

iFree 8資産バランス

追加型投信／内外／資産複合

※課税上は株式投資信託として取扱われます。

投資信託説明書(請求目論見書)

2017年12月1日

本文書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

本文書にかかる「iFree 8資産バランス」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を平成29年11月30日に関東財務局長に提出しており、平成29年12月1日にその届出の効力が生じております。

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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当ありません。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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。

- ・お電話によるお問い合わせ先（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

① 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。

- ・お電話によるお問い合わせ先（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）

② 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。）が課されません。

③ 「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

平成 29 年 12 月 1 日から平成 30 年 11 月 30 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します。

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

(10) 払込取扱場所

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

(11) 振替機関に関する事項

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) その他

- ① 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します。
- ② 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。
- ③ 委託会社の各営業日（※）の午後 3 時までには受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日（※）の取扱いとなります。
（※）前②の申込受付中止日を除きます。
- ④ 金融商品取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」とい

うことがあります。以下同じ。)等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情(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。

- ⑤ 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。
- ⑥ 「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)。
- ⑦ 取得申込金額に利息は付きません。
- ⑧ 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、為替のヘッジを行な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	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()
債券	年6回 (隔月)	欧州		
一般	年12回 (毎月)	アジア		
公債	日々	オセアニア		
社債	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他債券 クレジット属性 ()		アフリカ		
不動産投信		中近東 (中東)		
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))		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

<信託金の限度額>

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、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>

1 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。

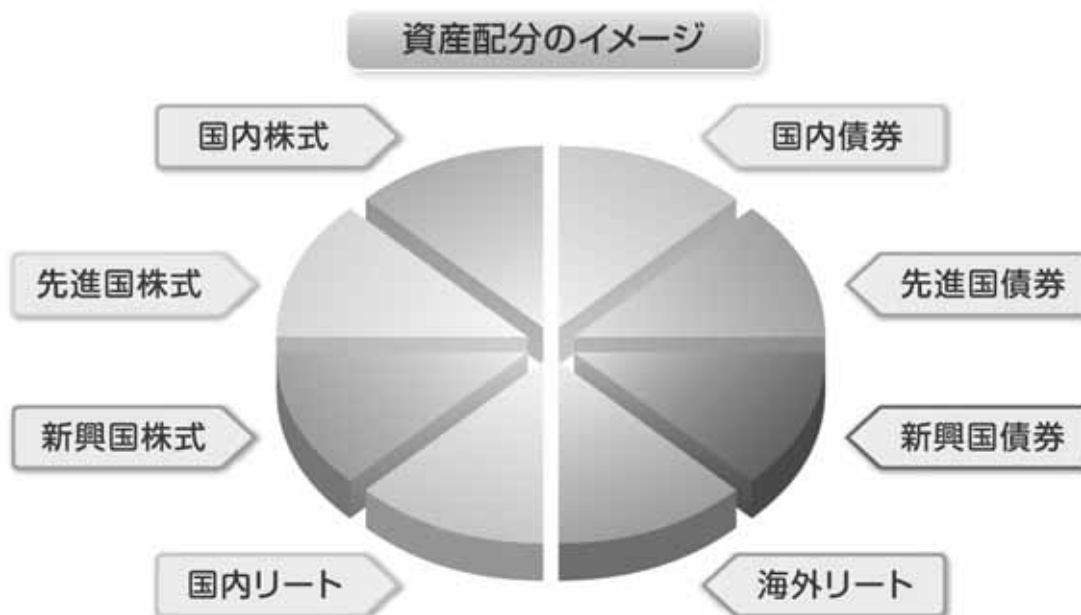
- 次の8つの資産クラスに投資します。



※各資産クラスにおける投資にあたっては、投資成果を特定の指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。

※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。

- 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。
- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。
- 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。



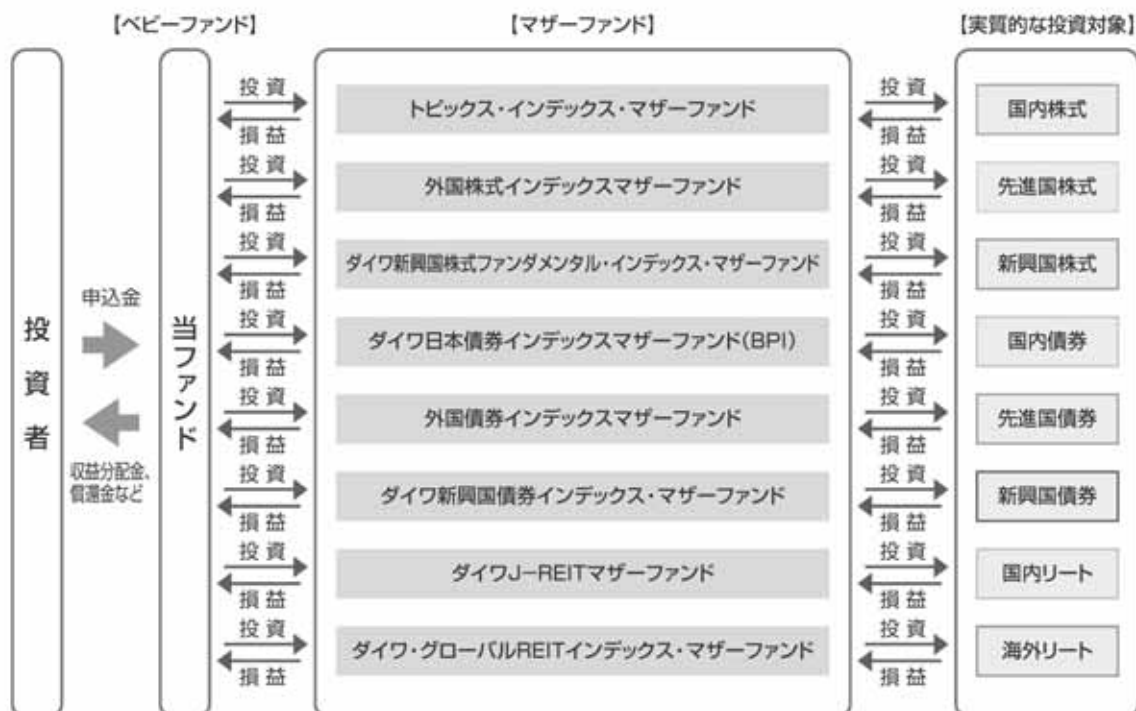
2 各資産クラスにおける投資にあたっては、投資成果を特定の指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資産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。



※マザーファンドについて、くわしくは、「マザーファンドの概要」をご参照下さい。

・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時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1および2の運用が行なわれないことがあります。

3 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。

[マザーファンドの概要]

資産クラス	マザーファンド	特定の指数
国内株式	トピックス・インデックス・マザーファンド	東証株価指数（TOPIX）
先進国株式	外国株式インデックスマザーファンド	MSCIコクサイ指数（円ベース）
新興国株式	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	FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）
国内債券	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	NOMURA-BPI総合指数
先進国債券	外国債券インデックスマザーファンド	シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
新興国債券	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	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（円換算）
国内リート	ダイワJ-REITマザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
海外リート	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

●特定の指数について

◆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ーした新興国の上場株式の中から、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・アフィリエイト社 (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。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International LimitedとResearch Affiliates LLCに帰属します。また、FTSE International Limited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総合指数

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

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

◆シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

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

同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。

◆JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・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「㈱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㈱東京証券取引所が有します。

㈱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、㈱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。

iFree 8資産バランスは、㈱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。

(2) ファンドの沿革

平成 28 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	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、次の業務を行います。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③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
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金(※3)	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
↓運用指図 ↑↓※2	損益↑↓信託金(※3)	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
	損益↑↓投資	
投資対象	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す。）	

(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（平成29年9月末日現在）>

- ・資本金の額 151億7,427万2,500円
- ・沿革
 - 昭和34年12月12日 設立登記
 - 昭和35年 2月17日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
 - 昭和35年 4月 1日 営業開始
 - 昭和60年11月 8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
 - 平成 7年 5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
 - 平成 7年 9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
 - 平成19年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第 29 条の登録を受けたものとみなされる。
(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第 352 号)
- ・大株主の状況

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

2 投資方針

(1) 投資方針

① 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、それぞれかつ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（シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））
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））

② 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

- ① 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
- ② 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。)

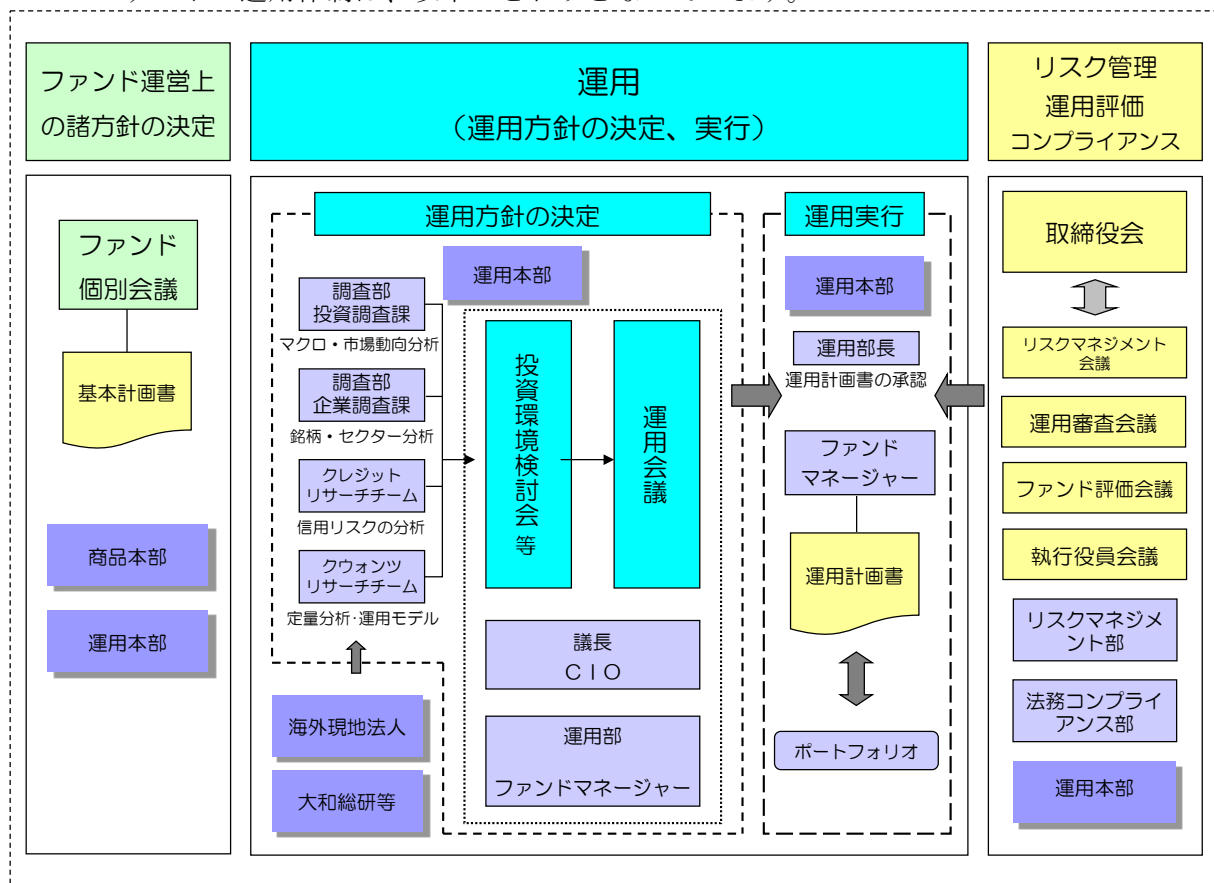
③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みません。）により運用することを指図することができます。

