

				2,529,084.910	
				(42,438,044)	
ブラジル・リアル		株	ブラジル・リアル	ブラジル・リアル	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	1,200	19.100	22,920.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	12,100	19.480	235,708.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	104,600	18.990	1,986,354.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	63,934	28.440	1,818,282.960	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	61,024	42.600	2,599,622.400	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	15,700	8.350	131,095.000	
	VALE SA	61,590	53.480	3,293,833.200	
	GERDAU SA-PREF	25,500	15.860	404,430.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	81,600	21.920	1,788,672.000	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	78,397	7.250	568,378.250	
	ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	37,541	9.700	364,147.700	
	BRASKEM SA-PREF A	3,500	61.660	215,810.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	5,600	18.830	105,448.000	
	BANCO DO BRASIL S.A.	45,100	29.330	1,322,783.000	
	COSAN SA	2,600	34.420	89,492.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	7,900	16.050	126,795.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	5,900	20.690	122,071.000	
	EMBRAER SA	12,700	19.710	250,317.000	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	59,600	7.770	463,092.000	
	CCR SA	14,000	9.370	131,180.000	
	BRF SA	15,700	21.520	337,864.000	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,700	24.500	139,650.000	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	7,700	17.050	131,285.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	12,326	11.890	146,556.140	
	TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	10,100	40.970	413,797.000	
	LOJAS RENNER S.A.	3,850	28.820	110,957.000	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	6,600	15.130	99,858.000	
	JBS SA	61,100	9.260	565,786.000	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	4,900	54.420	266,658.000	

	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	12,000	21.840	262,080.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	11,308	9.300	105,164.400	
	CIELO SA	9,928	14.120	140,183.360	
	FIBRIA CELULOSE SA	2,700	78.290	211,383.000	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	5,400	77.900	420,660.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER	5,600	6.850	38,360.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	7,400	34.310	253,894.000	
	KLABIN SA - UNIT	6,600	21.650	142,890.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	8,500	39.180	333,030.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	1,900	11.080	21,052.000	
	KROTON EDUCACIONAL SA	13,000	9.700	126,100.000	
	BANCO BRADESCO S.A.	16,888	24.880	420,173.440	
	AMBEV SA	44,500	18.320	815,240.000	
	ブラジル・リアル 小計			ブラジル・リアル 21,543,052.850 (586,832,760)	
ポーランド・ズロチ		株	ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	PKO BANK POLSKI SA	9,910	41.700	413,247.000	
	BANK PEKAO SA	3,120	112.600	351,312.000	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	12,260	44.590	546,673.400	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	22,790	5.850	133,321.500	
	PGE SA	11,870	8.560	101,607.200	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	6,190	101.150	626,118.500	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,990	87.080	260,369.200	
	ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 2,432,648.800 (72,201,016)	
マレーシア・リンギット		株	マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	MALAYAN BANKING BHD	88,100	9.880	870,428.000	
	GENTING BHD	20,400	8.140	166,056.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	33,000	24.980	824,340.000	
	SIME DARBY BERHAD	69,900	2.700	188,730.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	42,500	4.550	193,375.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	29,700	9.420	279,774.000	

	GENTING MALAYSIA BHD	30,200	5.030	151,906.000	
	IOI CORP BHD	29,500	4.480	132,160.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	100,000	5.920	592,000.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	27,800	5.290	147,062.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	69,700	15.760	1,098,472.000	
	DIGI.COM BHD	26,900	4.640	124,816.000	
	SAPURA ENERGY BHD	251,100	0.335	84,118.500	
マレーシア・リングット 小計				マレーシア・リングット ト 4,853,237.500 (129,435,845)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	626,200	15.510	9,712,362.000	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	33,300	66.840	2,225,772.000	
	CEMEX SAB-CPO	424,519	13.070	5,548,463.330	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	26,900	182.340	4,904,946.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	7,300	113.240	826,652.000	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	13,823	64.170	887,021.910	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	15,700	38.410	603,037.000	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,475	323.830	477,649.250	
	ALFA S.A.B.-A	75,800	25.280	1,916,224.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	61,500	54.000	3,321,000.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	77,500	52.680	4,082,700.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	28,700	129.910	3,728,417.000	
メキシコ・ペソ 小計				メキシコ・ペソ 38,234,244.490 (219,846,905)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	80,500	9.370	754,285.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	125,000	6.790	848,750.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	20,000	14.540	290,800.000	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	12,500	25.400	317,500.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	15,000	15.300	229,500.000	

CHINA RESOURCES BEER HOLDING	34,000	32.300	1,098,200.000	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	32,000	8.880	284,160.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,027,800	7.420	7,626,276.000	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	9,000	38.250	344,250.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	56,000	8.070	451,920.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	365,000	0.790	288,350.000	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	28,000	13.960	390,880.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	5,800	314.600	1,824,680.000	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	540,000	3.950	2,133,000.000	
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	92,000	2.350	216,200.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	152,000	9.330	1,418,160.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	32,500	21.150	687,375.000	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	66,000	3.420	225,720.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	74,000	13.840	1,024,160.000	
PETROCHINA CO LTD-H	596,000	5.750	3,427,000.000	
CNOOC LTD	454,000	13.440	6,101,760.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	196,000	4.940	968,240.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	13,000	46.950	610,350.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	84,000	6.370	535,080.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,264,000	6.700	15,168,800.000	
CHINA MOBILE LTD	129,000	75.150	9,694,350.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	15,800	23.850	376,830.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	237,000	4.790	1,135,230.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	16,800	11.000	184,800.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	176,000	1.570	276,320.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	7,500	69.450	520,875.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	126,000	4.690	590,940.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	82,000	17.160	1,407,120.000	
SINOPHARM GROUP CO-H	26,000	37.650	978,900.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	40,000	26.050	1,042,000.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	11,000	19.140	210,540.000	
YANZHOU COAL MINING CO-H	20,000	8.690	173,800.000	

BYD CO LTD-H	4,000	44.850	179,400.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	696,000	3.710	2,582,160.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	8,100	34.200	277,020.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	236,000	3.280	774,080.000	
CITIC LTD	77,000	11.040	850,080.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	271,000	2.010	544,710.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,696,000	5.650	9,582,400.000	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	14,800	25.000	370,000.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	32,000	12.440	398,080.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	4,712	13.240	62,386.880	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	28,000	13.560	379,680.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	64,000	24.000	1,536,000.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	125,000	7.460	932,500.000	
CGN POWER CO LTD-H	140,000	1.780	249,200.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	40,500	74.900	3,033,450.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	10,000	23.800	238,000.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	198,000	1.380	273,240.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	183,080	5.540	1,014,263.200	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	50,000	10.880	544,000.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	11,300	25.400	287,020.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	144,000	8.600	1,238,400.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	46,500	4.260	198,090.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	193,000	1.690	326,170.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	35,000	8.030	281,050.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	100,000	3.240	324,000.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	32,200	28.150	906,430.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	84,000	17.040	1,431,360.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	6,000	72.950	437,700.000	

	KUNLUN ENERGY CO LTD	62,000	8.690	538,780.000	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	23,600	14.740	347,864.000	
	LENOVO GROUP LTD	428,000	5.210	2,229,880.000	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA- H	170,000	7.150	1,215,500.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	257,100	5.640	1,450,044.000	
	CHINA EVERGRANDE GROUP	33,000	26.250	866,250.000	
	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	70,000	3.660	256,200.000	
	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	32,000	11.260	360,320.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL- H	59,000	4.170	246,030.000	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	310,000	0.580	179,800.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	58,500	29.150	1,705,275.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	2,187,000	3.440	7,523,280.000	
	SOHO CHINA LTD	62,000	2.970	184,140.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	22,000	13.500	297,000.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L- H	72,000	3.280	236,160.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	41,200	6.860	282,632.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	16,500	21.000	346,500.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 111,373,626.080 (1,568,140,655)	
台湾・ドル	株		台湾・ドル	台湾・ドル	
	TAIWAN CEMENT	94,600	41.800	3,954,280.000	
	ASIA CEMENT CORP	38,000	39.900	1,516,200.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	64,964	72.500	4,709,890.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	57,112	75.500	4,311,956.000	
	FORMOSA PLASTICS CORP	53,600	111.500	5,976,400.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	57,140	84.000	4,799,760.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	50,390	119.500	6,021,605.000	
	WALSIN LIHWA CORP	72,000	20.500	1,476,000.000	
	CHINA STEEL CORP	106,686	24.800	2,645,812.800	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	29,255	46.650	1,364,745.750	

LITE-ON TECHNOLOGY CORP	48,616	35.800	1,740,452.800	
DELTA ELECTRONICS INC	28,000	121.500	3,402,000.000	
ACER INC	75,000	25.500	1,912,500.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	19,141	76.800	1,470,028.800	
INVENTEC CORP	65,000	27.750	1,803,750.000	
TATUNG CO LTD	47,000	35.500	1,668,500.000	
QUANTA COMPUTER INC	48,000	50.700	2,433,600.000	
AU OPTRONICS CORP	427,000	13.050	5,572,350.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	60,400	107.500	6,493,000.000	
MEDIATEK INC	25,003	255.000	6,375,765.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	10,000	366.000	3,660,000.000	
HTC CORP	18,257	42.700	779,573.900	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	41,151	29.750	1,224,242.250	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	129,411	50.100	6,483,491.100	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	137,693	51.500	7,091,189.500	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	217,000	10.800	2,343,600.000	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	90,334	22.000	1,987,348.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	148,828	15.050	2,239,861.400	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	104,993	25.900	2,719,318.700	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	103,575	14.250	1,475,943.750	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	183,041	11.950	2,187,339.950	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	106,080	11.050	1,172,184.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	313,028	21.150	6,620,542.200	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	96,210	20.500	1,972,305.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	4,640.000	4,640,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	10,000	153.500	1,535,000.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	19,000	107.000	2,033,000.000	
WISTRON CORP	111,110	21.350	2,372,198.500	
INNOLUX CORP	458,000	11.150	5,106,700.000	
TPK HOLDING CO LTD	16,000	55.100	881,600.000	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	21,000	72.300	1,518,300.000	
PEGATRON CORP	80,000	62.500	5,000,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	11,220	103.500	1,161,270.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	61,800	18.100	1,118,580.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	11,400	86.900	990,660.000	

	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	14,000	124.000	1,736,000.000	
	POU CHEN	27,440	32.800	900,032.000	
	COMPAL ELECTRONICS	61,453	19.050	1,170,679.650	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	193,000	261.000	50,373,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	376,128	79.300	29,826,950.400	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,000	330.000	1,650,000.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	8,760	257.500	2,255,700.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	63,000	34.350	2,164,050.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	355,000	16.900	5,999,500.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 234,038,756.450 (840,199,136)	
南アフリカ・ラ ンド		株	南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	GOLD FIELDS LTD	24,530	35.120	861,493.600	
	VODACOM GROUP LTD	8,780	122.700	1,077,306.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	4,650	198.640	923,676.000	
	NEDBANK GROUP LTD	3,980	263.330	1,048,053.400	
	BIDVEST GROUP LTD	3,030	197.510	598,455.300	
	BID CORP LTD	3,850	316.280	1,217,678.000	
	NETCARE LTD	22,830	28.290	645,860.700	
	STANDARD BANK GROUP LTD	20,180	178.340	3,598,901.200	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	4,220	187.220	790,068.400	
	SASOL LTD	13,330	570.240	7,601,299.200	
	REMGRO LTD	4,580	210.840	965,647.200	
	EXXARO RESOURCES LTD	3,480	147.530	513,404.400	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	4,160	81.780	340,204.800	
	SANLAM LTD	19,600	76.750	1,504,300.000	
	TIGER BRANDS LTD	1,250	288.000	360,000.000	
	FIRSTRAND LTD	34,960	67.350	2,354,556.000	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	14,760	51.900	766,044.000	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	1,680	168.000	282,240.000	
	ABSA GROUP LTD	15,560	157.710	2,453,967.600	
	NASPERS LTD-N SHS	720	3,062.000	2,204,640.000	
	INVESTEC LTD	4,440	96.630	429,037.200	
	MTN GROUP LTD	34,190	74.430	2,544,761.700	

IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	18,780	19.710	370,153.800	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	2,470	269.670	666,084.900	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,760	118.280	1,036,132.800	
BARLOWORLD LTD	4,800	123.000	590,400.000	
SAPPI LIMITED	10,720	99.820	1,070,070.400	
TELKOM SA SOC LTD	8,670	49.000	424,830.000	
MONDI LTD	1,320	417.500	551,100.000	
MMI HOLDINGS LTD	16,600	17.180	285,188.000	
SPAR GROUP LIMITED/THE	3,320	198.410	658,721.200	
MR PRICE GROUP LTD	1,590	209.100	332,469.000	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	15,990	26.000	415,740.000	
SIBANYE GOLD LTD	31,870	9.800	312,326.000	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 39,794,810.800 (286,920,586)	
合計			4,975,961,569 [4,975,961,569]	

(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	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	190,000	アメリカ・ドル 3,915,900.000		
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 3,915,900.000 (432,746,109)		
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	46,800	メキシコ・ペソ 1,144,260.000		
	メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 1,144,260.000 (6,579,495)		
	南アフリカ・ランド		REDEFINE PROPERTIES LTD	61,790	南アフリカ・ランド 633,347.500	
			GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	35,300	890,619.000	
	南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 1,523,966.500 (10,987,798)		
	投資証券 合計			450,313,402		

		[450,313,402]	
合計		450,313,402	[450,313,402]

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	52.6%	47.4%	16.8%
インド・ルピー	株式 36銘柄	100%	-%	7.6%
インドネシア・ルピア	株式 9銘柄	100%	-%	1.4%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	0.1%
タイ・バーツ	株式 17銘柄	100%	-%	3.9%
チリ・ペソ	株式 10銘柄	100%	-%	0.9%
トルコ・リラ	株式 12銘柄	100%	-%	0.8%
ブラジル・レアル	株式 42銘柄	100%	-%	10.8%
ポーランド・ズロチ	株式 7銘柄	100%	-%	1.3%
マレーシア・リングgit	株式 13銘柄	100%	-%	2.4%
メキシコ・ペソ	株式 12銘柄 投資証券 1銘柄	97.1%	2.9%	4.2%
香港・ドル	株式 82銘柄	100%	-%	28.8%
台湾・ドル	株式 54銘柄	100%	-%	15.5%
南アフリカ・ランド	株式 34銘柄 投資証券 2銘柄	96.3%	3.7%	5.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	2,318,383
コール・ローン	112,358,775	93,637,195
国債証券	11,708,883,790	13,379,556,270
地方債証券	1,134,312,500	1,137,489,400
特殊債券	1,025,437,500	917,293,700
社債券	1,127,290,000	1,140,593,000
未収利息	49,949,873	48,440,021
前払費用	599,179	2,253,566
流動資産合計	15,158,831,617	16,721,581,535
資産合計	15,158,831,617	16,721,581,535
負債の部		
流動負債		
未払解約金	36,905,860	2,674,000
その他未払費用	-	573
流動負債合計	36,905,860	2,674,573
負債合計	36,905,860	2,674,573
純資産の部		
元本等		
元本	1 11,905,512,687	13,184,411,625
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,216,413,070	3,534,495,337
元本等合計	15,121,925,757	16,718,906,962
純資産合計	15,121,925,757	16,718,906,962
負債純資産合計	15,158,831,617	16,721,581,535

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1. 1 期首	平成28年9月8日	平成29年9月8日
期首元本額	11,293,335,346円	11,905,512,687円
期中追加設定元本額	2,671,437,155円	2,913,930,966円
期中一部解約元本額	2,059,259,814円	1,635,032,028円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
DCダイワ・ターゲットイ	44,382円	60,154円
ヤー2050		
iFree 日本債券イン	83,423,717円	108,814,789円
デックス		
iFree 8資産バランス	430,917,656円	912,587,846円
ダイワ・ライフ・バランス3	4,938,780,124円	5,789,219,449円
0		
ダイワ・ライフ・バランス5	2,446,057,023円	3,119,932,887円
0		
ダイワ・ライフ・バランス7	776,093,549円	1,016,072,296円
0		
DCダイワ・ワールドアセッ	568,177,603円	682,372,511円
ト(六つの羽/安定コース)		
DCダイワ・ワールドアセッ	461,622,996円	553,959,532円
ト(六つの羽/6分散コー		
ス)		
DCダイワ・ワールドアセッ	138,527,916円	175,340,920円
ト(六つの羽/成長コース)		
DCダイワ・ターゲットイ	68,621,548円	58,783,007円
ヤー2020		

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	48,130,755円	49,481,303円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	2,986,011円	4,941,559円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	- 円	787,607円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,087,968,927円	455,354,017円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	224,057,853円	215,516,417円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	248,906,168円	19,618,786円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	381,196,459円	21,568,545円
計	11,905,512,687円	13,184,411,625円
2. 期末日における受益権の総数	11,905,512,687口	13,184,411,625口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもありま

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	146,905,970	104,140,710
地方債証券	5,633,900	6,723,800
特殊債券	4,688,300	3,595,200
社債券	3,342,400	8,673,400
合計	160,570,570	123,133,110

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成28年12月1日から平成29年9月7日まで、及び平成29年12月1日から平成30年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.2702円	1.2681円
（1万口当たり純資産額）	（12,702円）	（12,681円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 8 3 2年国債	63,000,000	63,175,140	
	3 8 6 2年国債	170,000,000	170,552,500	
	1 2 2 5年国債	83,000,000	83,233,230	
	1 2 3 5年国債	100,000,000	100,328,000	
	1 2 4 5年国債	120,000,000	120,458,400	
	1 2 5 5年国債	370,000,000	371,613,200	
	1 2 6 5年国債	164,000,000	164,785,560	
	1 2 7 5年国債	30,000,000	30,155,400	
	1 2 8 5年国債	167,000,000	167,928,520	
	1 2 9 5年国債	132,000,000	132,801,240	
	1 3 0 5年国債	157,000,000	158,004,800	
	1 3 1 5年国債	90,000,000	90,620,100	
	1 3 2 5年国債	90,000,000	90,647,100	
	1 3 3 5年国債	130,000,000	130,971,100	
	1 3 4 5年国債	60,000,000	60,476,400	
	1 3 5 5年国債	170,000,000	171,388,900	
	1 3 6 5年国債	65,000,000	65,544,700	
	1 4 0年国債	30,000,000	42,374,400	
	2 4 0年国債	28,000,000	38,274,040	
	3 4 0年国債	19,000,000	26,090,420	
	4 4 0年国債	30,000,000	41,373,300	
	5 4 0年国債	35,000,000	46,408,950	
	6 4 0年国債	28,000,000	36,430,520	
	7 4 0年国債	31,000,000	38,504,480	
	8 4 0年国債	23,000,000	26,488,640	
	9 4 0年国債	40,000,000	33,315,200	
	1 0 4 0年国債	91,000,000	89,843,390	
	1 1 4 0年国債	14,000,000	13,300,980	
	3 0 5 1 0年国債	100,000,000	101,815,000	
	3 0 6 1 0年国債	10,000,000	10,231,100	
	3 0 8 1 0年国債	100,000,000	102,517,000	
	3 0 9 1 0年国債	103,000,000	105,225,830	
	3 1 0 1 0年国債	30,000,000	30,673,500	
	3 1 1 1 0年国債	42,000,000	42,771,960	
3 1 2 1 0年国債	94,000,000	96,788,040		

3 1 3	1 0 年国債	34,000,000	35,199,520	
3 1 4	1 0 年国債	77,000,000	79,326,940	
3 1 5	1 0 年国債	90,000,000	93,242,700	
3 1 6	1 0 年国債	56,000,000	57,862,000	
3 1 7	1 0 年国債	40,000,000	41,451,200	
3 1 8	1 0 年国債	33,000,000	34,096,920	
3 1 9	1 0 年国債	140,000,000	145,497,800	
3 2 0	1 0 年国債	35,000,000	36,259,650	
3 2 1	1 0 年国債	65,000,000	67,503,800	
3 2 2	1 0 年国債	140,000,000	144,898,600	
3 2 3	1 0 年国債	70,000,000	72,611,000	
3 2 4	1 0 年国債	80,000,000	82,680,800	
3 2 5	1 0 年国債	160,000,000	165,688,000	
3 2 6	1 0 年国債	20,000,000	20,673,800	
3 2 7	1 0 年国債	90,000,000	93,418,200	
3 2 8	1 0 年国債	60,000,000	61,837,800	
3 2 9	1 0 年国債	160,000,000	166,668,800	
3 3 0	1 0 年国債	81,000,000	84,533,220	
3 3 1	1 0 年国債	110,000,000	113,689,400	
3 3 2	1 0 年国債	45,000,000	46,571,850	
3 3 3	1 0 年国債	53,000,000	54,908,000	
3 3 4	1 0 年国債	181,000,000	187,704,240	
3 3 5	1 0 年国債	140,000,000	144,523,400	
3 3 7	1 0 年国債	50,000,000	51,021,500	
3 3 8	1 0 年国債	52,000,000	53,426,360	
3 3 9	1 0 年国債	45,000,000	46,266,300	
3 4 0	1 0 年国債	80,000,000	82,277,600	
3 4 1	1 0 年国債	15,000,000	15,321,750	
3 4 2	1 0 年国債	75,000,000	75,507,000	
3 4 3	1 0 年国債	152,000,000	152,943,920	
3 4 4	1 0 年国債	38,000,000	38,212,800	
3 4 5	1 0 年国債	150,000,000	150,741,000	
3 4 6	1 0 年国債	43,000,000	43,163,830	
3 4 7	1 0 年国債	130,000,000	130,396,500	
3 4 8	1 0 年国債	150,000,000	150,336,000	
3 4 9	1 0 年国債	125,000,000	125,230,000	
3 5 0	1 0 年国債	185,000,000	185,173,900	
3 5 1	1 0 年国債	100,000,000	99,951,000	
2	3 0 年国債	9,000,000	11,253,420	

3	30年国債	4,000,000	4,968,040	
4	30年国債	8,000,000	10,571,280	
5	30年国債	8,000,000	9,949,360	
6	30年国債	9,000,000	11,471,580	
7	30年国債	12,000,000	15,206,040	
10	30年国債	15,000,000	16,600,650	
11	30年国債	9,000,000	10,737,090	
12	30年国債	11,000,000	13,777,720	
13	30年国債	11,000,000	13,631,970	
14	30年国債	22,000,000	28,619,140	
15	30年国債	21,000,000	27,687,660	
16	30年国債	26,000,000	34,353,020	
17	30年国債	17,000,000	22,229,710	
18	30年国債	20,000,000	25,889,400	
19	30年国債	15,000,000	19,449,750	
20	30年国債	16,000,000	21,305,280	
21	30年国債	16,000,000	20,794,880	
22	30年国債	17,000,000	22,697,210	
23	30年国債	16,000,000	21,380,800	
24	30年国債	15,000,000	20,093,850	
25	30年国債	17,000,000	22,217,300	
26	30年国債	32,000,000	42,415,360	
27	30年国債	32,000,000	43,119,360	
28	30年国債	34,000,000	45,931,620	
29	30年国債	43,000,000	57,454,450	
30	30年国債	56,000,000	73,936,240	
31	30年国債	38,000,000	49,583,540	
32	30年国債	49,000,000	65,126,390	
33	30年国債	65,000,000	82,624,100	
34	30年国債	50,000,000	65,808,000	
35	30年国債	56,000,000	71,500,240	
36	30年国債	59,000,000	75,482,240	
37	30年国債	67,000,000	84,404,590	
38	30年国債	39,000,000	48,384,180	
39	30年国債	37,000,000	46,769,110	
40	30年国債	29,000,000	36,023,510	
41	30年国債	34,000,000	41,480,000	
42	30年国債	33,000,000	40,276,500	
43	30年国債	37,000,000	45,177,740	

4 4	3 0 年国債	42,000,000	51,303,000	
4 5	3 0 年国債	43,000,000	50,522,420	
4 6	3 0 年国債	55,000,000	64,625,550	
4 7	3 0 年国債	44,000,000	52,810,120	
4 8	3 0 年国債	45,000,000	51,864,300	
4 9	3 0 年国債	45,000,000	51,858,000	
5 0	3 0 年国債	44,000,000	44,149,160	
5 1	3 0 年国債	45,000,000	39,482,550	
5 2	3 0 年国債	47,000,000	43,522,470	
5 3	3 0 年国債	55,000,000	52,222,500	
5 4	3 0 年国債	45,000,000	44,947,800	
5 5	3 0 年国債	38,000,000	37,955,540	
5 6	3 0 年国債	50,000,000	49,882,000	
5 7	3 0 年国債	50,000,000	49,763,500	
5 8	3 0 年国債	55,000,000	54,673,300	
5 9	3 0 年国債	45,000,000	43,499,250	
4 4	2 0 年国債	32,000,000	33,276,800	
4 5	2 0 年国債	20,000,000	20,767,400	
4 6	2 0 年国債	19,000,000	19,784,890	
4 7	2 0 年国債	23,000,000	24,081,000	
4 8	2 0 年国債	9,000,000	9,535,680	
4 9	2 0 年国債	4,000,000	4,223,600	
5 0	2 0 年国債	30,000,000	31,524,900	
5 1	2 0 年国債	25,000,000	26,466,000	
5 2	2 0 年国債	19,000,000	20,270,340	
5 3	2 0 年国債	13,000,000	13,937,820	
5 4	2 0 年国債	14,000,000	15,056,020	
5 5	2 0 年国債	41,000,000	44,038,510	
5 6	2 0 年国債	12,000,000	12,947,520	
5 7	2 0 年国債	24,000,000	25,804,320	
5 8	2 0 年国債	35,000,000	37,800,000	
5 9	2 0 年国債	3,000,000	3,229,140	
6 1	2 0 年国債	40,000,000	41,951,600	
6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,666,880	
6 3	2 0 年国債	30,000,000	32,687,700	
6 4	2 0 年国債	35,000,000	38,459,050	
6 5	2 0 年国債	42,000,000	46,344,900	
6 6	2 0 年国債	30,000,000	32,944,800	
6 7	2 0 年国債	19,000,000	21,046,110	

6 8	2 0 年国債	25,000,000	28,107,500	
6 9	2 0 年国債	12,000,000	13,425,120	
7 0	2 0 年国債	18,000,000	20,542,320	
7 1	2 0 年国債	17,000,000	19,204,220	
7 2	2 0 年国債	53,000,000	59,816,330	
7 5	2 0 年国債	14,000,000	15,938,580	
7 6	2 0 年国債	25,000,000	28,135,250	
7 8	2 0 年国債	17,000,000	19,207,790	
7 9	2 0 年国債	14,000,000	15,913,240	
8 1	2 0 年国債	65,000,000	74,161,100	
8 2	2 0 年国債	28,000,000	32,143,160	
8 5	2 0 年国債	31,000,000	35,870,410	
8 6	2 0 年国債	6,000,000	7,032,900	
8 7	2 0 年国債	20,000,000	23,292,600	
8 8	2 0 年国債	33,000,000	38,841,000	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	17,538,450	
9 2	2 0 年国債	45,000,000	52,625,250	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	20,978,820	
9 4	2 0 年国債	45,000,000	52,829,100	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	35,865,900	
9 6	2 0 年国債	23,000,000	27,095,610	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	29,790,250	
9 8	2 0 年国債	34,000,000	40,209,420	
9 9	2 0 年国債	53,000,000	62,887,150	
1 0 0	2 0 年国債	35,000,000	41,973,050	
1 0 1	2 0 年国債	18,000,000	21,925,980	
1 0 2	2 0 年国債	10,000,000	12,226,500	
1 0 3	2 0 年国債	21,000,000	25,472,370	
1 0 4	2 0 年国債	64,000,000	76,391,040	
1 0 5	2 0 年国債	38,000,000	45,499,680	
1 0 6	2 0 年国債	16,000,000	19,316,480	
1 0 7	2 0 年国債	20,000,000	24,020,000	
1 0 8	2 0 年国債	48,000,000	56,673,120	
1 0 9	2 0 年国債	35,000,000	41,430,900	
1 1 0	2 0 年国債	27,000,000	32,521,770	
1 1 1	2 0 年国債	35,000,000	42,653,450	
1 1 2	2 0 年国債	34,000,000	41,073,700	
1 1 3	2 0 年国債	70,000,000	84,807,100	
1 1 4	2 0 年国債	45,000,000	54,670,050	