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

① 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。



② 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。

③ 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。

④ ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ. ファンド評価会議

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

ロ. 運用審査会議

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

ハ. リスクマネジメント会議

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

ニ. 執行役員会議

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

⑤ 受託会社に対する管理体制

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

※ 上記の運用体制は平成29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

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。

- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 投資制限

- ① 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

- ② 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。

- ③ 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。

- ④ 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。

- ⑤ 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。

- ⑥ 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

① 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。

② 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

① 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。

② 委託会社は、信託金を、前①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せん。）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

① 株式

株式への投資には、制限を設けません。

② 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。

③ 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合計額が、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。

2. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 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。

② 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

- ① 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

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。

- ② 委託会社は、信託金を、前①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せん。）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

- ① 株式
株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 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。
- ③ 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

① 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す。）

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）

② 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

① 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)④、⑤および⑥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

② 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. 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せん。）
 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せん。）
 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。
- ③ 委託会社は、信託金を、前②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せん。）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

- ① 株式
 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 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。
- ③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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)③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。
- 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

① 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。

② 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

① 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)④、⑤および⑥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

② 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書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定め

- るものをいいます。)
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの
- ③ 委託会社は、信託金を、前②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せん。）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

① 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ません。

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。

② 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。

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 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。

⑤ 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。
- ⑥ 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

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

(2) 投資対象

① 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せん。）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
- ② 委託会社は、信託金を、前①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

① 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。

② 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。

③ 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。

- ④ 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

① 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。

② 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。

ハ. 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ. 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

① 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、後掲(3)④、⑤および⑥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

② 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。)

③ 委託会社は、信託金を、前②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。)

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

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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)③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。

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ます。

7. ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資方針

① 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号ロ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。

② 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

① 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)⑤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

② 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。

③ 委託会社は、信託金を、前②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

- ① 株式
株式への直接投資は、行ないません。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 外貨建資産
外貨建資産への直接投資は、行ないません。
- ⑤ 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。

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

- ① 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号ロ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。
- ② 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

- ① 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)⑤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
- ② 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。）
- ③ 委託会社は、信託金を、前②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

- ① 株式への直接投資は、行ないません。
- ② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ③ 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。
- ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ⑤ 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。

① 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。

② 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。

③ 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．リー子の価格や配当は、リー子の収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リー子の収益は、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、リー子の収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リー子の資産価値は、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子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、リー子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、リー子の価格や配当に影響を与えることが想定されます。

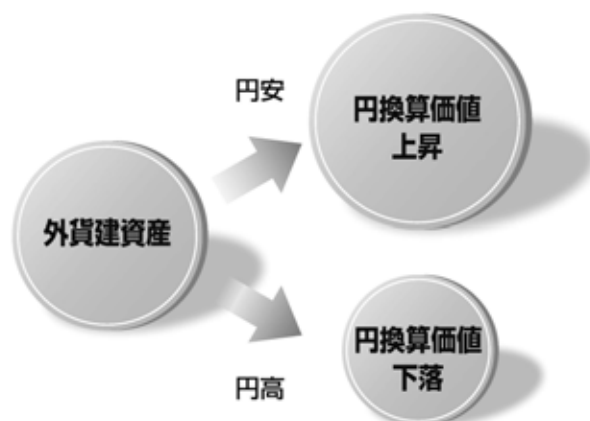
- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リー子の価格や配当に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

ニ．組入リー子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。

④ 外国証券への投資に伴うリスク

イ. 為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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。

⑤ 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。

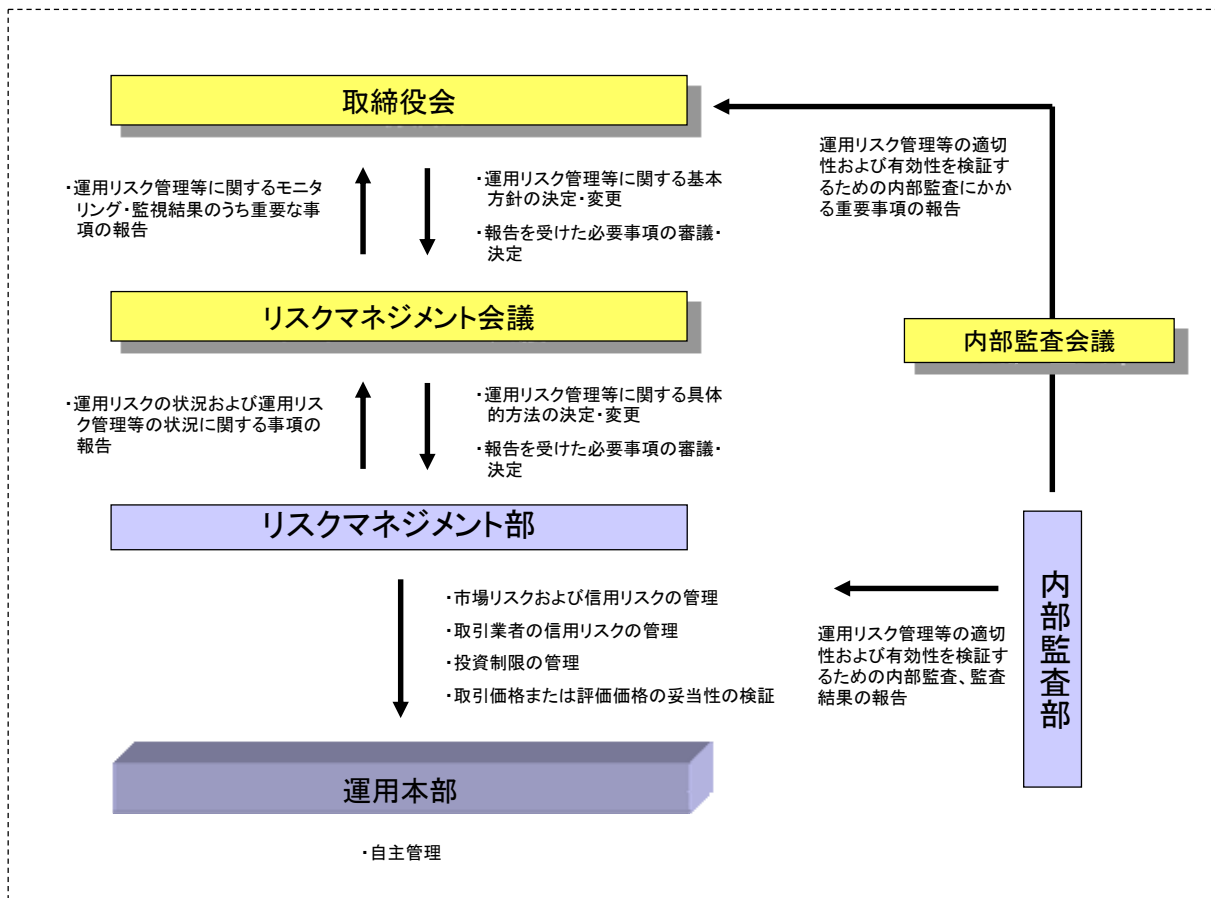
- ① 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。
- ② ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、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。

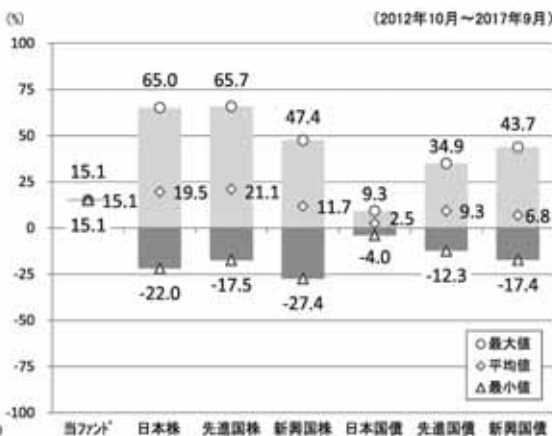
参考情報

- 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年間に於ける年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 手数料等及び税金

(1) 申込手数料

- ① 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）

- ② 申込手数料には、消費税等が課されます。
- ③ 「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

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3) 信託報酬等

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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。

- ④ 前③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

- ① 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。
- ② 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。

- ③ 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。
- ④ 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。

① 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、平成 49 年 12 月 31 日まで基準所得税額に 2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は 20.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%および地方税 5%）となります。

ロ. 解約金および償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：N I S A（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「N I S A（ニーサ）」の適用対象です。満 20 歳以上の方を対象とした N I S A 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平成30年1月以降「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。

平成30年1月以降「つみたてNISA」をご利用の場合、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。

② 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、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は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。

③ 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②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

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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

- ① 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。
- ② 投資者が収益分配金を受取る際、イ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- (※) 上記は、平成 29 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（平成 29 年 9 月 29 日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	4,704,162,651	98.97
内 日本	4,704,162,651	98.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	49,029,755	1.03
純資産総額	4,753,192,406	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成 29 年 9 月 29 日現在）

① 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	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	255,978,243	2.2070 564,959,782	2.3190 593,613,545	12.49
2	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	570,629,338	0.9858 562,549,376	1.0401 593,511,574	12.49
3	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	266,297,543	2.1683 577,425,381	2.2181 590,674,580	12.43
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	209,420,340	2.7580 577,598,186	2.8050 587,424,053	12.36
5	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	251,565,097	2.3537 592,119,965	2.3293 585,970,580	12.33
6	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	462,087,004	1.2701 586,901,606	1.2653 584,678,686	12.30
7	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	378,373,016	1.5360 581,200,947	1.5440 584,207,936	12.29
8	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	413,245,859	1.3969 577,263,213	1.4134 584,081,697	12.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.97%
合計	98.97%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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

① 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)
平成 28 年 9 月末日	97,064,972	—	0.9898	—
10 月末日	267,082,522	—	1.0036	—
11 月末日	496,903,641	—	1.0398	—
12 月末日	1,031,427,820	—	1.0809	—
平成 29 年 1 月末日	1,426,756,827	—	1.0779	—
2 月末日	1,803,026,674	—	1.0894	—
3 月末日	2,316,763,967	—	1.0843	—
4 月末日	2,819,174,652	—	1.0867	—
5 月末日	3,139,740,680	—	1.0957	—
6 月末日	3,537,618,121	—	1.1063	—
7 月末日	3,978,924,085	—	1.1154	—
8 月末日	4,394,352,645	—	1.1228	—
第 1 計算期間末 (平成 29 年 9 月 7 日)	4,423,564,263	4,423,564,263	1.1184	1.1184
9 月末日	4,753,192,406	—	1.1393	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第 1 計算期間	0.0000

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第 1 計算期間	11.8

(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

(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 (平成 29 年 9 月 29 日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	135,815,173,500	98.74
内 日本	135,815,173,500	98.74
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,736,078,188	1.26
純資産総額	137,551,251,688	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)	1,691,750,000	1.23
内 日本	1,691,750,000	1.23

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

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

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

(2) 投資資産 (平成 29 年 9 月 29 日現在)