1 1 5	2 0 年国債	42,000,000	51,490,320	
1 1 6	2 0 年国債	27,000,000	33,175,710	
1 1 7	2 0 年国債	37,000,000	45,044,910	
1 1 8	2 0 年国債	13,000,000	15,709,980	
1 1 9	2 0 年国債	23,000,000	27,264,890	
1 2 0	2 0 年国債	40,000,000	46,495,600	
1 2 1	2 0 年国債	16,000,000	19,194,560	
1 2 2	2 0 年国債	5,000,000	5,939,550	
1 2 3	2 0 年国債	42,000,000	51,499,980	
1 2 4	2 0 年国債	45,000,000	54,640,350	
1 2 5	2 0 年国債	25,000,000	31,032,750	
1 2 6	2 0 年国債	21,000,000	25,555,530	
1 2 7	2 0 年国債	23,000,000	27,692,230	
1 2 8	2 0 年国債	32,000,000	38,608,000	
1 2 9	2 0 年国債	45,000,000	53,734,500	
1 3 0	2 0 年国債	28,000,000	33,475,400	
1 3 1	2 0 年国債	47,000,000	55,597,710	
1 3 2	2 0 年国債	25,000,000	29,620,000	
1 3 3	2 0 年国債	47,000,000	56,288,610	
1 3 4	2 0 年国債	15,000,000	17,994,150	
1 3 5	2 0 年国債	20,000,000	23,731,400	
1 3 6	2 0 年国債	40,000,000	46,940,800	
1 3 7	2 0 年国債	18,000,000	21,375,900	
1 3 9	2 0 年国債	62,000,000	72,806,600	
1 4 1	2 0 年国債	48,000,000	57,121,440	
1 4 2	2 0 年国債	45,000,000	54,203,850	
1 4 3	2 0 年国債	48,000,000	56,526,720	
1 4 4	2 0 年国債	24,000,000	27,910,800	
1 4 5	2 0 年国債	75,000,000	89,475,750	
1 4 6	2 0 年国債	71,000,000	84,744,180	
1 4 7	2 0 年国債	89,000,000	105,056,490	
1 4 8	2 0 年国債	59,000,000	68,786,920	
1 4 9	2 0 年国債	97,000,000	113,084,540	
1 5 0	2 0 年国債	56,000,000	64,482,880	
1 5 1	2 0 年国債	74,000,000	82,856,320	
1 5 2	2 0 年国債	69,000,000	77,255,850	
1 5 3	2 0 年国債	72,000,000	81,736,560	
1 5 4	2 0 年国債	87,000,000	97,319,070	
1 5 5	2 0 年国債	68,000,000	73,758,240	

	1 5 6	2 0 年国債	63,000,000	61,934,670	
	1 5 7	2 0 年国債	77,000,000	72,872,030	
	1 5 8	2 0 年国債	63,000,000	62,740,440	
	1 5 9	2 0 年国債	82,000,000	82,887,240	
	1 6 0	2 0 年国債	66,000,000	67,778,040	
	1 6 1	2 0 年国債	69,000,000	69,527,850	
	1 6 2	2 0 年国債	60,000,000	60,308,400	
	1 6 3	2 0 年国債	60,000,000	60,207,600	
	1 6 4	2 0 年国債	90,000,000	88,504,200	
	1 6 5	2 0 年国債	40,000,000	39,223,200	
国債証券 合計				13,379,556,270	
地方債証券	7 5 1	東京都公債	100,000,000	101,659,400	
	2 1 - 3 5	兵庫県公債	100,000,000	101,967,300	
	3	兵庫県公債 1 2 年	100,000,000	102,773,000	
	1 1	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	117,009,500	
	2 8 - 1	静岡県公債	100,000,000	99,493,600	
	2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	103,131,100	
	2 9 - 6	千葉県公債	100,000,000	100,192,900	
	1 1 6	共同発行地方	100,000,000	103,197,300	
	1 1 7	共同発行地方	100,000,000	102,912,400	
	2 1 - 6	大阪市公債	100,000,000	101,896,100	
	2 5 - 6	大阪市公債	100,000,000	103,256,800	
地方債証券 合計				1,137,489,400	
特殊債券	9 8	政保道路機構	100,000,000	101,895,600	
	1 2 2	政保道路機構	100,000,000	102,086,800	
	1 9 0	政保道路機構	100,000,000	102,784,500	
	2 4 1	政保道路機構	100,000,000	102,498,700	
	2 6 1	政保道路機構	100,000,000	102,092,400	
	3 6	地方公共団体	100,000,000	103,103,900	
	1 4	政保地方公共 6	100,000,000	100,437,400	
	6 5	地方公共団体	100,000,000	102,460,600	
	1 7 8 9	利付商工債	100,000,000	99,933,800	
特殊債券 合計				917,293,700	
社債券	2 0	成田国際空港	100,000,000	98,907,800	
	3 3	中日本高速道	100,000,000	103,124,900	
	2 5	西日本高速道	100,000,000	102,194,900	
	1 7	パナソニック	100,000,000	100,630,700	
	5	NTTファイナンス	100,000,000	99,478,900	
	6 2	トヨタファイナンス	100,000,000	100,210,600	

	4 4 野村ホールディング	100,000,000	101,352,300	
	8 0 三菱地所	100,000,000	116,461,400	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	111,526,900	
	7 0 東日本旅客鉄道	100,000,000	102,308,200	
	4 9 7 関西電力	100,000,000	104,396,400	
社債券	合計		1,140,593,000	
合計			16,574,932,370	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,633,564,159	1,960,627,185
金銭信託	-	35,420,013
コール・ローン	451,188,048	1,430,579,440
国債証券	162,325,211,598	163,192,191,471
派生商品評価勘定	370,031	-
未収入金	44,756	291,791
未収利息	1,200,173,652	1,178,992,237
前払費用	23,656,605	31,517,554
流動資産合計	165,634,208,849	167,829,619,691
資産合計	165,634,208,849	167,829,619,691
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,543,074	6,436,470
未払金	1,366,031,668	1,576,170,100
未払解約金	162,287,938	172,225,797
その他未払費用	-	4,761

流動負債合計		1,529,862,680	1,754,837,128
負債合計		1,529,862,680	1,754,837,128
純資産の部			
元本等			
元本	1	59,538,261,711	61,016,797,302
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		104,566,084,458	105,057,985,261
元本等合計		164,104,346,169	166,074,782,563
純資産合計		164,104,346,169	166,074,782,563
負債純資産合計		165,634,208,849	167,829,619,691

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7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29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1. 1 期首	平成28年9月8日	平成29年9月8日
期首元本額	58,588,793,458円	59,538,261,711円
期中追加設定元本額	6,320,540,547円	6,429,006,075円
期中一部解約元本額	5,371,072,294円	4,950,470,484円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス V A	1,020,130,026円	759,746,065円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	35,360,132円	29,270,371円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	244,881,571円	190,347,672円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	63,731,822円	54,329,016円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	824,635,336円	610,874,046円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジな し)	230,215,542円	351,032,696円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘ ッジなし)	592,653,662円	963,925,458円

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	299,451,042円	677,810,224円
D-I's 外国債券インデ ックス	914,677円	645,862円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	21,393円	27,829円
iFree 外国債券イン デックス	497,286,602円	461,979,837円
iFree 8資産バランス	198,703,402円	423,058,282円
iFree 年金バランス	- 円	926,034円
DCダイワ外国債券インデ ックス	39,579,736,638円	41,909,419,082円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	623,165,132円	731,192,133円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	282,848,524円	360,834,521円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	178,451,800円	234,738,086円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	262,838,842円	316,085,048円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	213,479,314円	256,163,773円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	63,927,072円	81,043,185円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	12,735,474円	10,877,692円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	18,870,238円	17,944,093円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,151,888円	1,798,984円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	- 円	368,228円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	697,242,909円	296,321,092円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	172,085,786円	166,976,918円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,446,530,502円	5,906,013,260円

ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	458,929,261円	36,172,639円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	264,927,846円	15,000,359円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専 用）	367,370,227円	345,571,442円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	124,514,091円	143,352,192円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	15,516,378円	27,594,446円
ダイワ外国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワ SMA専用）	374,849円	27,731,702円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,637,411,782円	5,491,720,971円
ダイワライフスタイル25	34,550,194円	35,377,865円
ダイワライフスタイル50	58,020,752円	62,694,949円
ダイワライフスタイル75	15,597,005円	17,831,250円
計	59,538,261,711円	61,016,797,302円
2. 期末日における受益権の総数	59,538,261,711口	61,016,797,302口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	328,963,326	3,356,792,152
合計	328,963,326	3,356,792,152

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成28年12月1日から平成29年9月7日まで、及び平成29年12月1日から平成30年9月7日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成29年9月7日 現在				平成30年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	283,351,963	-	282,178,920	1,173,043	1,264,722,280	-	1,258,285,810	6,436,470
アメリカ・ドル	129,246,870	-	128,242,800	1,004,070	546,332,857	-	544,330,500	2,002,357
イギリス・ ポンド	19,706,128	-	19,797,770	91,642	101,885,991	-	101,003,280	882,711
オーストラリ ア・ドル	11,329,110	-	11,356,800	27,690	11,123,725	-	11,015,750	107,975
カナダ・ドル	10,873,981	-	11,050,880	176,899	-	-	-	-
シンガポー ル・ドル	-	-	-	-	14,383,646	-	14,284,500	99,146
デンマーク・ クローネ	-	-	-	-	15,337,032	-	15,256,920	80,112
ポーランド・ ズロチ	-	-	-	-	14,200,025	-	13,985,360	214,665
ユーロ	103,779,674	-	103,240,670	539,004	561,459,004	-	558,409,500	3,049,504
南アフリカ・ ランド	8,416,200	-	8,490,000	73,800	-	-	-	-
合計	283,351,963	-	282,178,920	1,173,043	1,264,722,280	-	1,258,285,810	6,436,470

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7563円 (27,563円)	2.7218円 (27,218円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,058,913.600	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	4,280,000.000	4,342,359.600	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,117,527.770	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,853,657.520	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,505,257.530	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,166,405.680	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,580,081.400	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,493,101.240	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,106,559.790	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,148,300.480	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,375,320.230	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,438,279.260	
1% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,872,000.000	1,844,930.880	
1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,180,113.750	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	871,288.080	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,028,766.400	
1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,327,942.440	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,859,150.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,343,843.480	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,215,063.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,930,391.520	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,133,981.200	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,480,734.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,416,538.750	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,409,466.660	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,103,019.970	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,794,291.610	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,512,681.520	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	1,973,528.390	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,860,834.300	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,300,656.050	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,017,033.410	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,465,435.780	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	1,993,141.540	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,224,869.090	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,626,280.740	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,705,943.880	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,791,012.770	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	3,912,000.000	3,853,906.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,380,474.860	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,682,796.680	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,431,609.800	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	715,553.940	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,444,602.680	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	759,457.500	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,037,482.650	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	798,128.100	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	894,665.830	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	857,717.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	891,245.700	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	573,290.190	

6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,282,794.800	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	991,000.000	1,245,171.680	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,626,000.000	1,973,931.480	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	708,189.960	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	662,307.320	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	637,596.690	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,348,520.320	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,339,068.130	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,308,018.800	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,471,178.500	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,147,503.500	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,798,992.040	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,810,382.990	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,761,066.580	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,247,575.600	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,666,897.050	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,529,645.660	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,472,765.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,647,588.450	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,344,219.030	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,644,709.650	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,497,658.400	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,326,000.000	2,357,424.260	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,798,000.000	3,683,452.320	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,371,104.720	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,021,069.090	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	3,985,174.430	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	3,869,252.280	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,798,773.380	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,162,000.000	5,043,790.200	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	3,779,677.110	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190831	2,989,000.000	2,964,011.960	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,275,019.030	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,376,597.800	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,563,520.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,152,740.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,117,187.660	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,735,495.070	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,663,364.320	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,811,454.620	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,270,245.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,110,056.600	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,177,309.560	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,891,150.810	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,331,424.740	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,469,288.620	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,383,463.820	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,738,540.880	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,751,039.640	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,739,845.440	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,795,886.100	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,544,267.320	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	3,800,216.550	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,555,251.050	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,524,236.800	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,741,220.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,955,903.650	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,947,762.260	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,759,502.200	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,076,689.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,120,254.160	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,446,374.050	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,456,305.820	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,365,904.250	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,798,537.040	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,378,508.960	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,802,748.280	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,621,408.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,033,207.880	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,674,209.580	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,471,258.220	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,026,804.400	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,101,282.020	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	2,981,166.240	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	3,492,000.000	3,403,861.920	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,032,220.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	4,932,910.140	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,455,947.780	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,075,018.840	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,186,699.360	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,038,543.340	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,896,449.680	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,009,865.330	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	5,029,000.000	4,609,782.560	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,368,635.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	1,968,756.300	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,068,103.360	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,606,958.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,376,950.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,394,325.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,814,600.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,067,552.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	2,955,250.800	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,533,759.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,538,680.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,589,736.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,246,616.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190915	2,600,000.000	2,557,438.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,342,175.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,901,520.440	