① 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	676,300	6,729.00 4,550,822,700	6,710.00 4,537,973,000	3.30
2	三菱 UFJ フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,127,700	708.90 2,926,126,530	730.70 3,016,110,390	2.19
3	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	441,800	5,135.00 2,268,643,000	5,157.00 2,278,362,600	1.66
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	247,900	8,904.00 2,207,301,600	9,084.00 2,251,923,600	1.64
5	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	440,400	4,288.00 1,888,435,200	4,320.00 1,902,528,000	1.38
6	本田技研	日本	株式	輸送用機器	499,500	3,294.00 1,645,353,000	3,332.00 1,664,334,000	1.21
7	ソニー	日本	株式	電気機器	393,900	4,294.00 1,691,406,600	4,186.00 1,648,865,400	1.20
8	KDDI	日本	株式	情報・通信業	535,800	2,981.00 1,597,219,800	2,967.00 1,589,718,600	1.16

	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 (%)
9	キーエンス	日本	株式	電気機器	25,400	60,000.00 1,524,000,000	59,750.00 1,517,650,000	1.10
10	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,455,000	195.80 1,459,689,000	197.10 1,469,380,500	1.07
11	任 天 堂	日本	株式	その他製 品	34,400	40,950.00 1,408,680,000	41,560.00 1,429,664,000	1.04
12	武田薬品	日本	株式	医薬品	219,000	6,191.00 1,355,829,000	6,214.00 1,360,866,000	0.99
13	ファナック	日本	株式	電気機器	56,300	22,755.00 1,281,106,500	22,790.00 1,283,077,000	0.93
14	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	345,500	3,720.00 1,285,260,000	3,688.00 1,274,204,000	0.93
15	キャノン	日本	株式	電気機器	298,000	3,837.00 1,143,426,000	3,845.00 1,145,810,000	0.83
16	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	106,600	10,195.00 1,086,787,000	10,385.00 1,107,041,000	0.80
17	三菱商事	日本	株式	卸売業	412,900	2,620.50 1,082,004,450	2,615.50 1,079,939,950	0.79
18	日 立	日本	株式	電気機器	1,334,000	793.10 1,057,995,400	792.90 1,057,728,600	0.77
19	信越化学	日本	株式	化学	104,500	10,160.00 1,061,720,000	10,060.00 1,051,270,000	0.76
20	三菱電機	日本	株式	電気機器	592,700	1,755.00 1,040,188,500	1,758.00 1,041,966,600	0.76
21	パナソニック	日本	株式	電気機器	639,000	1,651.50 1,055,308,500	1,630.50 1,041,889,500	0.76
22	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信 業	402,600	2,583.50 1,040,117,100	2,570.50 1,034,883,300	0.75
23	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	196,900	5,025.00 989,422,500	5,106.00 1,005,371,400	0.73
24	日本電産	日本	株式	電気機器	72,400	13,740.00 994,776,000	13,820.00 1,000,568,000	0.73
25	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	229,900	4,407.00 1,013,169,300	4,345.00 998,915,500	0.73
26	東京海上HD	日本	株式	保険業	221,100	4,525.00 1,000,477,500	4,402.00 973,282,200	0.71
27	村田製作所	日本	株式	電気機器	58,500	17,205.00 1,006,492,500	16,540.00 967,590,000	0.70
28	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	384,500	2,460.00 945,870,000	2,437.00 937,026,500	0.68
29	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	46,200	19,435.00 897,897,000	19,730.00 911,526,000	0.66
30	花 王	日本	株式	化学	137,200	6,844.00 938,996,800	6,620.00 908,264,000	0.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.74%
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	0.11%
鉱業	0.33%
建設業	3.21%
食料品	4.37%
繊維製品	0.74%
パルプ・紙	0.25%
化学	7.03%
医薬品	4.45%
石油・石炭製品	0.57%
ゴム製品	0.99%
ガラス・土石製品	0.97%
鉄鋼	1.20%
非鉄金属	1.00%
金属製品	0.67%
機械	5.32%
電気機器	13.28%
輸送用機器	8.81%
精密機器	1.55%
その他製品	2.16%
電気・ガス業	1.63%
陸運業	3.95%
海運業	0.21%
空運業	0.59%
倉庫・運輸関連業	0.21%
情報・通信業	7.68%
卸売業	4.45%
小売業	4.53%
銀行業	7.51%
証券、商品先物取引業	1.03%
保険業	2.31%
その他金融業	1.26%
不動産業	2.28%
サービス業	4.08%
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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX 先物 2017 年 12 月	買建	101	1,677,846,980	1,691,750,000	1.23%

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

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

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況（平成 29 年 9 月 29 日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	232,080,181,450	98.21
内 日本	232,080,181,450	98.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,239,602,643	1.79
純資産総額	236,319,784,093	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)	3,560,940,000	1.51
内 日本	3,560,940,000	1.51

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

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

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

(2) 投資資産（平成 29 年 9 月 29 日現在）

① 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	30,218	577,000.00 17,435,786,000	561,000.00 16,952,298,000	7.17
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	29,495	564,000.00 16,635,180,000	541,000.00 15,956,795,000	6.75
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	89,523	143,900.00 12,882,359,700	146,300.00 13,097,214,900	5.54
4	日本リテールファンド	日本	投資証券	60,031	204,800.00 12,294,348,800	201,900.00 12,120,258,900	5.13
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	68,823	166,700.00 11,472,794,100	164,800.00 11,342,030,400	4.80
6	オリックス不動産投資	日本	投資証券	60,204	159,100.00 9,578,456,400	161,500.00 9,722,946,000	4.11
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	39,248	243,700.00 9,564,737,600	237,100.00 9,305,700,800	3.94
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	32,094	277,100.00 8,893,247,400	269,400.00 8,646,123,600	3.66

	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 (%)
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	28,891	280,000.00 8,089,480,000	276,800.00 7,997,028,800	3.38
10	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	19,701	387,500.00 7,634,137,500	376,000.00 7,407,576,000	3.13
11	GLP投資法人	日本	投資証券	54,632	117,000.00 6,391,944,000	117,300.00 6,408,333,600	2.71
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	90,065	72,100.00 6,493,686,500	71,100.00 6,403,621,500	2.71
13	API投資法人	日本	投資証券	13,487	485,000.00 6,541,195,000	467,000.00 6,298,429,000	2.67
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	9,121	626,000.00 5,709,746,000	619,000.00 5,645,899,000	2.39
15	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	10,615	467,500.00 4,962,512,500	456,500.00 4,845,747,500	2.05
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	10,369	443,500.00 4,598,651,500	437,000.00 4,531,253,000	1.92
17	森ヒルズリート	日本	投資証券	33,522	138,700.00 4,649,501,400	134,900.00 4,522,117,800	1.91
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	20,694	212,730.41 4,402,243,200	209,500.00 4,335,393,000	1.83
19	産業ファンド	日本	投資証券	8,477	487,000.00 4,128,299,000	477,000.00 4,043,529,000	1.71
20	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	6,729	559,000.00 3,761,511,000	563,000.00 3,788,427,000	1.60
21	森トラスト総合リート	日本	投資証券	22,302	175,300.00 3,909,540,600	168,400.00 3,755,656,800	1.59
22	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	27,943	133,000.00 3,716,419,000	133,700.00 3,735,979,100	1.58
23	イオンリート投資	日本	投資証券	29,508	112,965.06 3,333,373,200	113,900.00 3,360,961,200	1.42
24	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	20,010	167,700.00 3,355,677,000	166,000.00 3,321,660,000	1.41
25	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	69,989	45,600.00 3,191,498,400	46,450.00 3,250,989,050	1.38
26	プレミア投資法人	日本	投資証券	28,185	107,700.00 3,035,524,500	106,800.00 3,010,158,000	1.27
27	東急リアル・エステート	日本	投資証券	20,922	136,000.00 2,845,392,000	137,100.00 2,868,406,200	1.21
28	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	35,099	81,200.00 2,850,038,800	79,400.00 2,786,860,600	1.18
29	日本リート投資法人	日本	投資証券	8,384	310,000.00 2,599,040,000	323,500.00 2,712,224,000	1.15
30	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	11,380	237,200.00 2,699,336,000	237,900.00 2,707,302,000	1.15

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.21%
合計	98.21%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2017 年12月	買建	2,168	3,590,208,000	3,560,940,000	1.51%

(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（平成 29 年 9 月 29 日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		11,651,561,180	77.45
	内 日本	11,651,561,180	77.45
地方債証券		1,130,263,500	7.51
	内 日本	1,130,263,500	7.51
特殊債券		1,022,350,300	6.80
	内 日本	1,022,350,300	6.80
社債券		1,124,911,100	7.48
	内 日本	1,124,911,100	7.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		115,784,230	0.77
純資産総額		15,044,870,310	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成 29 年 9 月 29 日現在）

① 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	334 10年国債	日本	国債証券	156,000,000	104.84 163,558,200	104.30 162,718,920	0.600000 2024/06/20	1.08
2	338 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	103.51 157,343,560	103.17 156,827,520	0.400000 2025/03/20	1.04
3	116 5年国債	日本	国債証券	155,000,000	100.77 156,195,050	100.41 155,640,150	0.200000 2018/12/20	1.03
4	343 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	100.90 153,377,120	100.69 153,056,400	0.100000 2026/06/20	1.02
5	345 10年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.38 150,570,860	100.64 150,964,500	0.100000 2026/12/20	1.00
6	125 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.85 151,275,440	100.60 150,913,500	0.100000 2020/09/20	1.00
7	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	106.05 148,479,290	105.01 147,015,400	1.100000 2021/12/20	0.98
8	322 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	105.24 147,343,900	104.38 146,140,400	0.900000 2022/03/20	0.97

	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 (%)
9	335 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	104.12 145,771,790	103.73 145,229,000	0.500000 2024/09/20	0.97
10	346 10年国債	日本	国債証券	143,000,000	100.67 143,969,200	100.56 143,807,950	0.100000 2027/03/20	0.96
11	325 10年国債	日本	国債証券	137,000,000	105.14 144,053,860	104.36 142,973,200	0.800000 2022/09/20	0.95
12	130 5年国債	日本	国債証券	127,000,000	101.12 128,434,060	100.80 128,019,810	0.100000 2021/12/20	0.85
13	373 2年国債	日本	国債証券	125,000,000	100.80 126,000,000	100.32 125,402,500	0.100000 2019/02/15	0.83
14	126 5年国債	日本	国債証券	124,000,000	100.87 125,083,760	100.64 124,798,560	0.100000 2020/12/20	0.83
15	32東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	115.23 115,239,000	113.33 113,335,100	2.260000 2024/03/19	0.75
16	129 5年国債	日本	国債証券	110,000,000	100.98 111,080,800	100.77 110,852,500	0.100000 2021/09/20	0.74
17	128 5年国債	日本	国債証券	107,000,000	100.93 108,000,620	100.74 107,797,150	0.100000 2021/06/20	0.72
18	309 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	104.36 107,495,950	103.30 106,404,150	1.100000 2020/06/20	0.71
19	347 10年国債	日本	国債証券	105,000,000	100.72 105,756,400	100.48 105,507,150	0.100000 2027/06/20	0.70
20	33 中日本高速道	日本	社債券	100,000,000	104.94 104,942,400	103.94 103,941,600	1.084000 2021/09/17	0.69
21	308 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	105.07 105,078,000	103.84 103,849,000	1.300000 2020/06/20	0.69
22	116 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	104.58 104,582,400	103.72 103,729,100	0.800000 2022/11/25	0.69
23	25-6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.34 104,348,000	103.67 103,676,400	0.694000 2023/11/22	0.69
24	36 地方公共団体	日本	特殊債券	100,000,000	104.47 104,477,000	103.64 103,642,800	0.892000 2022/05/27	0.69
25	24-16 愛知県公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.45 104,453,400	103.60 103,608,400	0.757000 2023/01/31	0.69
26	117 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	104.14 104,149,400	103.36 103,369,900	0.720000 2022/12/22	0.69
27	21-6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.76 104,769,800	103.32 103,326,300	1.570000 2019/11/25	0.69
28	70東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	104.02 104,025,400	103.30 103,303,100	1.193000 2020/09/29	0.69
29	21-35 兵庫県公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.64 104,644,900	103.28 103,286,900	1.460000 2020/01/22	0.69
30	305 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	104.40 104,409,000	103.16 103,163,000	1.300000 2019/12/20	0.69