1% United States Treasury Note/Bond 20191015	2,147,000.000	2,111,595.970	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,160,100.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,868,960.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,364,450.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,237,708.000	
1% United States Treasury Note/Bond 20191115	1,400,000.000	1,374,996.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,412,561.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,328,936.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20191215	1,440,000.000	1,419,004.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	1,954,680.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,436,700.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200115	1,500,000.000	1,476,375.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,097,991.200	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	2,927,917.300	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,415,073.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	3,512,031.500	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,130,000.000	2,094,301.200	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	2,926,021.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,224,698.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315	1,900,000.000	1,872,754.000	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	2,550,000.000	2,464,116.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,816,828.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200415	850,000.000	835,354.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,490,696.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	3,465,000.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	2,911,860.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,877,180.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	4,000,000.000	3,926,680.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	2,896,380.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	2,000,000.000	1,917,420.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615	2,700,000.000	2,647,782.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	2,894,040.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,299,104.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715	2,000,000.000	1,959,140.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,612,788.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815	1,300,000.000	1,272,323.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,808,447.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,891,700.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	3,577,928.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,066,496.000	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20190831	600,000.000	592,800.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,900,000.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915	2,500,000.000	2,438,175.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,417,375.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190930	1,000,000.000	988,160.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,400,000.000	3,273,010.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015	1,000,000.000	979,020.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,427,525.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,224,560.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,100,000.000	2,918,588.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,392,235.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201115	3,600,000.000	3,530,664.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20191130	2,800,000.000	2,772,980.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	1,965,380.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,077,248.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,000,000.000	990,970.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	1,300,000.000	1,258,452.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,264,856.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20200131	2,300,000.000	2,282,106.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,446,380.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,233,031.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,800,000.000	1,791,198.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,475,075.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,283,995.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,553,668.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,691,549.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	3,562,560.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,176,352.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,500,000.000	1,491,855.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,869,405.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,868,274.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,480,350.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,500,000.000	3,550,575.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	5,500,000.000	5,496,535.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	2,994,720.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,200,000.000	1,195,356.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,500,000.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,907,410.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	1,400,000.000	1,397,088.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	1,900,000.000	1,906,517.000	

	2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,500,575.000	
	2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	4,990,800.000	
	2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,485,725.000	
	2.5% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,300,000.000	3,292,113.000	
	2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,987,100.000	
	2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,293,136.000	
	2.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,300,000.000	3,299,340.000	
	2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,500,000.000	2,499,800.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	2,500,000.000	2,499,200.000	
	3% United States Treasury Note/Bond 20480815	2,400,000.000	2,374,872.000	
	2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,503,400.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,509,375.000	
	2.625% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,500,000.000	2,499,100.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 662,994,801.580 (73,267,555,523)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20200722	2,280,000.000	2,333,739.600	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,926,490.530	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,519,777.790	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,582,000.000	2,028,440.400	

1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,495,325.500	
0.5% United Kingdom Gilt 20220722	1,300,000.000	1,280,370.000	
1.5% United Kingdom Gilt 20470722	910,000.000	853,398.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20370907	400,000.000	399,880.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,330,000.000	1,357,265.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,810,000.000	1,799,230.500	
0.75% United Kingdom Gilt 20230722	1,500,000.000	1,481,085.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	600,000.000	611,820.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	430,000.000	430,129.000	
1% United Kingdom Gilt 20240422	200,000.000	198,940.000	
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,319,303.380	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,369,596.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,783,272.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,830,490.880	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,817,977.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,207,646.400	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,827,629.640	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,909,919.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,222,661.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,551,001.760	

4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,596,000.000	2,450,498.400	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,480,000.000	2,020,200.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,433,449.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,791,249.600	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,533,149.340	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,620,000.000	2,269,134.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20190907	828,000.000	852,914.520	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,244,000.000	2,114,178.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,902,682.050	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,295,954.300	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	873,069.780	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,352,000.000	2,051,524.800	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,315,918.740	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,966,000.000	2,543,021.000	
2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,059,724.040	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,644,499.400	
2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,526,425.440	
3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	2,878,020.000	
イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 76,111,003.590 (10,867,890,202)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	

5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,420,000.000	2,655,901.600	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,409,000.000	2,503,914.600	
5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,455,296.920	
5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,370,775.880	
4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,035,809.620	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,534,923.920	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,074,000.000	2,203,832.400	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,526,700.660	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,358,000.000	1,646,371.300	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,202,405.120	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	2,011,000.000	2,027,952.730	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,250,878.440	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	550,199.030	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,183,695.750	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	712,000.000	744,766.240	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,522,000.000	2,562,251.120	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,978,000.000	1,924,653.340	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,132,000.000	1,117,895.280	
2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,797,966.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,200,000.000	2,235,486.000	

	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	300,000.000	301,647.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	900,000.000	913,815.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	600,000.000	592,662.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	290,000.000	277,799.700	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 43,617,599.650 (3,463,673,588)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	425,000.000	491,300.000	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	562,116.360	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,310,034.270	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,618,124.060	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,574,314.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,780,963.950	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,876,000.000	1,922,693.640	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	985,473.480	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,791,080.390	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	1,953,700.770	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,217,026.370	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,429,896.600	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,627,000.000	1,624,364.260	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,197,000.000	1,328,789.700	

2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,159,907.280	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,719,000.000	1,706,330.970	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,831,000.000	1,784,913.730	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,072,854.830	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,237,000.000	1,197,700.510	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,423,404.800	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,121,071.600	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840,000.000	795,278.400	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,400,000.000	1,340,668.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20191101	500,000.000	496,070.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,000,000.000	980,550.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,573,776.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,600,000.000	1,583,600.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200501	700,000.000	696,906.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	600,000.000	595,650.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	300,000.000	283,026.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200801	300,000.000	298,290.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	300,552.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20201101	2,200,000.000	2,196,832.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 40,197,259.970	

			(3,375,363,919)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	714,409.200	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	840,553.600	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	457,053.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	650,598.900	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	370,847.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	498,960.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	397,200.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	505,194.810	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	368,000.000	399,272.640	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	129,875.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	415,000.000	414,502.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	527,668.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	224,537.600	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	568,000.000	563,387.840	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	246,500.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	190,000.000	185,972.000	
1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	198,360.000		
2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	150,000.000	140,059.500		
1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	200,000.000	197,806.000		

	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	300,000.000	306,426.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 7,969,183.090 (640,562,937)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,095,000.000	10,215,776.850	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,861,292.300	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,641,550.350	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,572,388.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,880,445.200	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	5,977,007.200	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,644,867.500	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 49,793,327.400 (604,490,994)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	19,922,091.600	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	9,076,205.250	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	5,550,000.000	6,163,108.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,266,342.040	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	8,363,000.000	9,387,467.500	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	6,200,000.000	6,316,622.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	1,500,000.000	1,526,580.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ	

			57,658,416.890 (992,877,939)	
ノルウェー・ク ローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,478,062.800	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,345,288.600	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,421,862.900	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,431,054.900	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,306,934.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,458,625.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	1,800,000.000	1,834,668.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 29,276,496.200 (384,107,630)	
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	2,610,324.500	
	5.5% Poland Government Bond 20191025	1,912,000.000	2,000,334.400	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,478,000.000	2,477,008.800	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,224,866.150	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,138,911.200	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,042,457.200	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,370,000.000	2,238,346.500	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,324,176.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	1,700,000.000	1,702,890.000	

	Poland Government Bond 20200725	300,000.000	291,150.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,013,686.980	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,426,328.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,210,557.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,373,518.750	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,726,830.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,631,030.950	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 33,432,416.430 (992,274,120)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	540,740.100	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	782,368.560	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,619,558.990	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,177,740.840	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,944,682.520	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,532,682.760	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,256,385.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	861,236.250	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	711,109.490	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	584,343.720	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,044,000.000	1,044,271.440	

3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	983,622.640	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	927,000.000	853,989.480	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	565,818.160	
3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	660,965.920	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	602,550.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,065,878.800	
4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	866,341.300	
3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	648,000.000	649,367.280	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	728,325.510	
3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	701,463.000	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,160,756.190	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	770,701.600	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	698,139.000	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	908,145.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	635,173.500	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	351,771.200	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500,000.000	502,475.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	749,625.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	590,000.000	575,238.200	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	850,000.000	846,863.500	

	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,185,828.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	500,000.000	497,925.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	703,899.000	
マレーシア・リングット 小計			マレーシア・リングット 29,319,981.950 (781,963,918)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5% Mexican Bonos 20191211	21,447,000.000	20,687,776.200	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	13,290,000.000	11,627,686.800	
	8% Mexican Bonos 20471107	7,000,000.000	6,917,890.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	9,798,600.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	10,633,000.000	10,652,139.400	
	10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	24,347,710.440	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	22,668,000.000	21,931,290.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	8,124,655.560	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	9,141,512.160	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	10,089,321.320	
	8% Mexican Bonos 20200611	18,928,000.000	18,950,713.600	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	27,826,000.000	26,845,133.500	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	12,704,331.950	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	23,449,242.740	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	17,960,817.360	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	6,744,707.200	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 239,973,528.230 (1,379,847,787)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	440,009.280	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	414,256.680	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	292,213.440	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	417,189.660	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	200,798.000	

Finland Government Bond 20220415	770,000.000	778,470.000	
0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	301,065.000	
1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	382,224.800	
0.25% Austria Government Bond 20191018	527,000.000	531,526.930	
1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	932,948.910	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,159,926.380	
1.5% Austria Government Bond 20470220	734,000.000	759,132.160	
1.5% Austria Government Bond 20861102	150,000.000	141,042.000	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	903,834.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	581,838.600	
2.1% Austria Government Bond 21170920	340,000.000	390,452.600	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	403,668.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,019,080.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,448,538.590	
1% Belgium Government Bond 20310622	924,000.000	927,668.280	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	607,466.700	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,340,016.520	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	844,000.000	833,812.920	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	340,000.000	362,249.600	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	495,551.700	

0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,427,104.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	650,000.000	663,162.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	509,427.000	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	304,680.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	940,000.000	948,356.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	560,818.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,309,737.800	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,124,755.440	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,039,962.740	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,790,175.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,569,967.860	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,323,924.160	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,873,050.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,231,609.110	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,035,692.750	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,499,943.050	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,183,584.750	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,055,093.760	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	2,223,897.500	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,525,990.320	

2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,501,325.950	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,853,235.180	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,531,680.900	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	3,037,903.820	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,405,870.500	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,038,000.000	2,761,775.320	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,768,122.000	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,524,675.300	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,970,027.740	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,777,816.170	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,726,013.310	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,409,000.000	3,302,955.810	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,744,393.900	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,644,835.980	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,273,181.460	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,283,337.320	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,239,760.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,823,637.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,610,192.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,354,280.000	

1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	800,000.000	846,472.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,200,000.000	1,223,364.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	200,000.000	198,054.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20190913	100,000.000	100,633.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20191213	1,000,000.000	1,007,750.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200313	700,000.000	706,447.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200612	800,000.000	808,352.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200911	350,000.000	354,095.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,162,084.130	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,748,396.550	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,473,774.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,600,549.620	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,421,042.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	360,000.000	365,554.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,130,303.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	500,000.000	506,370.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	400,000.000	404,176.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	719,886.790	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,381,334.450	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,267,276.750	

5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,522,196.390	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,600,701.070	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,209,000.000	3,449,684.850	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,364,000.000	2,227,834.840	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,586,430.500	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	3,918,839.040	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,697,000.000	4,521,874.640	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	4,983,281.400	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	3,263,000.000	3,421,712.320	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,380,000.000	3,601,930.800	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	1,952,274.300	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,912,617.280	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,312,200.870	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,550,000.000	3,954,380.500	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	4,066,289.700	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,499,000.000	4,197,470.380	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,969,703.960	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,238,000.000	3,106,702.080	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,644,046.250	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,477,551.680	

2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,314,356.140	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,746,105.880	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2,322,000.000	2,352,394.980	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,360,934.480	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3,070,000.000	3,097,630.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,101,000.000	2,212,584.110	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,228,899.410	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	3,420,000.000	3,664,940.400	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,737,000.000	2,771,623.050	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,269,000.000	2,284,338.440	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	787,000.000	776,879.180	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,800,830.100	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,763,964.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	2,000,000.000	2,020,160.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	620,000.000	668,316.600	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200225	700,000.000	705,502.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,608,550.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,950,000.000	2,136,517.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	1,700,000.000	1,710,421.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,148,585.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	1,400,000.000	1,414,658.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	950,000.000	971,251.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	1,100,000.000	1,106,281.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	1,100,000.000	1,097,602.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	735,043.360	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,828,429.470	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,094,938.400	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	931,220.570	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,233,199.140	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,349,000.000	2,156,255.090	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,620,272.500	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,583,007.920	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,453,307.360	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,516,159.500	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,149,000.000	1,640,438.790	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,694,362.820	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,390,652.880	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,304,594.230	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,367,141.640	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,215,312.000	

0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,241,472.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	800,000.000	803,288.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	950,000.000	976,543.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,464,686.860	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,468,674.300	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,075,753.200	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,818,117.780	
1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,450,996.750	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,371,096.920	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,600,150.410	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,577,395.610	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,491,813.300	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,503,883.190	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,591,000.000	1,526,580.410	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,473,814.720	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	765,996.840	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,251,115.200	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,245,791.590	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,192,057.700	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,632,250.440	