(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	77.45%
地方債証券	7.51%
特殊債券	6.80%
社債券	7.48%
合計	99.23%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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 (平成 29 年 9 月 29 日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	3,629,127,706	93.36
内 中国	1,037,734,900	26.70
内 台湾	483,048,873	12.43
内 タイ	137,764,390	3.54
内 マレーシア	95,445,039	2.46
内 インドネシア	75,105,085	1.93
内 インド	272,318,610	7.01
内 ポーランド	84,997,717	2.19
内 ロシア	334,757,570	8.61
内 トルコ	83,367,862	2.14
内 メキシコ	180,244,694	4.64
内 チリ	38,190,343	0.98
内 ブラジル	517,328,506	13.31
内 南アフリカ	288,824,117	7.43
投資証券	179,972,438	4.63
内 アメリカ	166,738,943	4.29
内 メキシコ	4,654,116	0.12
内 南アフリカ	8,579,379	0.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	78,088,980	2.01
純資産総額	3,887,189,124	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)	81,268	0.00
内 日本	81,268	0.00
為替予約取引(売建)	81,235	△0.00
内 日本	81,235	△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) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（平成 29 年 9 月 29 日現在）

① 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	POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT	アメリカ	投資証券	—	70,000	2,391.56 167,411,572	2,381.98 166,738,943	4.29
2	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	1,459,000	87.83 128,172,749	93.21 136,004,770	3.50
3	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	1,251,000	72.98 91,309,724	82.82 103,618,078	2.67
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	128,000	773.77 99,043,726	793.94 101,624,320	2.61
5	GAZPROM PAO -SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	183,740	457.45 84,063,675	468.95 86,166,122	2.22
6	CHINA MOBILE LTD	中国	株式	電気通信 サービス	64,500	1,188.88 76,683,773	1,146.46 73,946,896	1.90
7	LUKOIL PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	12,000	5,613.05 67,356,803	5,963.41 71,561,004	1.84
8	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	1,277,000	55.75 71,217,479	55.55 70,944,374	1.83
9	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	168,128	419.97 70,609,488	387.69 65,182,385	1.68
10	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	41,924	1,329.49 55,738,252	1,521.06 63,769,012	1.64
11	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	ロシア	株式	金融	36,610	1,235.52 45,235,305	1,593.43 58,335,785	1.50
12	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	メキシコ	株式	電気通信 サービス	572,200	92.39 52,868,594	100.29 57,386,796	1.48
13	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	97,200	448.32 43,577,787	542.88 52,768,189	1.36
14	CNOOC LTD	中国	株式	エネルギー	349,000	125.52 43,811,409	142.42 49,706,011	1.28
15	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	35,860	1,257.56 45,096,365	1,360.55 48,789,628	1.26
16	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	39,740	1,026.59 40,796,859	1,223.07 48,605,136	1.25
17	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	84,200	478.18 40,264,946	563.05 47,409,223	1.22
18	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	565,800	87.79 49,679,949	83.11 47,027,485	1.21
19	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	28,900	1,277.56 36,921,608	1,399.32 40,440,348	1.04

	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 (%)
20	MTN GROUP LTD	南アフリカ	株式	電気通信 サービス	39,190	972.35 38,106,796	1,028.67 40,313,644	1.04
21	SASOL LTD	南アフリカ	株式	素材	11,770	3,131.12 36,853,387	3,094.59 36,423,383	0.94
22	VALE SA-PREF	ブラジル	株式	素材	35,100	981.47 34,449,634	1,035.51 36,346,450	0.94
23	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	40,000	767.77 30,711,573	857.14 34,285,680	0.88
24	CHINA EVERGRANDE GROUP	中国	株式	不動産	86,000	242.59 20,864,269	384.55 33,072,117	0.85
25	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	25,800	995.30 25,679,805	1,222.01 31,528,031	0.81
26	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	386,000	70.79 27,328,923	70.85 27,348,602	0.70
27	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	1,130	21,241.50 24,002,902	23,865.45 26,967,959	0.69
28	VALE SA	ブラジル	株式	素材	23,500	1,059.85 24,907,096	1,123.63 26,405,364	0.68
29	AMBEV SA	ブラジル	株式	生活必需 品	34,900	656.48 22,912,153	745.31 26,011,438	0.67
30	STANDARD BANK GROUP LTD	南アフリカ	株式	金融	19,080	1,237.47 23,611,027	1,309.89 24,992,749	0.64

(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	93.36%
投資証券	4.63%
合計	97.99%

(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

業種	投資比率
エネルギー	17.76%
素材	8.95%
資本財・サービス	2.78%
一般消費財・サービス	3.65%
生活必需品	5.09%
ヘルスケア	0.40%
金融	30.02%
情報技術	10.16%
電気通信サービス	8.63%
公益事業	3.01%
不動産	2.71%
その他	0.20%
合計	93.36%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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	米ドル買/円売 2017年10月	買建	721	81,235	81,268	0.00%
		タイ・パーツ売/円買 2017年10月	売建	24,035	81,235	81,235	△0.00%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (平成 29 年 9 月 29 日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	88,580,192,817	96.30
内 香港	1,242,827,819	1.35
内 シンガポール	444,416,621	0.48
内 イスラエル	183,200,557	0.20
内 ノルウェー	264,160,620	0.29
内 スウェーデン	1,109,720,858	1.21
内 デンマーク	705,948,424	0.77
内 イギリス	6,643,634,969	7.22
内 アイルランド	164,216,150	0.18
内 オランダ	1,385,417,935	1.51
内 ベルギー	444,131,759	0.48
内 フランス	3,929,061,336	4.27
内 ドイツ	3,661,962,996	3.98
内 スイス	3,109,279,305	3.38
内 ポルトガル	57,494,258	0.06
内 スペイン	1,302,540,376	1.42
内 イタリア	931,231,578	1.01
内 フィンランド	378,653,122	0.41
内 オーストリア	95,028,502	0.10
内 カナダ	3,672,980,204	3.99
内 アメリカ	56,510,329,755	61.44
内 オーストラリア	2,284,354,763	2.48
内 ニューージーランド	59,600,910	0.06
投資証券	2,411,186,639	2.62
内 香港	65,810,252	0.07
内 シンガポール	37,708,438	0.04
内 イギリス	86,731,363	0.09
内 フランス	124,089,472	0.13
内 カナダ	16,967,918	0.02
内 アメリカ	1,772,401,133	1.93
内 オーストラリア	307,478,063	0.33

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	991,692,488	1.08
純資産総額	91,983,071,944	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)	1,074,254,899	1.17
内 アメリカ	1,074,254,899	1.17
為替予約取引(買建)	112,480,000	0.12
内 日本	112,480,000	0.12

(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 (平成 29 年 9 月 29 日現在)

① 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	119,400	12,606.59 1,505,239,951	17,279.25 2,063,142,975	2.24
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	167,550	6,904.48 1,156,859,474	8,327.36 1,395,250,023	1.52
3	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	54,250	13,820.24 749,750,050	19,020.93 1,031,885,610	1.12
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	9,320	86,815.96 809,124,932	107,814.97 1,004,835,539	1.09
5	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	61,950	12,705.23 787,091,175	14,595.15 904,169,735	0.98
6	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	97,005	9,638.07 934,944,247	9,265.27 898,778,360	0.98
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	81,470	8,916.26 726,410,882	10,752.18 875,980,707	0.95
8	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,147	87,484.11 625,249,742	107,037.13 764,994,404	0.83
9	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,810	89,534.78 609,732,658	108,763.03 740,676,243	0.81
10	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	72,550	7,961.51 577,607,946	9,413.14 682,923,815	0.74

	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 (%)
11	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	108,472	5,851.13 634,686,011	6,115.60 663,371,634	0.72
12	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	228,401	2,291.01 523,293,739	2,868.97 655,277,558	0.71
13	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信 サービス	141,691	4,450.46 630,594,449	4,400.97 623,579,144	0.68
14	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	58,917	9,374.06 552,297,991	10,246.02 603,665,332	0.66
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	28,750	17,876.04 513,937,299	20,653.26 593,781,320	0.65
16	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	43,668	12,328.15 538,348,081	13,259.30 579,007,226	0.63
17	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	137,563	3,607.02 496,198,248	4,013.18 552,066,181	0.60
18	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サ ービス	199,900	3,491.81 698,019,869	2,732.57 546,241,782	0.59
19	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信 サービス	93,904	5,736.15 538,655,960	5,569.98 523,044,275	0.57
20	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	469,400	963.62 452,387,190	1,107.72 519,966,425	0.57
21	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	62,823	6,258.76 393,194,683	8,189.83 514,509,973	0.56
22	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	42,550	8,922.57 379,655,758	11,789.30 501,634,860	0.55
23	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	27,400	14,633.14 400,950,815	18,302.84 501,497,893	0.55
24	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	52,050	8,168.70 425,181,468	9,587.35 499,021,932	0.54
25	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	22,176	17,850.45 395,852,476	22,106.35 490,230,484	0.53
26	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	93,450	4,639.62 433,576,884	5,062.70 473,109,717	0.51
27	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	16,400	26,348.68 432,120,148	28,686.58 470,459,912	0.51
28	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	108,540	3,955.24 429,308,509	4,263.44 462,754,711	0.50
29	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	108,000	3,982.41 430,107,404	4,264.57 460,574,197	0.50
30	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	62,971	7,011.46 441,525,813	7,247.41 456,376,762	0.50

(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	96.30%
投資証券	2.62%
合計	98.92%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	6.76%
素材	4.94%
資本財・サービス	10.45%
一般消費財・サービス	11.20%
生活必需品	9.15%
ヘルスケア	12.67%
金融	18.46%
情報技術	16.24%
電気通信サービス	2.66%
公益事業	3.20%
不動産	0.57%
合計	96.30%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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 2017年12月	買建	76	1,066,259,749	1,074,254,899	1.17%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2017年11 月	買建	1,000,000	112,518,200	112,480,000	0.12%

(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（平成29年9月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	68,237,273	0.55
内 アメリカ	68,237,273	0.55
投資証券	12,106,142,168	98.26
内 ガーンジー	8,180,045	0.07
内 マン島	6,282,860	0.05
内 香港	229,586,495	1.86
内 シンガポール	398,500,488	3.23
内 イスラエル	4,094,646	0.03
内 イギリス	646,821,848	5.25
内 アイルランド	31,193,217	0.25
内 オランダ	57,598,460	0.47
内 ベルギー	85,577,362	0.69
内 フランス	540,045,985	4.38
内 ドイツ	26,927,694	0.22
内 スペイン	93,079,369	0.76
内 イタリア	12,640,748	0.10
内 カナダ	220,691,866	1.79
内 アメリカ	8,751,811,703	71.03
内 オーストラリア	944,703,520	7.67
内 ニュージーランド	48,405,862	0.39
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	146,292,688	1.19
純資産総額	12,320,672,129	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)	39,448,500	0.32
内 日本	39,448,500	0.32

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

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

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

(2) 投資資産（平成 29 年 9 月 29 日現在）

① 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	29,647	19,837.99 588,138,703	18,216.04 540,050,959	4.38
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	50,646	5,993.06 303,529,446	7,163.99 362,827,514	2.94
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	14,300	24,019.83 343,485,096	23,983.30 342,961,297	2.78
4	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	35,100	7,587.29 266,317,626	7,956.48 279,272,567	2.27
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	13,200	19,732.93 260,474,974	20,133.57 265,763,230	2.16
6	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	35,000	7,060.73 247,129,468	7,422.14 259,775,012	2.11
7	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	9,500	28,604.46 271,743,315	26,995.12 256,453,640	2.08
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	19,478	11,155.30 217,284,956	13,094.71 255,058,894	2.07
9	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	33,879	7,090.04 240,205,175	7,373.66 249,812,542	2.03
10	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	14,700	14,290.44 210,070,465	13,839.86 203,445,973	1.65
11	LINK REIT	香港	投資証券	212,000	791.42 167,783,026	906.20 192,115,248	1.56
12	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	6,267	25,862.06 162,078,202	28,526.32 178,774,488	1.45
13	SCENTRE GROUP	オーストラ リア	投資証券	509,120	375.82 191,339,073	342.37 174,311,946	1.41
14	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	26,117	6,473.63 169,074,647	6,518.04 170,231,875	1.38
15	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	70,500	2,017.19 142,215,101	2,084.37 146,948,628	1.19
16	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	16,464	9,076.34 149,434,103	8,714.02 143,467,773	1.16
17	GGP INC	アメリカ	投資証券	59,677	2,750.95 164,172,524	2,398.89 143,158,821	1.16
18	HCP INC	アメリカ	投資証券	44,700	3,403.99 152,163,451	3,139.53 140,337,013	1.14
19	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	10,828	10,980.46 118,897,125	11,948.25 129,375,680	1.05

	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 (%)
20	WESTFIELD CORP	オーストラ リア	投資証券	182,800	781.89 142,938,319	681.21 124,526,833	1.01
21	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	8,900	12,810.18 114,011,481	13,243.52 117,867,332	0.96
22	GOODMAN GROUP	オーストラ リア	投資証券	152,280	634.06 96,560,057	732.53 111,549,912	0.91
23	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	33,900	2,987.34 101,271,856	3,263.53 110,633,786	0.90
24	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	25,200	3,949.15 99,519,930	4,371.66 110,166,069	0.89
25	UDR INC	アメリカ	投資証券	25,500	4,014.08 102,359,302	4,289.37 109,379,101	0.89
26	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	9,400	11,972.03 112,537,886	11,358.67 106,771,543	0.87
27	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	11,900	8,284.86 98,590,952	8,914.68 106,084,792	0.86
28	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	71,831	1,536.40 110,371,693	1,465.26 105,251,206	0.85
29	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	14,120	7,512.32 106,075,638	7,005.04 98,911,196	0.80
30	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	6,900	15,502.40 106,967,231	14,029.24 96,801,815	0.79

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	0.55%
投資証券	98.26%
合計	98.81%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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	米ドル買/円売 2017年10月	買建	350,000	39,446,365	39,448,500	0.32%

(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（平成 29 年 9 月 29 日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	6,687,827,238	96.89
内 タイ	522,499,236	7.57
内 マレーシア	403,171,440	5.84
内 フィリピン	22,804,327	0.33
内 インドネシア	634,265,577	9.19
内 ポーランド	578,596,438	8.38
内 ロシア	486,269,680	7.04
内 ハンガリー	297,834,934	4.31
内 ルーマニア	202,965,999	2.94
内 トルコ	510,585,552	7.40
内 チェコ	258,995,973	3.75
内 メキシコ	667,199,609	9.67
内 コロンビア	492,265,924	7.13
内 ペルー	183,063,169	2.65
内 チリ	142,341,612	2.06
内 ブラジル	677,771,911	9.82
内 ウルグアイ	9,685,267	0.14
内 アルゼンチン	65,217,230	0.94
内 南アフリカ	532,293,360	7.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	214,542,734	3.11
純資産総額	6,902,369,972	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)	98,760,181	1.43
内 日本	98,760,181	1.43
為替予約取引(売建)	10,908,211	△0.16
内 日本	10,908,211	△0.16

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

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

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

(2) 投資資産（平成 29 年 9 月 29 日現在）

① 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	3,940,000	76.21 106,266,443	79.97 111,507,449	— 2020/07/01	1.62
2	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	2,830,000	99.46 99,613,915	102.81 102,973,026	10.000000 2023/01/01	1.49
3	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	10,450,000	111.32 96,908,985	111.80 97,320,223	10.500000 2026/12/21	1.41
4	Colombian TES	コロンビア	国債証券	1,900,000,000	121.63 88,514,612	120.13 87,425,150	10.000000 2024/07/24	1.27
5	Colombian TES	コロンビア	国債証券	2,105,000,000	104.62 84,350,091	104.20 84,008,409	7.000000 2022/05/04	1.22
6	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	11,350,000	118.74 83,698,386	118.61 83,600,479	10.000000 2024/12/05	1.21
7	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	22,100,000	107.89 80,596,625	108.06 80,723,887	3.650000 2021/12/17	1.17
8	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	19,050,000	122.39 78,810,841	123.33 79,410,953	4.875000 2029/06/22	1.15
9	Colombian TES	コロンビア	国債証券	1,910,000,000	106.33 77,789,027	106.45 77,873,563	7.500000 2026/08/26	1.13
10	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	11,990,000	103.49 77,057,501	103.27 76,897,885	8.000000 2020/06/11	1.11
11	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	2,370,000	88.18 73,962,873	91.65 76,875,828	— 2019/01/01	1.11
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	11,950,000	99.47 73,821,389	99.46 73,815,447	6.500000 2021/06/10	1.07
13	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	1,880,000	100.44 66,826,611	103.52 68,877,829	10.000000 2021/01/01	1.00
14	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	18,300,000	104.45 64,612,069	104.08 64,382,591	3.875000 2019/06/13	0.93
15	Colombian TES	コロンビア	国債証券	1,465,000,000	115.63 64,880,537	114.03 63,986,151	11.000000 2020/07/24	0.93
16	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	8,350,000	89.44 62,211,830	89.69 62,387,805	8.500000 2037/01/31	0.90
17	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	8,320,000	89.92 62,324,066	89.84 62,268,309	8.750000 2048/02/28	0.90
18	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	1,690,000	98.49 58,908,918	102.26 61,163,178	10.000000 2025/01/01	0.89
19	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	2,050,000	80.47 58,386,743	83.90 60,871,206	— 2020/01/01	0.88
20	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	6,324,000,000	109.96 58,415,923	112.04 59,521,159	8.375000 2026/09/15	0.86

	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 (%)
21	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	2,040,000	94.91 59,597,805	94.17 59,133,612	2.500000 2026/07/25	0.86
22	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	9,800,000	96.38 58,659,809	96.63 58,808,302	5.000000 2019/12/11	0.85
23	Indonesia Treasury Bond	インドネシ ア	国債証券	6,350,000,000	108.02 57,621,601	109.80 58,568,920	8.375000 2024/03/15	0.85
24	Indonesia Treasury Bond	インドネシ ア	国債証券	5,820,000,000	113.75 55,611,501	115.93 56,676,347	9.000000 2029/03/15	0.82
25	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	1,720,000	86.23 52,493,151	89.84 54,688,761	— 2019/04/01	0.79
26	Indonesia Treasury Bond	インドネシ ア	国債証券	5,750,000,000	106.40 51,391,935	108.90 52,602,081	8.250000 2036/05/15	0.76
27	Colombian TES	コロンビア	国債証券	1,240,000,000	107.95 51,267,989	109.10 51,817,096	7.750000 2030/09/18	0.75
28	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	7,820,000	104.79 50,890,757	105.91 51,432,711	7.750000 2042/11/13	0.75
29	Indonesia Treasury Bond	インドネシ ア	国債証券	5,710,000,000	105.36 50,539,187	107.00 51,322,439	8.250000 2021/07/15	0.74
30	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	1,650,000	98.48 50,015,037	98.53 50,040,431	2.250000 2022/04/25	0.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	96.89%
合計	96.89%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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	チリ・ペソ買/円売 2017年10月	買建	61,698,028	10,931,438	10,914,381	0.16%
		チェコ・コルナ買/円売 2017年10月	買建	400,000	2,040,480	2,040,000	0.03%
		ハンガリー・フォリント買/円売 2017年10月	買建	24,000,000	10,341,800	10,243,200	0.15%
		メキシコ・ペソ買/円売 2017年10月	買建	3,300,000	20,562,040	20,427,000	0.30%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2017年10月	買建	810,000	24,985,173	24,915,600	0.36%
		ロシア・ルーブル買/円売 2017年10月	買建	7,000,000	13,552,000	13,580,000	0.20%
		南アフリカ・ランド買/円売 2017年10月	買建	2,000,000	16,650,400	16,640,000	0.24%
		米ドル売/円買 2017年10月	売建	96,781	10,931,438	10,908,211	△0.16%

(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（平成29年9月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	164,858,299,120	98.72
内 ユーロ	67,399,372,855	40.36
内 シンガポール	647,951,071	0.39
内 マレーシア	732,752,908	0.44
内 ノルウェー	490,437,915	0.29
内 スウェーデン	793,583,601	0.48
内 デンマーク	1,041,497,697	0.62
内 イギリス	11,605,099,100	6.95
内 スイス	300,815,075	0.18
内 ポーランド	1,049,094,700	0.63
内 カナダ	3,538,486,603	2.12
内 アメリカ	71,313,175,916	42.70
内 メキシコ	1,454,247,655	0.87
内 南アフリカ	874,831,762	0.52
内 オーストラリア	3,616,952,262	2.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,142,374,622	1.28
純資産総額	167,000,673,742	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)	602,620,020	0.36
内 日本	602,620,020	0.36

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

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

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

(2) 投資資産（平成29年9月29日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,143,000	97.75 676,967,606	98.46 681,835,883	2.000000 2025/08/15	0.41
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	99.66 656,131,166	100.15 659,370,215	2.250000 2025/11/15	0.39
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,007,000	167.75 670,132,716	162.98 651,080,412	5.750000 2032/10/25	0.39
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	98.89 645,238,698	99.56 649,623,372	2.125000 2025/05/15	0.39
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	101.03 649,223,681	100.58 646,319,981	2.375000 2027/05/15	0.39
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,029,000	94.15 639,952,871	95.02 645,823,030	1.625000 2026/05/15	0.39
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	98.12 635,269,482	98.85 639,969,667	2.000000 2025/02/15	0.38
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,412,000	102.30 624,151,343	102.46 625,151,898	2.500000 2024/05/15	0.37
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,697,000	128.60 631,633,980	125.53 616,541,050	4.250000 2023/10/25	0.37
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	104.10 613,686,293	104.03 613,273,668	2.750000 2024/02/15	0.37
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	96.44 597,961,968	97.59 605,091,238	2.000000 2026/11/15	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	92.91 586,554,932	93.77 591,977,696	1.500000 2026/08/15	0.35
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,162,000	101.27 589,320,003	101.61 591,321,781	2.375000 2024/08/15	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	104.13 589,405,166	104.13 589,405,166	2.750000 2023/11/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	94.33 570,641,074	95.22 576,030,815	1.625000 2026/02/15	0.34
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,734,000	162.54 590,391,200	156.82 569,610,694	4.500000 2041/04/25	0.34
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	100.23 564,946,395	100.21 564,878,757	2.125000 2024/03/31	0.34
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,630,000	117.09 564,688,224	114.79 553,588,899	3.000000 2022/04/25	0.33
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,709,000	158.93 571,988,605	153.49 552,410,554	4.750000 2035/04/25	0.33