2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	799,999.200	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,405,633.600	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	648,088.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,308,853.980	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	648,000.000	546,251.040	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191015	858,000.000	852,920.640	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,200,000.000	1,093,272.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,010,000.000	1,912,494.900	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,261,806.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,222,487.500	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	970,000.000	959,504.600	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,420,144.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,000,000.000	936,600.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	672,651.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	700,000.000	658,294.000	
0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015	1,900,000.000	1,863,653.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	800,000.000	745,744.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,392,375.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	856,350.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	900,000.000	838,593.000	

0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	500,000.000	483,180.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	550,000.000	538,142.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,454,000.000	2,943,303.060	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,662,531.950	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,655,000.000	2,115,487.200	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,017,607.090	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,015,086.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,042,104.400	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,898,805.520	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	2,464,841.880	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,511,935.920	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	2,531,000.000	2,619,863.410	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,428,308.180	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,471,008.500	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,683,238.400	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,335,105.800	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,325,914.100	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,267,751.680	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,486,723.390	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,224,547.680	

5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,875,359.460	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,164,354.700	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,810,000.000	2,080,975.100	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,084,953.080	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,613,000.000	1,921,486.250	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,424,918.500	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,828,936.200	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,351,768.500	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,002,283.460	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,618,472.070	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,483,253.600	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,677,256.640	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	1,012,382.490	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	1,888,090.960	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,568,870.180	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,652,055.000	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,311,490.180	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,557,854.480	
4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	940,875.200	
3% Belgium Government Bond 20190928	1,123,000.000	1,164,932.820	

2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,490,732.700	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	753,000.000	1,108,732.260	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,723,405.600	
3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	754,452.780	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	570,000.000	610,527.000	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,497,070.770	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	853,028.550	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	593,903.520	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	714,742.500	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	872,813.730	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	533,740.080	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	831,889.960	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,108,591.410	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	350,000.000	361,455.500	
IRISH TREASURY 20221018	50,000.000	50,153.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	502,110.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	694,673.000	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	735,000.000	793,998.450	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,243,176.000	
3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,349,986.560	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,495,300.800	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,073,000.000	1,631,550.150	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,176,665.000	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	911,281.830	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	1,006,035.120	
3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	555,100.800	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	884,940.350	

1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,048,992.560	
2.4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	749,304.810	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,022,674.280	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	840,586.750	
3.375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	671,974.000	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	506,607.480	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	471,810.320	
1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	658,567.080	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	480,689.880	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	542,417.040	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	588,597.140	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,379,047.840	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,834,378.900	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,552,000.000	1,598,932.480	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,940,843.520	
1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,650,000.000	1,694,187.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,846,788.780	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,788,473.780	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,452,000.000	1,562,555.280	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	850,000.000	978,401.000	

1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,730,000.000	1,751,054.100	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	1,380,000.000	1,395,552.600	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	1,837,062.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,450,000.000	1,523,761.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,800,000.000	1,821,618.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	300,000.000	301,125.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,000,000.000	1,009,790.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,100,000.000	2,102,667.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	650,000.000	664,774.500	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	700,000.000	697,487.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	700,000.000	696,976.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	2,946,572.680	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,190,210.260	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,608,000.000	2,338,337.520	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,060,079.960	
4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,870,850.000	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,573,000.000	2,238,347.540	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,250,023.930	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,789,000.000	2,240,776.170	
4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,862,480.760	

	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,886,264.300	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,677,096.350	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,368,140.720	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,190,679.360	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,601,000.000	1,917,837.900	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,385,871.500	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,499,000.000	2,281,597.920	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,315,183.400	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,355,560.100	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,946,930.000	
	ユーロ 小計		ユーロ 511,136,078.950 (65,614,538,454)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,729,931.200	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	16,434,000.000	17,632,038.600	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	8,612,000.000	6,042,351.440	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,480,335.700	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,119,719.200	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,298,638.950	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	5,539,000.000	5,363,746.040	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	15,452,000.000	13,556,812.200	

	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,691,867.400	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	11,862,000.000	10,586,360.520	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	11,944,000.000	10,498,417.680	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	8,243,000.000	7,331,241.770	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	6,166,000.000	5,661,806.180	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	5,179,000.000	4,714,702.650	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 114,707,969.530 (827,044,460)	
国債証券 合計			163,192,191,471 [163,192,191,471]	
合計			163,192,191,471 [163,192,191,471]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 244銘柄	100%	44.9%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	100%	6.7%
オーストラリア・ドル	国債証券 24銘柄	100%	2.1%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.6%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券 34銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 302銘柄	100%	40.2%
南アフリカ・ランド	国債証券 14銘柄	100%	0.5%

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。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	34,244,925	104,826,684
金銭信託	-	1,502,922
コール・ローン	107,945,438	60,701,524
国債証券	6,315,666,071	9,020,136,867
派生商品評価勘定	809,390	21,867
未収入金	178,879	-
未収利息	83,411,736	123,920,829
前払費用	14,004,347	22,672,966
流動資産合計	6,556,260,786	9,333,783,659
資産合計	6,556,260,786	9,333,783,659
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	311,933	723,381
未払金	27,939,820	20,385,000
未払解約金	9,969,725	6,319,491
その他未払費用	-	466
流動負債合計	38,221,478	27,428,338
負債合計	38,221,478	27,428,338
純資産の部		
元本等		
元本	1	4,669,291,401
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,762,976,195
元本等合計		6,518,039,308

純資産合計	6,518,039,308	9,306,355,321
負債純資産合計	6,556,260,786	9,333,783,659

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<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29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1. 1 期首	平成28年9月8日	平成29年9月8日
期首元本額	2,931,373,375円	4,669,291,401円
期中追加設定元本額	2,312,923,214円	3,373,618,783円
期中一部解約元本額	575,005,188円	499,531,058円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	114,332,817円	190,640,540円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	148,072,122円	366,615,948円
D-I's 新興国債券インデックス	38,217,127円	49,787,554円
iFree 新興国債券インデックス	628,484,771円	1,524,145,810円
iFree 8資産バランス	393,425,900円	925,602,549円
DCダイワ新興国債券インデックスファンド	3,141,494,222円	4,271,046,476円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	180,636,804円	185,588,639円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	24,627,638円	29,951,610円
計	4,669,291,401円	7,543,379,126円
2. 期末日における受益権の総数	4,669,291,401口	7,543,379,126口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	54,647,085	179,522,411
合計	54,647,085	179,522,411

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年7月6日から平成29年9月7日まで、及び平成30年7月6日から平成30年9月7日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成29年9月7日 現在				平成30年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	2,638,542	-	2,626,610	11,932
トルコ・リラ	-	-	-	-	2,638,542	-	2,626,610	11,932
買 建	103,316,843	-	103,814,300	497,457	106,403,957	-	105,690,511	713,446
チェコ・ コロナ	16,547,229	-	16,467,000	80,229	37,725,768	-	37,519,320	206,448
トルコ・リラ	4,733,100	-	4,732,500	600	-	-	-	-
ハンガリー・ フォリント	8,983,692	-	8,918,700	64,992	23,508,179	-	23,432,531	75,648
ポーランド・ ズロチ	24,117,858	-	24,201,600	83,742	24,974,027	-	24,673,460	300,567

メキシコ・ペソ	15,667,379	-	15,763,800	96,421	-	-	-	-
ルーマニア・レイ	11,112,750	-	11,040,900	71,850	20,195,983	-	20,065,200	130,783
南アフリカ・ランド	22,154,835	-	22,689,800	534,965	-	-	-	-
合計	103,316,843	-	103,814,300	497,457	109,042,499	-	108,317,121	701,514

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.3959円	1.2337円
(1万口当たり純資産額)	(13,959円)	(12,337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	アルゼンチン・ペソ		アルゼンチン・ペソ	アルゼンチン・ペソ	

	18.2% REPUBLIC OF ARGENTINA 20211003	4,700,000.000	3,639,539.000	
	16% REPUBLIC OF ARGENTINA 20231017	9,400,000.000	7,392,536.000	
	15.5% REPUBLIC OF ARGENTINA 20261017	16,800,000.000	12,489,624.000	
アルゼンチン・ペソ 小計			アルゼンチン・ペソ 23,521,699.000 (69,389,012)	
インドネシア・ ルピア		インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	5,750,000,000.000	5,372,225,000.000	
	8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	4,000,000,000.000	3,972,440,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	2,800,000,000.000	2,509,444,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	4,300,000,000.000	3,726,939,000.000	
	11% Indonesia Treasury Bond 20201115	2,400,000,000.000	2,554,464,000.000	
	12.8% Indonesia Treasury Bond 20210615	1,600,000,000.000	1,780,752,000.000	
	11% Indonesia Treasury Bond 20250915	1,700,000,000.000	1,893,341,000.000	
	10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	4,180,000,000.000	4,707,641,400.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20210715	7,210,000,000.000	7,225,789,900.000	
	9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,132,072,900.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	10,224,000,000.000	10,032,300,000.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	4,533,257,500.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20270515	10,330,000,000.000	9,267,146,300.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20220515	8,660,000,000.000	8,332,045,800.000	
	5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515	5,910,000,000.000	5,283,480,900.000	

	6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	8,700,000,000.000	7,352,370,000.000	
	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	4,975,000,000.000	4,144,523,250.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	10,020,000,000.000	9,589,641,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	11,150,000,000.000	11,007,168,500.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	7,820,000,000.000	7,977,260,200.000	
インドネシア・ルピア 小計			インドネシア・ルピア 114,394,302,650.000 (857,957,269)	
ウルグアイ・ペソ	9.875% Uruguay Government International Bond 20220620	5,300,000.000	5,018,146.000	
	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,225,300.000	
ウルグアイ・ペソ 小計			ウルグアイ・ペソ 7,243,446.000 (24,627,716)	
コロンビア・ペソ	9.85% Colombia Government International Bond 20270628	90,000,000.000	112,104,900.000	
	7.75% Colombia Government International Bond 20210414	95,000,000.000	99,873,500.000	
	4.375% Colombia Government International Bond 20230321	45,000,000.000	42,975,000.000	
	11% Colombian TES 20200724	2,265,000,000.000	2,504,954,100.000	
	7% Colombian TES 20220504	2,935,000,000.000	3,060,882,150.000	
	10% Colombian TES 20240724	3,050,000,000.000	3,598,329,000.000	
	6% Colombian TES 20280428	1,690,000,000.000	1,592,402,500.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	3,310,000,000.000	3,481,822,100.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	1,700,000,000.000	1,807,695,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	1,800,000,000.000	1,774,422,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	500,000,000.000	492,055,000.000	
コロンビア・ペソ 小計			コロンビア・ペソ 18,567,515,250.000	

			(664,717,046)	
タイ・パーツ		タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	4.875% Thailand Government Bond 20290622	23,050,000.000	27,345,828.500	
	3.625% Thailand Government Bond 20230616	19,300,000.000	20,474,984.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	17,610,000.000	19,119,881.400	
	3.65% Thailand Government Bond 20211217	26,600,000.000	27,959,526.000	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	18,700,000.000	20,039,294.000	
	2.55% Thailand Government Bond 20200626	10,000,000.000	10,124,000.000	
	1.875% Thailand Government Bond 20220617	21,200,000.000	20,996,692.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	14,100,000.000	14,337,303.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	23,400,000.000	22,549,644.000	
	2% Thailand Government Bond 20221217	16,000,000.000	15,878,240.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	15,000,000.000	16,127,400.000	
2.875% Thailand Government Bond 20460617	15,000,000.000	13,847,550.000		
タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 228,800,342.900 (771,057,156)		
チェコ・コルナ		チェコ・コルナ	チェコ・コルナ	
	3.75% Czech Republic Government Bond 20200912	6,500,000.000	6,817,330.000	
	3.85% Czech Republic Government Bond 20210929	8,200,000.000	8,816,640.000	
	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	10,600,000.000	11,003,860.000	
	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	8,600,000.000	10,518,316.000	
1.5% Czech Republic Government Bond 20191029	6,000,000.000	6,022,140.000		

	4.7% Czech Republic Government Bond 20220912	10,200,000.000	11,440,320.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	6,100,000.000	6,281,170.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	10,900,000.000	10,085,334.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	5,000,000.000	4,380,500.000	
	Czech Republic Government Bond 20200210	1,900,000.000	1,875,965.000	
	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	2,900,000.000	2,726,609.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	3,000,000.000	2,597,850.000	
	チェコ・コルナ 小計		チェコ・コルナ 82,566,034.000 (412,004,509)	
チリ・ペソ		チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20210301	325,000,000.000	330,859,750.000	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	370,000,000.000	371,676,100.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	400,000,000.000	400,984,000.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	260,000,000.000	292,650,800.000	
	5.5% Chile Government International Bond 20200805	50,000,000.000	51,661,500.000	
	チリ・ペソ 小計		チリ・ペソ 1,447,832,150.000 (232,087,493)	
トルコ・リラ		トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	10.5% Turkey Government Bond 20200115	680,000.000	570,860.000	
	9.5% Turkey Government Bond 20220112	1,660,000.000	1,106,572.600	
	8.5% Turkey Government Bond 20220914	790,000.000	469,252.100	
	7.1% Turkey Government Bond 20230308	4,280,000.000	2,356,910.400	

	8.8% Turkey Government Bond 20230927	1,390,000.000	812,635.700	
	10.4% Turkey Government Bond 20240320	680,000.000	428,638.000	
	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,106,835.200	
	7.4% Turkey Government Bond 20200205	2,070,000.000	1,633,954.500	
	8% Turkey Government Bond 20250312	1,490,000.000	830,883.600	
	9.4% Turkey Government Bond 20200708	1,180,000.000	903,113.000	
	10.7% Turkey Government Bond 20210217	1,610,000.000	1,165,640.000	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000	1,541,460.300	
	9.2% Turkey Government Bond 20210922	1,010,000.000	693,021.600	
	11% Turkey Government Bond 20220302	1,400,000.000	924,210.000	
	11% Turkey Government Bond 20270224	1,470,000.000	908,842.200	
	10.7% Turkey Government Bond 20220817	1,900,000.000	1,231,675.000	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	1,700,000.000	1,038,377.000	
	12.2% Turkey Government Bond 20230118	1,400,000.000	939,988.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	2,000,000.000	1,418,660.000	
	トルコ・リラ 小計		トルコ・リラ 20,081,529.200 (336,968,060)	
ハンガリー・ フォリント		ハンガリー・フォリント	ハンガリー・フォリント	
	3.5% Hungary Government Bond 20200624	66,300,000.000	69,110,457.000	
	3% Hungary Government Bond 20240626	98,500,000.000	100,146,920.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	128,000,000.000	122,996,480.000	

	2.5% Hungary Government Bond 20211027	39,000,000.000	39,947,310.000	
	1% Hungary Government Bond 20200923	14,000,000.000	13,999,440.000	
	1.75% Hungary Government Bond 20221026	90,000,000.000	89,142,300.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	40,000,000.000	38,119,600.000	
	0.5% Hungary Government Bond 20210421	60,000,000.000	58,509,000.000	
	7.5% Hungary Government Bond 20201112	99,500,000.000	112,877,775.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	81,800,000.000	96,411,116.000	
	7% Hungary Government Bond 20220624	125,000,000.000	147,808,750.000	
	5.5% Hungary Government Bond 20250624	142,500,000.000	164,965,125.000	
	ハンガリー・フォリント 小計		ハンガリー・フォリント 1,054,034,273.000 (414,973,293)	
フィリピン・ペソ	4.95% Philippine Government International Bond 20210115	フィリピン・ペソ 15,000,000.000	フィリピン・ペソ 15,099,000.000	
	フィリピン・ペソ 小計		フィリピン・ペソ 15,099,000.000 (30,952,950)	
ブラジル・リアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20210101	ブラジル・リアル 3,030,000.000	ブラジル・リアル 3,050,270.700	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101	4,410,000.000	4,237,304.400	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	3,990,000.000	3,690,590.400	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	2,750,000.000	2,464,220.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	500,000.000	440,710.000	

	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20200101	3,650,000.000	3,280,364.500	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20200701	8,640,000.000	7,382,793.600	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20210701	5,030,000.000	3,834,167.800	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220101	3,400,000.000	2,433,006.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20200401	2,300,000.000	2,016,249.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220701	3,500,000.000	2,353,925.000	
	ブラジル・リアル 小計		ブラジル・リアル 35,183,601.400 (958,401,303)	
ペルー・ソル	5.7% Peru Government Bond 20240812	1,130,000.000	1,185,720.300	ペルー・ソル
	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,470,000.000	1,572,282.600	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	1,450,000.000	1,503,766.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	1,065,000.000	1,275,145.800	
	7.84% Peru Government Bond 20200812	310,000.000	340,225.000	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	1,165,000.000	1,259,772.750	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	1,520,000.000	1,685,345.600	
	ペルー・ソル 小計		ペルー・ソル 8,822,258.050 (293,163,635)	
ポーランド・ズロチ	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,210,000.000	2,498,405.000	ポーランド・ズロチ
	5.5% Poland Government Bond 20191025	880,000.000	920,656.000	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,210,000.000	2,209,116.000	

	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,521,068.000	
	2% Poland Government Bond 20210425	1,560,000.000	1,568,736.000	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	2,230,000.000	2,223,756.000	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,890,000.000	2,729,460.500	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	1,650,000.000	1,652,970.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,000,000.000	2,003,400.000	
	Poland Government Bond 20200725	1,000,000.000	970,500.000	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	1,720,000.000	1,849,860.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,820,000.000	2,032,485.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,530,000.000	2,698,877.500	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	800,000.000	767,480.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	1,850,000.000	1,878,582.500	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 28,525,352.500 (846,632,462)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.226% Malaysia Government Investment Issue 20200415	530,000.000	527,657.400	
	3.948% Malaysia Government Investment Issue 20220414	800,000.000	803,296.000	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,200,000.000	1,199,232.000	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,570,000.000	1,586,218.100	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,350,000.000	1,370,209.500	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,510,000.000	1,510,392.600	

	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,754,616.000	
	3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	910,000.000	911,920.100	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,350,000.000	1,334,110.500	
	3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	1,040,000.000	1,042,173.600	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	900,000.000	895,050.000	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,300,000.000	1,270,347.000	
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	1,200,000.000	1,199,220.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,420,000.000	1,419,290.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,120,000.000	2,066,957.600	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,100,000.000	1,095,941.000	
	マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 19,986,631.400 (533,043,459)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5% Mexican Bonos 20191211	6,000,000.000	5,787,600.000	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	10,400,000.000	9,099,168.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	4,500,000.000	4,447,215.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	5,000,000.000	4,899,300.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	4,250,000.000	4,257,650.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	18,350,000.000	20,198,946.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	10,230,000.000	9,897,525.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	7,390,000.000	8,734,536.600	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	7,230,000.000	7,473,217.200	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	4,100,000.000	4,267,198.000	
	8% Mexican Bonos 20200611	16,990,000.000	17,010,388.000	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	21,950,000.000	21,176,262.500	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	7,950,000.000	7,760,233.500	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	19,450,000.000	18,540,907.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	11,320,000.000	10,899,348.800	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	4,130,000.000	4,011,469.000	

メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 158,460,964.600 (911,150,547)	
ルーマニア・レイ		ルーマニア・レイ	ルーマニア・レイ	
	5.85% Romania Government Bond 20230426	1,430,000.000	1,523,236.000	
	5.95% Romania Government Bond 20210611	940,000.000	982,929.800	
	5.75% Romania Government Bond 20200429	770,000.000	795,001.900	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	1,150,000.000	1,171,275.000	
	3.25% Romania Government Bond 20210322	630,000.000	618,452.100	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	700,000.000	747,978.000	
	2.25% Romania Government Bond 20200226	700,000.000	686,308.000	
	3.5% Romania Government Bond 20221219	1,090,000.000	1,056,646.000	
	3.25% Romania Government Bond 20240429	800,000.000	752,952.000	
3.4% Romania Government Bond 20220308	800,000.000	777,976.000		
ルーマニア・レイ 小計			ルーマニア・レイ 9,112,754.800 (252,149,925)	
ロシア・ルーブル		ロシア・ルーブル	ロシア・ルーブル	
	7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20210414	14,880,000.000	14,752,032.000	
	8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203	31,760,000.000	30,306,980.000	
	7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20220720	11,910,000.000	11,615,703.900	
	6.8% Russian Federal Bond - OFZ 20191211	10,800,000.000	10,695,456.000	
7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	14,400,000.000	13,589,136.000		

	7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	36,160,000.000	31,909,392.000	
	6.4% Russian Federal Bond - OFZ 20200527	22,100,000.000	21,600,982.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	24,300,000.000	22,699,359.000	
	7.5% Russian Federal Bond - OFZ 20210818	29,300,000.000	28,820,652.000	
	8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	24,000,000.000	23,270,400.000	
	7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	36,100,000.000	33,741,226.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	39,000,000.000	37,635,000.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	47,000,000.000	42,276,970.000	
	7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	35,600,000.000	32,816,792.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20211215	34,000,000.000	32,760,360.000	
	6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	11,000,000.000	9,947,630.000	
	7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	10,000,000.000	8,580,100.000	
	6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	7,000,000.000	6,031,690.000	
	ロシア・ルーブル 小計		ロシア・ルーブル 413,049,860.900 (656,749,279)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	4,190,000.000	4,162,346.000	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	19,050,000.000	20,438,745.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	10,220,000.000	7,170,556.400	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	3,760,000.000	3,644,756.000	

	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	5,280,000.000	3,628,944.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,440,000.000	6,845,262.000	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	5,880,000.000	5,693,956.800	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	14,020,000.000	12,300,447.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	8,000,000.000	7,035,200.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	7,100,000.000	6,336,466.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	8,100,000.000	7,119,657.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	10,300,000.000	9,160,717.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	5,100,000.000	4,682,973.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	7,000,000.000	6,372,450.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 104,592,476.200 (754,111,753)	
国債証券 合計			9,020,136,867 [9,020,136,867]	
合計			9,020,136,867 [9,020,136,867]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アルゼンチン・ペソ	国債証券 3銘柄	100%	0.8%
インドネシア・ルピア	国債証券 20銘柄	100%	9.5%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 2銘柄	100%	0.3%
コロンビア・ペソ	国債証券 11銘柄	100%	7.4%
タイ・バーツ	国債証券 12銘柄	100%	8.5%
チェコ・コルナ	国債証券 12銘柄	100%	4.6%
チリ・ペソ	国債証券 5銘柄	100%	2.6%

トルコ・リラ	国債証券	19銘柄	100%	3.7%
ハンガリー・フォリント	国債証券	12銘柄	100%	4.6%
フィリピン・ペソ	国債証券	1銘柄	100%	0.3%
ブラジル・レアル	国債証券	11銘柄	100%	10.5%
ペルー・ソル	国債証券	7銘柄	100%	3.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	100%	9.4%
マレーシア・リングgit	国債証券	16銘柄	100%	5.9%
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	100%	10.1%
ルーマニア・レイ	国債証券	10銘柄	100%	2.8%
ロシア・ルーブル	国債証券	18銘柄	100%	7.3%
南アフリカ・ランド	国債証券	14銘柄	100%	8.4%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	31,433,221
コール・ローン	763,878,325	1,269,556,853
投資証券	241,351,534,100	211,120,283,560
派生商品評価勘定	3,668,256	60,285,600
未収入金	702,544,074	-
未収配当金	3,002,690,815	2,565,948,292
前払金	27,533,600	-
流動資産合計	245,851,849,170	215,047,507,526
資産合計	245,851,849,170	215,047,507,526
負債の部		
流動負債		
前受金	-	72,180,000
未払金	-	95,618,232
未払解約金	720,570,100	88,714,000

その他未払費用	-	12,455
流動負債合計	720,570,100	256,524,687
負債合計	720,570,100	256,524,687
純資産の部		
元本等		
元本	1	104,098,531,305
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		141,032,747,765
元本等合計		245,131,279,070
純資産合計		245,131,279,070
負債純資産合計		245,851,849,170
		215,047,507,526

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7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29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1. 1 期首	平成28年9月8日	平成29年9月8日
期首元本額	99,217,975,833円	104,098,531,305円
期中追加設定元本額	21,445,242,962円	6,062,089,203円
期中一部解約元本額	16,564,687,490円	26,090,313,359円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ - REITオープン	10,420,082,916円	8,235,513,016円
ダイワJ - REITオープン （毎月分配型）	87,120,449,908円	67,928,505,128円
ダイワJ - REITオープン （年1回決算型）	390,876,376円	408,772,189円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	22,838円	30,010円
iFree J - REITイ ンデックス	70,311,939円	134,289,664円
iFree 8資産バランス	232,758,606円	451,203,721円
DC・ダイワJ - REIT オープン	3,507,061,550円	3,694,470,466円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,679,735円	2,917,015円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,975,042円	5,244,205円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,072,495円	1,396,903円
ダイワ・ノーロード J - R EITファンド	62,753,535円	50,917,209円
ダイワファンドラップ J - REITインデックス	625,477,168円	958,089,363円
ダイワJ - REITインデッ クス（ダイワSMA専用）	1,418,981円	361,884,475円
ダイワファンドラップオンラ イン J - REITインデッ クス	173,023,652円	368,976,313円
ダイワ・インデックスセレク ト J - REIT	1,483,566,564円	1,468,097,472円
計	104,098,531,305円	84,070,307,149円
2. 期末日における受益権の総数	104,098,531,305口	84,070,307,149口

3. 2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 346,200,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 386,400,000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29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年9月7日現在	平成30年9月7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	15,344,080,357	6,490,336,661
合計	15,344,080,357	6,490,336,661

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年3月16日から平成29年9月7日まで、及び平成30年3月16日から平成30年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	平成29年9月7日 現在				平成30年9月7日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	3,594,977,600	-	3,598,880,000	3,902,400	3,079,620,000	-	3,140,100,000	60,480,000
合計	3,594,977,600	-	3,598,880,000	3,902,400	3,079,620,000	-	3,140,100,000	60,480,000

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1口当たり純資産額	2,3548円	2,5549円
（1万口当たり純資産額）	（23,548円）	（25,549円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	8,301	4,200,306,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	28,152	2,401,365,600	
	森ヒルズリート	28,651	4,077,037,300	
	産業ファンド	29,106	3,318,084,000	
	アドバンス・レジデンス	24,347	6,875,592,800	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	14,820	2,520,882,000	
	A P I 投資法人	11,971	5,811,920,500	
	G L P 投資法人	61,830	6,690,006,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	9,528	2,473,468,800	
	日本プロロジスリート	33,509	7,144,118,800	
	星野リゾート・リート	3,801	2,105,754,000	
	O N E リート投資法人	2,902	697,931,000	
	イオンリート投資	25,643	3,043,824,100	
	ヒューリックリート投資法	18,017	2,929,564,200	
	日本リート投資法人	8,064	2,899,008,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	148,086	2,363,452,560	
	日本ヘルスケア投資法	1,144	203,403,200	
	積水ハウス・リート投資	64,456	4,640,832,000	
トーセイ・リート投資法人	4,016	446,980,800		