	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 (%)
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,824,000	150.35 564,070,046	145.25 544,954,611	4.000000 2038/10/25	0.33
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,550,000	117.13 552,405,577	114.57 540,332,169	3.250000 2021/10/25	0.32
22	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	2,849,000	144.88 548,359,589	139.85 529,348,054	6.000000 2031/05/01	0.32
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	103.77 527,477,712	103.06 523,863,702	2.625000 2020/11/15	0.31
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	155.02 540,219,172	150.21 523,440,556	5.500000 2029/04/25	0.31
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	126.56 528,977,660	124.96 522,273,805	3.500000 2026/04/25	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	98.00 517,577,249	98.71 521,327,043	1.750000 2023/05/15	0.31
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,280,000	106.86 515,616,603	104.96 506,454,224	3.625000 2020/02/15	0.30
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,380,000	113.54 509,872,481	110.31 495,350,753	3.500000 2020/04/25	0.30
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,230,000	117.95 506,151,392	114.93 493,188,115	3.750000 2021/04/25	0.30
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,350,000	99.69 488,876,698	100.20 491,370,962	2.000000 2023/02/15	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.72%
合計	98.72%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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 2017年11月	買建	202,000	17,823,360	17,822,460	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2017年11月	買建	140,000	12,672,396	12,672,800	0.01%
		ユーロ買/円売 2017年11月	買建	1,919,000	254,455,115	254,958,340	0.15%
		南アフリカ・ランド買/円売 2017年11月	買建	1,000,000	8,251,794	8,250,000	0.00%
		米ドル買/円売 2017年11月	買建	2,304,000	258,785,853	259,153,920	0.16%
		南アフリカ・ランド買/円売 2017年10月	買建	1,000,000	8,325,200	8,320,000	0.00%
		英ポンド買/円売 2017年11月	買建	274,000	41,408,303	41,442,500	0.02%

(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

2017年9月29日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,393円
純資産総額	47億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	1.5%
3か月間	3.0%
6か月間	5.1%
1年間	15.1%
3年間	-
5年間	-
設定来	13.9%



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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

決算期	第1期 17年9月	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
分配金	0円									

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

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

主要な資産の状況

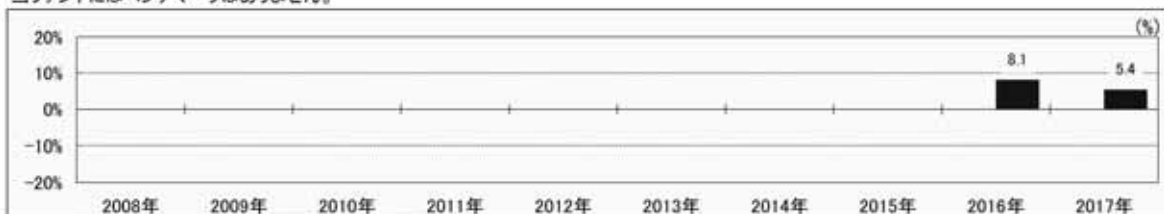
※比率は、純資産総額に対するものです。

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
外国株式INDEXMF	12.5%	外国債券	904	24.1%	日本円	38.3%	日本ビルファンド	日本	0.9%
トピックス・インデックス・MF	12.5%	外国株式・先物	1,605	23.6%	米ドル	24.1%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.8%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	12.4%	外国リート	324	12.6%	ユーロ	7.6%	野村不動産マスターF	日本	0.7%
外国債券INDEXMF	12.4%	国内株式・先物	1,489	12.5%	香港ドル	3.7%	日本リテールファンド	日本	0.6%
ダイワJ-REIT MF	12.3%	国内リート・先物	59	12.3%	ブラジル・リアル	2.9%	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)	12.3%	国内債券	280	12.2%	英ポンド	2.5%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.6%
ダイワ新興国株式F・INDEX・MF	12.3%	外国投資信託等	8	0.6%	南アフリカ・ランド	2.0%	POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT	アメリカ	0.5%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	12.3%				メキシコ・ペソ	1.9%	オリックス不動産投資	日本	0.5%
					豪ドル	1.6%	日本プロロジスリート	日本	0.5%
		コール・ローン、その他		2.6%	その他	15.5%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.5%
合計	99.0%	合計	4,669	-	合計	100.0%	合計		6.2%

※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、2017年は9月29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ないません。

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ないません。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ないません。

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合わせる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。

- ・お電話によるお問い合わせ先（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付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

委託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。委託会社は、委託会社の指定する預金口座等の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)①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

① 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。）
を行いません。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、②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。

② 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②の 1. から 7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前 1. の事項（前 1. の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前 1. の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
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、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前 2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前 2. から前 5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁

的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

7. 前 1. から前 6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前 1. から前 7. までの規定にしたがいます。

③ 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。

④ 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れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

⑤ 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。

⑥ 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、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。

① 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ます。）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ます。）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

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ます。

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。

② 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1期計算期間（平成28年9月8日から平成29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。

独立監査人の監査報告書

平成 29 年 10 月 6 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
業務執行社員

貞廣篤典 

指定有限責任社員 公認会計士
業務執行社員

小林 英之 

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 28 年 9 月 8 日から平成 29 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 29 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

1 財務諸表

iFree 8資産バランス

(1) 貸借対照表

	第1期 平成29年9月7日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		64,311,618
親投資信託受益証券		4,377,862,456
流動資産合計		4,442,174,074
資産合計		4,442,174,074
負債の部		
流動負債		
未払解約金		14,439,691
未払受託者報酬		351,135
未払委託者報酬		3,687,375
その他未払費用		131,610
流動負債合計		18,609,811
負債合計		18,609,811
純資産の部		
元本等		
元本	※1	3,955,280,178
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		468,284,085
(分配準備積立金)		120,280,512
元本等合計		4,423,564,263
純資産合計		4,423,564,263
負債純資産合計		4,442,174,074

(2) 損益及び剰余金計算書

	第1期 自 平成28年9月8日 至 平成29年9月7日 金額(円)
	営業収益
有価証券売買等損益	159,712,456
営業収益合計	159,712,456
営業費用	
支払利息	17,922
受託者報酬	432,057
委託者報酬	4,537,501
その他費用	162,009
営業費用合計	5,149,489
営業利益	154,562,967
経常利益	154,562,967
当期純利益	154,562,967
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	34,297,850
剰余金増加額又は欠損金減少額	419,949,319
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
剰余金減少額又は欠損金増加額	71,930,351
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
分配金 ※1	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	468,284,085

(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 1 期 自 平成 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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 平成 29 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首元本額	10,000,000 円
期中追加設定元本額	5,119,041,794 円
期中一部解約元本額	1,173,761,616 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,955,280,178 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 1 期 自 平成 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 年 9 月 7 日
※1 分配金の計算過程	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。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 1 期 自 平成 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク (価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 1 期 平成 29 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	
	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
合計		148,132,078

(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
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 1 期 自 平成 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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
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)

(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	357,159,953	548,061,947	
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	393,425,900	549,183,213	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	554,289,722	545,975,376	
	外国株式インデックスマザーファンド	246,793,552	544,179,782	
	外国債券インデックスマザーファンド	198,703,402	547,686,186	
	ダイワJ-REITマザーファンド	232,758,606	548,099,965	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	252,712,338	547,324,381	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)	430,917,656	547,351,606	
親投資信託受益証券 合計			4,377,862,456	
合計			4,377,862,456	

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	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		6,648,658,147
株式 ※3※4		129,924,539,150
派生商品評価勘定		2,297,880
未収入金		1,630,080
未収配当金		58,901,912
未収利息		861,013
前払金		7,490,000
その他未収収益 ※5		6,442,091
流動資産合計		136,650,820,273
資産合計		136,650,820,273
負債の部		
流動負債		
未払金		4,212,320
未払解約金		156,082,000
受入担保金		5,341,230,562
流動負債合計		5,501,524,882
負債合計		5,501,524,882
純資産の部		
元本等		
元本 ※1		133,145,475,897
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2		△1,996,180,506
元本等合計		131,149,295,391
純資産合計		131,149,295,391
負債純資産合計		136,650,820,273

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 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 年 9 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成 29 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	平成 28 年 9 月 8 日
期首元本額	143,654,359,473 円
期中追加設定元本額	15,627,022,980 円
期中一部解約元本額	26,135,906,556 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
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	12,084,121,303 円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	63,828,395 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
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
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私	76,208,283 円

募)	
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
D-I's TOPIXインデックス	37,386,271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
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	573,610円
iFree TOPIXインデックス	218,253,907円
iFree 8資産バランス	554,289,722円
DCダイワ日本株式インデックス	61,269,812,340円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,312,660,123円
ダイワ・ライフ・バランス50	2,363,094,190円
ダイワ・ライフ・バランス70	2,233,888,135円
年金ダイワ日本株式インデックス	3,968,189,714円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	21,251,339円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	59,644,627円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	12,842,583円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	404,752円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	400,556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
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	11,529,912円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	48,352,674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
ダイワ世界バランスファンド40VA	557,638,921円
ダイワ世界バランスファンド60VA	191,358,243円
ダイワ・バランスファンド35VA	11,937,573,145円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	319,015,775円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	490,619,296円
ダイワ・バランスファンド2	1,023,222,261円

	5VA (適格機関投資家専用) ダイワ国内バランスファンド	148,071,718 円
	25VA (適格機関投資家専用) ダイワ国内バランスファンド	256,045,701 円
	30VA (適格機関投資家専用) ダイワ・ノーロード TOPIX ファンド	62,724,638 円
	ダイワファンドラップ TO PIXインデックス	5,437,570,985 円
	ダイワTOPIXインデック ス (ダイワSMA専用)	4,253,094 円
	ダイワファンドラップオンラ イン TOPIXインデック ス	916,669,038 円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,200,859,744 円
	ダイワライフスタイル25	192,738,358 円
	ダイワライフスタイル50	644,422,182 円
	ダイワライフスタイル75	521,596,387 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
	計	133,145,475,897 円
2.	期末日における受益権の総数	133,145,475,897 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。 株式 5,124,123,700 円
5.	※4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとお り差入を行っております。 株式 623,500,000 円
6.	※5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 4,622,279 円が含 まれております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成 29 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	
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	
株式	22,351,693,667	
合計	22,351,693,667	

(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) 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			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数先物取引				
買 建	1,235,130,000	—	1,237,470,000	2,340,000
合計	1,235,130,000	—	1,237,470,000	2,340,000

(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
1 口当たり純資産額	0.9850 円
(1 万口当たり純資産額)	(9,850 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	3,600	3,255.00	11,718,000	
日本水産	82,700	615.00	50,860,500	
マルハニチロ	12,000	3,145.00	37,740,000	
カネコ種苗	4,400	1,534.00	6,749,600	

サカタのタネ	9,700	3,355.00	32,543,500	貸付株式数	2,500株
ホクト	5,800	1,919.00	11,130,200	貸付株式数	1,800株
ショーボンドHD	5,900	6,160.00	36,344,000	貸付株式数	1,600株
ミライト・ホールディングス	18,900	1,300.00	24,570,000		
タマホーム	10,500	708.00	7,434,000		
日鉄鉱業	1,900	7,730.00	14,687,000		
三井松島	6,100	1,422.00	8,674,200		
国際石油開発帝石	327,600	1,067.00	349,549,200		
日本海洋掘削	3,300	2,051.00	6,768,300	貸付株式数	900株 (700株)
石油資源開発	9,200	2,103.00	19,347,600	貸付株式数	2,600株
K&Oエナジーグループ	4,100	1,790.00	7,339,000		
安藤・間	47,500	777.00	36,907,500	貸付株式数	12,700株
東急建設	23,100	888.00	20,512,800		
コムシスホールディングス	23,800	2,477.00	58,952,600		
ミサワホーム	9,300	937.00	8,714,100		
高松コンストラクションGP	4,400	2,921.00	12,852,400		
東建コーポレーション	2,500	15,190.00	37,975,000		
大成建設	319,000	1,138.00	363,022,000		
大林組	188,900	1,306.00	246,703,400		
清水建設	193,600	1,149.00	222,446,400		
飛島建設	71,900	155.00	11,144,500	貸付株式数	9,300株
長谷工コーポレーション	73,100	1,410.00	103,071,000		
松井建設	8,300	952.00	7,901,600	貸付株式数	100株
鹿島建設	277,000	1,035.00	286,695,000		
不動テトラ	54,300	180.00	9,774,000		
鉄建建設	40,000	343.00	13,720,000		
西松建設	71,000	602.00	42,742,000		
三井住友建設	240,900	123.00	29,630,700		
大豊建設	25,000	504.00	12,600,000		
前田建設	42,000	1,334.00	56,028,000		
奥村組	48,000	817.00	39,216,000		
東鉄工業	7,800	3,620.00	28,236,000		
浅沼組	27,000	315.00	8,505,000		
戸田建設	74,000	794.00	58,756,000	貸付株式数	18,000株
熊谷組	103,000	330.00	33,990,000		
北野建設	20,000	441.00	8,820,000		
三井ホーム	11,000	702.00	7,722,000		
矢作建設	10,000	931.00	9,310,000	貸付株式数	2,700株
ピーエス三菱	14,700	579.00	8,511,300		
日本ハウスHLDGS	17,900	541.00	9,683,900	貸付株式数	3,100株
大東建託	22,700	19,145.00	434,591,500		
新日本建設	8,600	824.00	7,086,400	貸付株式数	400株
NIPPO	13,000	2,193.00	28,509,000		
東亜道路	17,000	419.00	7,123,000		
前田道路	19,000	2,245.00	42,655,000	貸付株式数	5,000株
日本道路	20,000	609.00	12,180,000		
東亜建設	5,800	2,216.00	12,852,800		
若築建設	53,000	193.00	10,229,000		
東洋建設	17,500	487.00	8,522,500		

五洋建設	69,400	652.00	45,248,800	
世紀東急	13,800	619.00	8,542,200	
福田組	2,200	6,040.00	13,288,000	
住友林業	42,100	1,667.00	70,180,700	
日本基礎技術	14,200	369.00	5,239,800	
日成ビルド工業	21,000	582.00	12,222,000	
大和ハウス	185,500	3,709.00	688,019,500	
ライト工業	12,100	1,080.00	13,068,000	
積水ハウス	189,800	1,889.50	358,627,100	
ユアテック	11,000	798.00	8,778,000	
西部電気工業	3,300	2,420.00	7,986,000	
中電工	6,300	3,010.00	18,963,000	
関電工	26,000	1,154.00	30,004,000	貸付株式数 7,000株
きんでん	42,400	1,805.00	76,532,000	
東京エネシス	6,700	1,151.00	7,711,700	
トーエネック	9,000	670.00	6,030,000	
住友電設	4,800	1,889.00	9,067,200	貸付株式数 400株
日本電設工業	9,500	2,238.00	21,261,000	
協和エクシオ	24,100	2,070.00	49,887,000	
日本工営	4,500	3,685.00	16,582,500	
九電工	12,600	4,345.00	54,747,000	貸付株式数 3,400株
三機工業	14,100	1,214.00	17,117,400	貸付株式数 900株
日揮	58,400	1,759.00	102,725,600	
中外炉工業	32,000	215.00	6,880,000	
太平電業	9,000	1,431.00	12,879,000	
高砂熱学	17,300	1,855.00	32,091,500	
NECネッツエスアイ	5,800	2,538.00	14,720,400	
明星工業	13,300	720.00	9,576,000	
大気社	7,500	2,847.00	21,352,500	
ダイダン	10,000	1,268.00	12,680,000	
日比谷総合設備	6,300	2,256.00	14,212,800	
東芝プラントシステム	10,100	1,932.00	19,513,200	
日本製粉	17,400	1,717.00	29,875,800	
日清製粉G本社	67,200	1,885.00	126,672,000	
昭和産業	24,000	604.00	14,496,000	
中部飼料	7,700	1,948.00	14,999,600	
フィード・ワン	49,900	238.00	11,876,200	
日本甜菜糖	3,600	2,318.00	8,344,800	
三井製糖	4,600	3,800.00	17,480,000	
塩水港精糖	29,900	249.00	7,445,100	
日新製糖	3,100	1,953.00	6,054,300	
Lifull	16,400	879.00	14,415,600	貸付株式数 4,900株 (4,900株)
ジェイエイシーリクルートメント	4,900	1,623.00	7,952,700	貸付株式数 1,300株
日本M&Aセンター	17,200	5,230.00	89,956,000	
タケエイ	6,700	1,148.00	7,691,600	貸付株式数 1,900株
トラスト・テック	3,800	3,110.00	11,818,000	
パソナグループ	5,800	1,142.00	6,623,600	貸付株式数 1,400株 (1,400株)

CDS	6,300	1,214.00	7,648,200		
リンクアンドモチベーション	13,000	707.00	9,191,000	貸付株式数	3,500株
GCA	7,500	944.00	7,080,000	貸付株式数	2,100株
エス・エム・エス	8,800	3,450.00	30,360,000	貸付株式数	2,300株
パーソルホールディングス	46,100	2,220.00	102,342,000		
リニカル	4,100	1,471.00	6,031,100	貸付株式数	1,100株
クックパッド	17,900	735.00	13,156,500	貸付株式数	5,000株
森永製菓	12,700	6,310.00	80,137,000		
中村屋	1,900	5,010.00	9,519,000		
江崎グリコ	15,900	5,770.00	91,743,000		
不二家	4,400	2,389.00	10,511,600		
山崎製パン	45,600	2,041.00	93,069,600	貸付株式数	12,700株
モロゾフ	1,400	7,430.00	10,402,000		
亀田製菓	3,600	4,930.00	17,748,000		
寿スピリッツ	6,400	3,620.00	23,168,000	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
カルビー	25,800	3,850.00	99,330,000	貸付株式数	7,200株 (600株)
森永乳業	58,000	854.00	49,532,000		
六甲バター	3,500	2,308.00	8,078,000		
ヤクルト	34,000	7,740.00	263,160,000	貸付株式数	8,400株
明治ホールディングス	37,200	8,700.00	323,640,000		
雪印メグミルク	13,800	3,225.00	44,505,000		
プリマハム	44,000	655.00	28,820,000		
日本ハム	45,000	3,065.00	137,925,000		
丸大食品	29,000	523.00	15,167,000		
S Foods	3,900	4,095.00	15,970,500	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
伊藤ハム米久HLDGS	36,200	1,002.00	36,272,400	貸付株式数	10,300株
スタジオアリス	2,900	2,590.00	7,511,000		
シミックホールディングス	3,400	1,486.00	5,052,400		
システナ	5,300	2,783.00	14,749,900		
デジタルアーツ	2,900	4,205.00	12,194,500	貸付株式数	500株
新日鉄住金SOL	9,200	2,354.00	21,656,800		
総合警備保障	21,600	4,910.00	106,056,000	貸付株式数	5,900株
いちご	53,600	352.00	18,867,200	貸付株式数	16,400株
日本駐車場開発	80,700	166.00	13,396,200	貸付株式数	21,800株 (21,700株)
カカクコム	42,300	1,346.00	56,935,800	貸付株式数	12,300株 (12,300株)
ルネサンス	5,200	1,747.00	9,084,400		
ディップ	8,400	2,293.00	19,261,200		
SBSホールディングス	6,800	769.00	5,229,200		
オプトホールディング	6,700	1,184.00	7,932,800	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
新日本科学	8,600	501.00	4,308,600	貸付株式数	2,100株
ツクイ	16,300	737.00	12,013,100	貸付株式数	400株
エムスリー	51,600	2,809.00	144,944,400	貸付株式数	14,500株
アウトソーシング	3,400	6,940.00	23,596,000	貸付株式数	900株 (100株)

ウェルネット	5,700	1,122.00	6,395,400	貸付株式数	1,600株
ディー・エヌ・エー	27,000	2,293.00	61,911,000		
博報堂DYHLDGS	81,500	1,469.00	119,723,500		
ぐるなび	8,700	1,608.00	13,989,600		
エスアールジータカミヤ	10,400	614.00	6,385,600	貸付株式数	2,800株
ジャパンベストレスキューS	16,500	401.00	6,616,500		
ファンコミュニケーションズ	16,300	1,162.00	18,940,600	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
ティア	10,100	842.00	8,504,200		
インフォマート	29,300	729.00	21,359,700		
サッポロホールディングス	20,300	3,160.00	64,148,000		
アサヒグループホールディング	117,700	4,710.00	554,367,000		
キリンHD	269,900	2,491.50	672,455,850		
宝ホールディングス	45,500	1,022.00	46,501,000		
オエノンホールディングス	32,600	280.00	9,128,000		
コカ・コーラボトラーズJ	39,500	3,800.00	150,100,000		
サントリー食品インター	43,000	5,080.00	218,440,000		
ダイドーグループHD	2,700	5,360.00	14,472,000		
伊藤園	18,600	3,850.00	71,610,000	貸付株式数	5,200株
キーコーヒー	5,600	2,198.00	12,308,800		
日清オイリオグループ	36,000	759.00	27,324,000		
不二製油グループ	17,000	2,930.00	49,810,000		
J-オイルミルズ	2,600	3,945.00	10,257,000		
ローソン	17,200	7,330.00	126,076,000	貸付株式数	4,800株
サンエー	4,200	4,835.00	20,307,000		
カワチ薬品	4,600	2,679.00	12,323,400		
エービーシー・マート	9,900	5,800.00	57,420,000	貸付株式数	200株
ハードオフコーポレーション	5,300	1,124.00	5,957,200		
アスクル	6,100	3,385.00	20,648,500	貸付株式数	1,700株 (100株)
ゲオホールディングス	8,800	1,528.00	13,446,400	貸付株式数	2,700株
アダストリア	8,800	2,406.00	21,172,800		
くらコーポレーション	3,300	5,790.00	19,107,000		
キャンドウ	4,500	1,736.00	7,812,000	貸付株式数	1,300株
エレマテック	2,300	1,985.00	4,565,500		
パルグループHLDGS	3,100	3,515.00	10,896,500		
エディオン	21,000	1,027.00	21,567,000	貸付株式数	8,800株
あらた	3,000	4,570.00	13,710,000		
サーラコーポレーション	11,300	865.00	9,774,500		
ワッツ	5,200	1,273.00	6,619,600		
ハローズ	2,100	2,378.00	4,993,800		
J Pホールディングス	23,700	317.00	7,512,900	貸付株式数	6,600株 (2,000株)
あみやき亭	1,800	4,575.00	8,235,000		
ひらまつ	14,700	609.00	8,952,300	貸付株式数	3,800株 (3,300株)
フィールズ	4,400	1,102.00	4,848,800	貸付株式数	1,200株
双日	309,300	290.00	89,697,000		
ゲンキー	2,500	5,030.00	12,575,000	貸付株式数	600株 (200株)