ケネディクス商業リート	9,156	2,202,933,600	
ヘルスケア&メディカル投資	3,308	378,104,400	
サムティ・レジデンシャル	5,000	453,500,000	
野村不動産マスターF	74,045	11,380,716,500	
いちごホテルリート投資	4,368	604,531,200	
ラサールロジポート投資	18,846	1,899,676,800	
スターアジア不動産投	7,690	789,763,000	
マリモ地方創生リート	2,148	238,642,800	
三井不ロジパーク	4,265	1,330,680,000	
大江戸温泉リート	4,032	343,123,200	
さくら総合リート	5,405	488,612,000	
投資法人みらい	5,812	1,106,604,800	
森トラスト・ホテルリート投	5,861	818,195,600	
三菱地所物流REIT	2,316	571,357,200	
CREロジスティクスファンド	2,501	268,857,500	
ザイマックス・リート	2,304	253,900,800	
タカラレーベン不動産投	3,682	328,802,600	
日本ビルファンド	24,192	15,579,648,000	
ジャパンリアルエステイト	24,982	14,664,434,000	
日本リテールファンド	47,215	9,594,088,000	
オリックス不動産投資	49,776	8,616,225,600	
日本プライムリアルティ	15,814	6,333,507,000	
プレミア投資法人	23,752	2,707,728,000	
東急リアル・エステート	16,749	2,572,646,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	15,973	1,838,492,300	
ユナイテッド・アーバン投資法人	55,098	9,642,150,000	
森トラスト総合リート	17,854	2,903,060,400	
インヴィンシブル投資法人	87,422	4,121,947,300	
フロンティア不動産投資	8,498	3,785,859,000	
平和不動産リート	15,557	1,697,268,700	
日本ロジスティクスファンド投資法人	16,643	3,526,651,700	
福岡リート投資法人	12,920	2,210,612,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	7,728	5,324,592,000	
いちごオフィスリート投資法人	20,726	1,894,356,400	
大和証券オフィス投資法人	5,766	3,949,710,000	
阪急阪神リート投資法人	10,364	1,455,105,600	
スターツプロシード投資法人	3,936	672,268,800	
大和ハウスリート投資法人	31,278	7,982,145,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	72,334	5,967,555,000	
日本賃貸住宅投資法人	28,099	2,526,100,100	

	ジャパンエクセレント投資法人	22,370	3,252,598,000	
投資証券	合計		211,120,283,560	
合計			211,120,283,560	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド 600口

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	116,489,268	495,936,765
金銭信託	-	16,968,965
コール・ローン	59,623,330	685,359,770
出資証券	-	1,057,006
投資信託受益証券	27,620,703	222,178,145
投資証券	11,593,941,852	18,188,431,705
派生商品評価勘定	-	2,340,602
未収入金	294,973	111,004,335
未収配当金	7,202,288	14,700,220
差入委託証拠金	-	53,983,590
流動資産合計	11,805,172,414	19,791,961,103
資産合計	11,805,172,414	19,791,961,103
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	19,141	2,778,350
未払金	80,877,803	886,822,111

未払解約金		1,373,000	654,000
その他未払費用		-	522
流動負債合計		82,269,944	890,254,983
負債合計		82,269,944	890,254,983
純資産の部			
元本等			
元本	1	5,412,642,039	8,231,121,083
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,310,260,431	10,670,585,037
元本等合計		11,722,902,470	18,901,706,120
純資産合計		11,722,902,470	18,901,706,120
負債純資産合計		11,805,172,414	19,791,961,103

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)出資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p>

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1. 1 期首	平成28年9月8日	平成29年9月8日
期首元本額	1,553,985,694円	5,412,642,039円
期中追加設定元本額	4,163,085,786円	3,412,686,057円
期中一部解約元本額	304,429,441円	594,207,013円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジあり）	2,781,367,013円	4,130,870,595円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジなし）	336,215,141円	566,222,806円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス（為替ヘッジあり）	155,179,391円	329,680,925円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス（為替ヘッジなし）	108,367,487円	235,672,616円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,193,732円	1,220,713円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	26,742円	35,023円
iFree 外国REITイ ンデックス	61,050,918円	74,036,398円
iFree 8資産バランス	252,712,338円	499,504,519円

DCダイワ・グローバルREIT	1,383,753,601円	1,662,020,791円
ITインデックスファンド		
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	4,102,272円	3,255,863円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,620,322円	5,817,250円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,028,979円	1,354,288円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	290,216,075円	277,810,112円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	21,617,058円	24,787,457円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	4,623,594円	198,053,967円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	4,567,376円	220,777,760円
計	5,412,642,039円	8,231,121,083円
2. 期末日における受益権の総数	5,412,642,039口	8,231,121,083口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年9月8日 至 平成30年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年9月7日現在	平成30年9月7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）
出資証券	-	165,512
投資信託受益証券	129,936	26,522
投資証券	284,382,540	427,296,548
合計	284,512,476	427,104,514

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成28年12月1日から平成29年9月7日まで、及び平成29年12月1日から平成30年9月7日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	平成29年9月7日 現在				平成30年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	-	-	-	-	405,239,788	-	406,892,918	1,653,130
合計	-	-	-	-	405,239,788	-	406,892,918	1,653,130

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	平成29年9月7日 現在				平成30年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外 の取引								
為替予約取引								
買 建	40,416,291	-	40,397,150	19,141	675,270,868	-	673,179,990	2,090,878
アメリカ・ドル	21,836,720	-	21,836,000	720	470,766,400	-	469,112,500	1,653,900
イギリス・ ポンド	-	-	-	-	46,319,914	-	46,249,080	70,834

オーストラ リア・ドル	-	-	-	-	9,510,360	-	9,508,800	1,560
カナダ・ドル	2,673,309	-	2,673,300	9	4,240,625	-	4,192,000	48,625
シンガポ ール・ドル	10,128,600	-	10,113,000	15,600	42,629,465	-	42,581,200	48,265
ニュージ ーランド・ドル	2,357,340	-	2,357,100	240	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	82,797,319	-	82,541,910	255,409
香港・ドル	3,420,322	-	3,417,750	2,572	19,006,785	-	18,994,500	12,285
合計	40,416,291	-	40,397,150	19,141	675,270,868	-	673,179,990	2,090,878

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年9月7日現在	平成30年9月7日現在
1口当たり純資産額	2.1658円	2.2964円
(1万口当たり純資産額)	(21,658円)	(22,964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
出資証券	アメリカ・ドル	BROOKFIELD PROPERTY PARTNERS	488.000	アメリカ・ドル 9,564.800	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 9,564.800 (1,057,006)	
出資証券 合計				1,057,006 [1,057,006]	
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	24,000.000	アメリカ・ドル 2,010,480.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 2,010,480.000 (222,178,145)	
投資信託受益証券 合計				222,178,145 [222,178,145]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	9,900	アメリカ・ドル 368,775.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	10,100	61,004.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	15,082	342,512.220	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	14,600	348,210.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,700	3,629,528.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	44,147	8,146,004.440	
		BOSTON PROPERTIES INC	22,000	2,857,580.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	22,455	984,876.300	
		VORNADO REALTY TRUST	24,664	1,877,177.040	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	8,600	172,774.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	7,600	212,344.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	2,400	76,248.000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	7,300	332,661.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	52,500	3,569,475.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	30,900	541,677.000	
		EPR PROPERTIES	9,200	647,220.000	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,700	16,694.000	
		CITY OFFICE REIT INC	3,800	48,374.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	10,133	219,176.790	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8,929	239,297.200	
CHATHAM LODGING TRUST	6,300	135,198.000			
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8,600	285,778.000			
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,600	183,132.000			

RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,300	635,319.000	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	38,100	956,691.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16,100	315,238.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,300	71,231.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	48,039.840	
HOST HOTELS & RESORTS INC	105,800	2,250,366.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	37,108	856,823.720	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	22,995	629,603.100	
CORESITE REALTY CORP	5,200	599,976.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	22,400	741,888.000	
RLJ LODGING TRUST	24,271	541,486.010	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	19,517.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	26,000	449,800.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	6,700	105,190.000	
CYRUSONE INC	14,100	938,355.000	
KIMCO REALTY CORP	60,600	1,059,288.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,800	17,226.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	29,250	827,775.000	
WHITESTONE REIT	4,400	60,016.000	
TIER REIT INC	7,200	176,328.000	
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	237	1,336.680	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,000	30,660.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	28,600	994,136.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17,700	350,637.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	28,700	970,634.000	
COLONY CAPITAL INC	68,711	426,695.310	
INVITATION HOMES INC	40,897	953,718.040	
JBG SMITH PROPERTIES	13,332	491,150.880	
ALEXANDER & BALDWIN INC	9,233	215,867.540	
CLIPPER REALTY INC	1,400	16,828.000	
GLADSTONE LAND CORP	900	11,889.000	
INFRAREIT INC	5,600	117,264.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	6,000	148,380.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2,500	59,450.000	
SPIRIT MTA REIT	5,870	62,515.500	
RETAIL VALUE INC	1,957	66,205.310	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	26,560	201,059.200	
CORECIVIC INC	16,324	420,343.000	
STORE CAPITAL CORP	24,600	718,812.000	

SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,100	191,478.000	
LIFE STORAGE INC	6,600	648,054.000	
SELECT INCOME REIT	9,200	189,796.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,900	229,982.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	11,882	122,622.240	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	5,300	93,280.000	
PARAMOUNT GROUP INC	29,200	458,732.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	19,000	333,260.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	12,500	399,750.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	16,200	391,878.000	
STAG INDUSTRIAL INC	14,400	411,408.000	
VENTAS INC	50,879	3,058,845.480	
CARETRUST REIT INC	11,103	202,296.660	
GEO GROUP INC/THE	17,600	453,376.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	43,200	784,944.000	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	13,100	220,473.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	25,487	600,473.720	
UMH PROPERTIES INC	4,200	66,822.000	
IRON MOUNTAIN INC	40,200	1,458,054.000	
TERRENO REALTY CORP	7,600	286,900.000	
VEREIT INC	138,208	1,079,404.480	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	61,200	514,692.000	
SUN COMMUNITIES INC	11,400	1,146,954.000	
ACADIA REALTY TRUST	11,111	318,441.260	
ALEXANDER'S INC	500	179,425.000	
PROLOGIS INC	89,802	6,032,898.360	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,700	1,890,567.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	25,500	426,360.000	
SAUL CENTERS INC	1,700	101,728.000	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	101,416.900	
MACK-CALI REALTY CORP	12,500	261,750.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,200	1,245,024.000	
COUSINS PROPERTIES INC	60,007	556,264.890	
DDR CORP	20,978	299,565.840	
DUKE REALTY CORP	51,000	1,455,030.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,000	485,550.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,467	2,331,816.770	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17,400	562,020.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,400	1,364,896.000	

GETTY REALTY CORP	4,203	122,769.630	
WELLTOWER INC	53,100	3,582,126.000	
HCP INC	67,000	1,807,660.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14,800	723,720.000	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	23,500	678,445.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	17,900	549,172.000	
EQUITY COMMONWEALTH	17,375	556,868.750	
KILROY REALTY CORP	14,100	1,019,712.000	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	15,800	547,154.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	21,100	918,272.000	
LTC PROPERTIES INC	5,500	255,145.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	29,700	262,251.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,228	1,682,194.480	
MACERICH CO/THE	15,500	886,755.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,700	1,223,010.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,900	464,094.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	22,000	1,015,740.000	
REALTY INCOME CORP	40,617	2,387,873.430	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,600	448,074.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	86,688.000	
PUBLIC STORAGE	21,400	4,595,650.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,700	352,566.000	
REGENCY CENTERS CORP	21,020	1,395,097.400	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	10,100	139,481.000	
ISTAR INC	8,400	92,820.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	13,500	319,005.000	
SL GREEN REALTY CORP	12,600	1,297,548.000	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	33,900	646,134.000	
TAUBMAN CENTERS INC	8,700	555,669.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,500	79,170.000	
UDR INC	38,200	1,532,966.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,600	121,760.000	
WP CAREY INC	15,300	1,013,778.000	
WASHINGTON REIT	11,200	355,600.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17,000	520,200.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,300	72,546.000	
AGREE REALTY CORP	4,300	235,941.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	28,350	938,385.000	
CUBESMART	26,000	793,780.000	

SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	31,226	519,600.640	
DIGITAL REALTY TRUST INC	29,378	3,649,041.380	
CEDAR REALTY TRUST INC	10,800	49,140.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	18,000	1,668,780.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,275	124,331.750	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	16,600	90,802.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	11,950	208,886.000	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	10,800	186,084.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	62,480.000	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19,500	822,705.000	
EDUCATION REALTY TRUST INC	11,500	476,330.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,600	70,812.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	27,342	320,995.080	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	6,849	90,817.740	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	52,100	779,937.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,700	117,409.000	
DOUGLAS EMMETT INC	22,800	882,816.000	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	31,300	400,640.000	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	168,727	140,887.040	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 118,747,999.040 (13,122,841,374)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
ASSURA PLC	333,170	187,241.540	
CAPITAL & REGIONAL PLC	59,270	26,671.500	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	75,350	72,788.100	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	97,170	87,841.680	
REGIONAL REIT LTD	35,960	34,665.440	
NEWRIVER REIT PLC	41,950	107,601.750	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	22,490	24,176.750	
LXI REIT PLC	21,160	23,699.200	
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	7,570	7,214.210	
RDI REIT PLC	173,260	56,049.610	
LAND SECURITIES GROUP PLC	110,591	980,942.170	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	60,790	60,607.630	
SEGRO PLC	148,570	966,893.560	
HAMMERSON PLC	116,760	520,049.040	
UNITE GROUP PLC	38,720	341,123.200	

	BRITISH LAND CO PLC	146,290	898,805.760	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	40,271	283,225.940	
	INTU PROPERTIES PLC	123,670	185,937.840	
	DERWENT LONDON PLC	16,310	486,201.100	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	107,560	121,973.040	
	WORKSPACE GROUP PLC	19,360	206,958.400	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	30,810	163,755.150	
	SHAFTESBURY PLC	36,190	330,052.800	
	BIG YELLOW GROUP PLC	21,850	211,398.750	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	101,920	185,494.400	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	76,600	48,641.000	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	216,900	326,651.400	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 6,946,660.960 (991,913,718)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	9,340	イスラエル・シュケル 141,220.800	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 141,220.800 (4,351,013)	
オーストラリ ア・ドル	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	29,900	オーストラリア・ドル 84,019.000	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	224,620	251,574.400	
	RURAL FUNDS GROUP	41,535	90,546.300	
	VIVA ENERGY REIT	56,900	124,611.000	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	22,520	95,935.200	
	PROPERTYLINK GROUP	49,060	52,739.500	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	106,800	258,456.000	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	37,200	140,244.000	
	NATIONAL STORAGE REIT	80,265	134,845.200	
	INDUSTRIA REIT	11,760	31,987.200	
	GDI PROPERTY GROUP	69,120	88,128.000	
	SCENTRE GROUP	788,120	3,254,935.600	
	ARENA REIT	35,380	83,143.000	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,300	67,095.000	
	BWP TRUST	71,560	236,863.600	
	DEXUS	149,380	1,604,341.200	
	GPT GROUP	265,680	1,370,908.800	

	INVESTA OFFICE FUND	67,500	373,950.000	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	48,780	207,802.800	
	MIRVAC GROUP	548,440	1,354,646.800	
	STOCKLAND	360,360	1,520,719.200	
	ABACUS PROPERTY GROUP	45,880	161,497.600	
	GOODMAN GROUP	237,260	2,493,602.600	
	VICINITY CENTRES	475,660	1,303,308.400	
	CHARTER HALL GROUP	68,520	490,603.200	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	28,460	86,233.800	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 15,962,737.400 (1,267,600,977)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,400	127,296.000	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	13,900	201,550.000	
	SLATE RETAIL REIT - U	3,100	40,052.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5,300	84,270.000	
	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2,700	37,125.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	40,035.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	7,200	81,360.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	4,500	39,465.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,000	166,500.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	5,200	53,456.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,600	84,512.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	19,000	235,790.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,700	27,676.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5,200	68,380.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,700	304,386.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,400	486,928.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	12,190	147,864.700	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,966	423,093.880	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2,300	28,244.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,000	581,210.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	131,922.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,200	160,064.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3,800	95,760.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,500	86,125.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,300	320,397.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル	

			4,053,461.580 (340,369,168)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	124,928	169,902.080	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	81,200	103,936.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	316,700	367,372.000	
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	89,000	125,490.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	219,850	237,438.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	398,875	698,031.250	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	355,500	956,295.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	399,200	846,304.000	
	SUNTEC REIT	331,200	619,344.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	321,700	405,342.000	
	KEPPEL REIT	266,600	314,588.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	91,660	128,324.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	188,600	205,574.000	
	ESR-REIT	175,437	86,841.310	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	112,300	175,188.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	80,400	182,508.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	176,900	122,945.500	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	87,600	126,144.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	57,300	156,429.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	267,200	72,144.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	181,380	364,573.800	
	CACHE LOGISTICS TRUST	145,200	106,722.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	281,900	456,678.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	127,100	81,979.500	
	SPH REIT	89,600	89,152.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	64,900	40,562.500	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	78,100	32,021.000	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	108,900	87,664.500	
	QUE HOSPITALITY TRUST	166,873	124,320.380	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 7,483,813.820 (601,548,955)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	51,480	100,386.000	
	INVESTORE PROPERTY LTD	23,130	35,388.900	

	ARGOSY PROPERTY LTD	109,000	119,900.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	210,260	289,107.500	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	44,560	92,016.400	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	152,500	227,987.500	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	131,170	187,573.100	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 1,052,359.400 (76,464,435)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	21,250	273,275.000	
	HAMBORNER REIT AG	10,680	98,469.600	
	WERELDHAVE NV	5,570	168,269.700	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	19,720	3,412,743.200	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	7,250	224,750.000	
	NSI NV	2,391	82,967.700	
	VASTNED RETAIL NV	2,050	68,777.500	
	ICADE	6,590	544,004.500	
	ALTAREA	540	107,460.000	
	GECINA SA	7,041	1,034,322.900	
	KLEPIERRE	30,340	917,481.600	
	COVIVIO	7,880	705,654.000	
	MERCIALYS	8,070	112,415.100	
	AEDIFICA	2,628	216,547.200	
	COFINIMMO	3,090	341,754.000	
	BEFIMMO	3,210	159,376.500	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	2,280	52,554.000	
	RETAIL ESTATES	980	74,480.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,440	302,560.000	
	BENI STABILI SPA	143,400	108,410.400	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	41,009.280	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	13,540	117,798.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	49,833	471,171.010	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	48,770	576,949.100	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	49,010	74,299.160	
	GREEN REIT PLC	100,940	154,034.440	
	HIBERNIA REIT PLC	95,320	143,551.920	
ユーロ 小計			ユーロ 10,585,085.810 (1,358,807,466)	
香港・ドル			香港・ドル	

	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	170,000	899,300.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	132,000	708,840.000	
	FORTUNE REIT	204,000	1,901,280.000	
	PROSPERITY REIT	158,000	488,220.000	
	LINK REIT	318,500	24,094,525.000	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	106,000	356,160.000	
	CHAMPION REIT	302,000	1,703,280.000	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 30,151,605.000 (424,534,599)	
投資証券 合計			18,188,431,705 [18,188,431,705]	
合計			18,411,666,856 [18,411,666,856]	

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

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 出資証券 時価 比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	出資証券 1銘柄 投資信託 1銘柄 受益証券 投資証券 159銘柄	0.0%	1.7%	98.3%	72.5%
イギリス・ポンド	投資証券 27銘柄	-%	-%	100%	5.4%
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 26銘柄	-%	-%	100%	6.9%
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	-%	-%	100%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券 29銘柄	-%	-%	100%	3.3%
ニュージーランド・ドル	投資証券 7銘柄	-%	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	-%	100%	7.4%
香港・ドル	投資証券 7銘柄	-%	-%	100%	2.3%

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。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2018年9月28日

資産総額	10,049,618,230円
負債総額	52,695,577円
純資産総額（ - ）	9,996,922,653円
発行済数量	8,417,136,638口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1877円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2018年9月28日

資産総額	165,975,551,051円
負債総額	13,461,810,594円
純資産総額（ - ）	152,513,740,457円
発行済数量	132,351,389,469口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1523円

(参考) ダイワJ - REITマザーファンド

純資産額計算書

2018年9月28日

資産総額	221,687,517,999円
負債総額	1,765,387,585円
純資産総額（ - ）	219,922,130,414円
発行済数量	84,336,513,359口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.6077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

2018年9月28日

資産総額	16,913,282,843円
負債総額	70,215,680円
純資産総額 (-)	16,843,067,163円
発行済数量	13,318,204,263口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.2647円

(参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2018年9月28日

資産総額	6,068,684,983円
負債総額	1,610,659円
純資産総額 (-)	6,067,074,324円
発行済数量	3,776,470,149口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.6065円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2018年9月28日

資産総額	112,069,689,572円
負債総額	113,424,536円
純資産総額 (-)	111,956,265,036円
発行済数量	42,648,559,439口
1 単位当たり純資産額 (/)	2.6251円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2018年9月28日

資産総額	19,268,033,798円
負債総額	122,549,701円
純資産総額(-)	19,145,484,097円
発行済数量	8,370,748,012口
1単位当たり純資産額(/)	2.2872円

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2018年9月28日

資産総額	10,075,160,279円
負債総額	5,539,278円
純資産総額(-)	10,069,621,001円
発行済数量	7,664,685,056口
1単位当たり純資産額(/)	1.3138円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2018年9月28日

資産総額	170,456,678,630円
負債総額	127,098,348円
純資産総額(-)	170,329,580,282円
発行済数量	61,147,896,834口
1単位当たり純資産額(/)	2.7855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。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された

受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2018年9月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年9月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	81	177,728
追加型株式投資信託	712	16,079,881
株式投資信託 合計	793	16,257,609
単位型公社債投資信託	28	107,888
追加型公社債投資信託	14	1,484,253
公社債投資信託 合計	42	1,592,142
総合計	835	17,849,750

3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1	213
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066
投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45
その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

（単位:百万円）

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2 4,946	2 4,476
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
固定負債		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月 31日)	当事業年度 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月 31日)
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973
賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316

役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31 日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	92	75
投資有価証券売却益	224	210
有価証券償還益	94	17
その他	69	55
営業外収益計	481	359
営業外費用		
投資有価証券売却損	24	0
その他	75	29
営業外費用計	100	29
経常利益	16,935	18,741
特別損失		
MMF等償還関連費用	305	-
関係会社整理損失	-	333
特別損失計	305	333
税引前当期純利益	16,629	18,407
法人税、住民税及び事業税	6,501	5,843
法人税等調整額	1,405	106
法人税等合計	5,096	5,737
当期純利益	11,533	12,670

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	13,261	13,261	13,261
当期純利益	-	-	-	11,533	11,533	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,728	1,728	1,728
当期末残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	280	280	41,284
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	13,261
当期純利益	-	-	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	15	15	15
当期変動額合計	15	15	1,743
当期末残高	264	264	39,540

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	40,631

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	26百万円	29百万円
器具備品	264百万円	235百万円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
未払金	4,877百万円	4,406百万円

3 保証債務

前事業年度(平成29年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,685百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(平成30年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

平成29年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月27日

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27日

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

平成30年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月26日

(金融商品関係)

1．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	31,260	31,260	-
(2) 未収委託者報酬	10,453	10,453	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	5,060	5,060	-
資産計	46,774	46,774	-
(1) 未払手数料	(4,453)	(4,453)	-
(2) その他未払金	(4,946)	(4,946)	-
(3) 未払費用(*2)	(3,409)	(3,409)	-
負債計	(12,809)	(12,809)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：百万円）

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

(3) 未払費用(*2)	(3,286)	(3,286)	-
負債計	(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	970
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	1,050	1,072

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成29年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成29年3月31日)

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

当事業年度(平成30年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成29年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	122	55	67
(2) その他			
証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	1,829	1,926	96
小計	1,829	1,926	96
合計	5,060	4,679	381

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

当事業年度(平成30年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	50	-	1
(2) その他 証券投資信託	4,371	224	23
合計	4,421	224	24

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首 残高	2,209百万円	2,318百万円
勤務費用	202	159
退職給付の支払額	122	166
その他	29	38
退職給付債務の期末 残高	2,318	2,350

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,318百万円	2,350百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350
退職給付引当金	2,318	2,350
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
勤務費用	202百万円	159百万円
その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

3. 確定拠出制度

社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度173百万円、当事業年度171百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		719
	709	
賞与引当金	224	244
未払事業税	169	162
出資金評価損	98	94
投資有価証券評価損	65	68
連結法人間取引（譲渡損）	5	5
その他	185	308
繰延税金資産小計	1,458	1,602
評価性引当額	201	200
繰延税金資産合計	1,257	1,402
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	639	639
その他有価証券評価差額金	146	164
繰延税金負債合計	786	804
繰延税金資産の純額	470	598

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

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

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28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,685	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,701	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	-------------	------	---------	-------	---	---

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,238	未払手数料	3,298
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	768	未払費用	218
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,036	長期差入保証金	1,028

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,158.25円	1株当たり純資産額	15,576.40円
1株当たり当期純利益	4,421.51円	1株当たり当期純利益	4,857.40円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,533	12,670
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 (2018年3月末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	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。
岩井コスモ証券株式会社	13,500	
株式会社SBI証券	48,323	
岡三オンライン証券株式会社	2,500	
カブドットコム証券株式会社	7,196	
GMOクリック証券株式会社	4,346	
静岡東海証券株式会社	600	
第四証券株式会社	600	
高木証券株式会社	11,069	
立花証券株式会社	6,695	
西日本シティTT証券株式会社	3,000	
百五証券株式会社	3,000	
ほくほくTT証券株式会社	1,250	
松井証券株式会社	11,944	
マネックス証券株式会社	12,200	
むさし証券株式会社	5,000	
楽天証券株式会社	7,495	
ワイエム証券株式会社	1,270	
株式会社愛知銀行	18,000	銀行法に基づき銀行業を 営んでいます。
株式会社イオン銀行	51,250	
株式会社大垣共立銀行	46,773	
株式会社沖縄銀行	22,725	
株式会社香川銀行	12,014	
株式会社関西アーバン銀行	47,039	
株式会社北九州銀行	10,000	
株式会社高知銀行	19,544	

株式会社きらやか銀行	22,700	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679	
株式会社静岡銀行	90,845	
株式会社静岡中央銀行	2,000	
株式会社島根銀行	6,636	
株式会社清水銀行	8,670	
信金中央金庫	690,998	(注1)
スルガ銀行株式会社	30,043	(注2)
全国信用協同組合連合会	62,275	(注3)
株式会社大東銀行	14,743	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社大正銀行	2,689	
株式会社但馬銀行	5,481	
株式会社中京銀行	31,844	
株式会社筑波銀行	48,868	
株式会社徳島銀行	11,036	
株式会社鳥取銀行	9,061	
株式会社トマト銀行	17,810	
株式会社富山第一銀行	10,182	
株式会社長野銀行	13,017	
株式会社名古屋銀行	25,090	
株式会社西日本シティ銀行	85,745	
株式会社百五銀行	20,000	
株式会社福井銀行	17,965	
株式会社福島銀行	18,127	
株式会社豊和銀行	12,495	
株式会社みちのく銀行	36,986	
株式会社武蔵野銀行	45,743	
株式会社もみじ銀行	10,000	
株式会社山口銀行	10,005	

(注1) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注2) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注3) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

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ないます。

3 【資本関係】

委託会社は、むさし証券株式会社の株式を41,500株所有しております。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2018年3月末日現在）

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

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

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

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

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

委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

「iFreeのポイント」を記載することがあります。

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成30年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年10月5日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているiFree 8資産バランスの平成29年9月8日から平成30年9月7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、iFree 8資産バランスの平成30年9月7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。