アルフレッサホールディングス	64,300	2,058.00	132,329,400	
大黒天物産	1,600	5,150.00	8,240,000	
ハニーズホールディングス	6,900	1,228.00	8,473,200	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
キッコーマン	43,100	3,455.00	148,910,500	貸付株式数 4,400株
味の素	129,300	2,126.00	274,891,800	
キューピー	32,000	2,612.00	83,584,000	
ハウス食品G本社	23,000	3,345.00	76,935,000	貸付株式数 6,300株
カゴメ	22,400	3,410.00	76,384,000	貸付株式数 6,400株
アリアケジャパン	5,300	8,080.00	42,824,000	貸付株式数 1,400株
ニチレイ	29,900	2,838.00	84,856,200	
横浜冷凍	12,800	1,057.00	13,529,600	貸付株式数 4,000株 (3,900株)
東洋水産	30,300	4,070.00	123,321,000	
日清食品HD	24,500	6,860.00	168,070,000	貸付株式数 3,400株
永谷園ホールディングス	8,000	1,281.00	10,248,000	
フジッコ	6,000	2,678.00	16,068,000	
ロックフィールド	7,000	1,986.00	13,902,000	
日本たばこ産業	347,100	3,719.00	1,290,864,900	
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,796.00	11,184,000	貸付株式数 1,000株
わらべや日洋HD	4,100	2,754.00	11,291,400	
ユーグレナ	22,300	1,119.00	24,953,700	貸付株式数 6,200株 (5,800株)
片倉工業	7,500	1,252.00	9,390,000	
グンゼ	46,000	502.00	23,092,000	
ヒューリック	115,600	1,066.00	123,229,600	
山下医科器械	4,000	1,714.00	6,856,000	
アルペン	3,800	2,172.00	8,253,600	
クオール	6,900	1,898.00	13,096,200	
アルコニックス	8,600	1,771.00	15,230,600	
神戸物産	3,900	5,720.00	22,308,000	
ジンズ	4,000	6,610.00	26,440,000	貸付株式数 1,000株
ビックカメラ	31,700	1,240.00	39,308,000	貸付株式数 8,900株 (8,900株)
DCMホールディングス	32,800	991.00	32,504,800	貸付株式数 9,100株 (9,100株)
MonotaRO	20,100	3,400.00	68,340,000	貸付株式数 5,600株
あいホールディングス	8,200	2,758.00	22,615,600	貸付株式数 2,200株
ディービーエックス	5,400	1,475.00	7,965,000	貸付株式数 1,000株
アークランドサービスHD	5,600	2,092.00	11,715,200	貸付株式数 1,200株
J.フロントリテイリング	69,800	1,483.00	103,513,400	
ドトール・日レスHD	9,400	2,362.00	22,202,800	
マツモトキヨシHLDGS	10,500	7,340.00	77,070,000	
ブロンコビリー	3,500	2,683.00	9,390,500	貸付株式数 900株 (900株)
スタートトゥデイ	49,400	3,365.00	166,231,000	
物語コーポレーション	2,000	6,810.00	13,620,000	貸付株式数 500株
ココカラファイン	5,800	6,290.00	36,482,000	

三越伊勢丹HD	110,400	1,116.00	123,206,400	貸付株式数	30,900株
東洋紡	231,000	198.00	45,738,000		
ユニチカ	186,000	79.00	14,694,000		
富士紡ホールディングス	3,300	3,660.00	12,078,000		
日清紡ホールディングス	28,100	1,161.00	32,624,100		
倉敷紡績	60,000	278.00	16,680,000		
ダイワボウHD	52,000	418.00	21,736,000		
シキボウ	69,000	156.00	10,764,000		
日東紡績	48,000	620.00	29,760,000		
トヨタ紡織	19,200	2,167.00	41,606,400		
マクニカ・富士エレHLDGS	10,300	1,859.00	19,147,700		
ウエルシアHD	15,300	4,250.00	65,025,000		
クリエイトSDH	8,100	2,809.00	22,752,900		
バイタルKSKHD	9,500	882.00	8,379,000		
UKCホールディングス	4,600	1,876.00	8,629,600		
丸善CHI HD	16,700	350.00	5,845,000		
TOKAIホールディングス	25,100	845.00	21,209,500	貸付株式数	5,900株
三洋貿易	4,700	2,488.00	11,693,600		
チムニー	1,300	2,902.00	3,772,600	貸付株式数	500株
ウイン・パートナーズ	6,300	1,434.00	9,034,200		
ジョイフル本田	9,200	2,821.00	25,953,200	貸付株式数	2,500株 (2,500株)
鳥貴族	3,000	2,684.00	8,052,000	貸付株式数	700株
すかいらく	34,000	1,616.00	54,944,000	貸付株式数	9,200株
綿半ホールディングス	3,600	2,401.00	8,643,600		
日本毛織	15,500	943.00	14,616,500		
ダイドーリミテッド	20,800	433.00	9,006,400		
ユナイテッド・スーパーマ ーケ	18,900	1,101.00	20,808,900		
野村不動産HLDGS	39,300	2,189.00	86,027,700		
三重交通グループHD	9,900	439.00	4,346,100		
サムティ	6,200	1,564.00	9,696,800	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本商業開発	4,700	1,657.00	7,787,900	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
プレサンスコーポレーション	9,700	1,433.00	13,900,100		
ユニゾホールディングス	5,500	2,575.00	14,162,500		
日本管理センター	4,600	1,500.00	6,900,000	貸付株式数	1,200株 (700株)
フージャースHD	10,900	1,013.00	11,041,700		
オープンハウス	9,400	3,265.00	30,691,000		
東急不動産HD	129,300	627.00	81,071,100		
飯田GHD	45,400	1,853.00	84,126,200	貸付株式数	12,800株
帝国繊維	6,600	2,155.00	14,223,000	貸付株式数	1,600株
ブックオフコーポレーション	11,700	800.00	9,360,000	貸付株式数	2,400株
日本コークス工業	65,300	104.00	6,791,200		
あさひ	4,900	1,238.00	6,066,200	貸付株式数	1,300株
日本調剤	2,100	3,530.00	7,413,000	貸付株式数	500株 (100株)

コスモス薬品	2,800	25,250.00	70,700,000		
シップヘルスケアHD	10,200	3,300.00	33,660,000		
一六堂	17,100	396.00	6,771,600		
ソフトクリエイトHD	5,300	1,448.00	7,674,400		
セブン&アイ・HLDGS	231,000	4,267.00	985,677,000		
薬王堂	3,600	2,987.00	10,753,200	貸付株式数	800株
クリエイト・レストランツ・ホール	17,000	1,125.00	19,125,000	貸付株式数	4,300株
ツルハホールディングス	11,200	13,330.00	149,296,000		
サンマルクホールディングス	3,600	3,265.00	11,754,000		
トリドールホールディングス	7,200	3,395.00	24,444,000		
帝人	46,800	2,219.00	103,849,200		
東レ	423,500	1,023.00	433,240,500	貸付株式数	20,000株
クラレ	98,000	2,057.00	201,586,000		
旭化成	365,000	1,271.50	464,097,500		
サカイオーベックス	3,800	2,148.00	8,162,400		
稲葉製作所	4,300	1,381.00	5,938,300	貸付株式数	1,200株
宮地エンジニアリングG	24,000	318.00	7,632,000		
トーカロ	4,300	3,925.00	16,877,500		
SUMCO	52,000	1,560.00	81,120,000	貸付株式数	17,200株
川田テクノロジーズ	1,400	5,850.00	8,190,000	貸付株式数	300株 (300株)
住江織物	22,000	324.00	7,128,000		
アツギ	76,000	124.00	9,424,000		
コメダホールディングス	10,400	1,885.00	19,604,000	貸付株式数	2,800株
ダイユー・リックHLDGS	9,400	851.00	7,999,400		
クスリのアオキHLDGS	4,600	6,670.00	30,682,000		
共和レザー	6,200	931.00	5,772,200		
セーレン	15,500	2,011.00	31,170,500		
ソトー	6,800	1,143.00	7,772,400		
東海染工	51,000	136.00	6,936,000		
小松精練	10,600	850.00	9,010,000		
ワコールホールディングス	33,000	1,571.00	51,843,000		
ホギメディカル	3,600	7,960.00	28,656,000	貸付株式数	1,000株
T S Iホールディングス	25,400	818.00	20,777,200		
T I S	18,500	3,150.00	58,275,000		
電算システム	3,300	1,815.00	5,989,500		
グリー	38,100	761.00	28,994,100		
コーエーテクモHD	13,100	2,235.00	29,278,500		
三菱総合研究所	2,600	3,105.00	8,073,000		
ファインデックス	5,600	809.00	4,530,400	貸付株式数	1,700株
KL a b	11,100	1,550.00	17,205,000	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
ポールトゥウィン・ピットクル	5,800	1,681.00	9,749,800		
ネクソン	61,300	2,652.00	162,567,600		
アイススタイル	14,500	620.00	8,990,000	貸付株式数	3,900株 (2,600株)
エイチーム	5,000	2,541.00	12,705,000	貸付株式数	300株
テクノスジャパン	6,100	1,003.00	6,118,300	貸付株式数	1,300株

コロプラ	17,900	1,224.00	21,909,600	貸付株式数	4,500株 (4,500株)
ブロードリーフ	15,300	812.00	12,423,600		
ハーツユニテッドグループ	4,200	1,445.00	6,069,000	貸付株式数	1,100株
特種東海製紙	3,100	4,260.00	13,206,000		
ティーガイア	5,700	2,101.00	11,975,700	貸付株式数	1,300株
豆蔵ホールディングス	7,200	1,065.00	7,668,000		
テクマトリックス	4,600	1,581.00	7,272,600	貸付株式数	1,200株
ガンホー・オンライン・エンター	150,500	316.00	47,558,000	貸付株式数	42,200株
GMOペイメントゲートウェイ	4,200	6,520.00	27,384,000	貸付株式数	1,300株
インターネットイニシアティブ	9,100	2,033.00	18,500,300		
さくらインターネット	6,000	813.00	4,878,000	貸付株式数	1,300株
SRAホールディングス	3,500	2,826.00	9,891,000		
朝日ネット	17,600	520.00	9,152,000		
コムチュア	1,700	5,850.00	9,945,000	貸付株式数	300株
王子ホールディングス	223,000	575.00	128,225,000		
日本製紙	25,600	2,073.00	53,068,800	貸付株式数	7,100株
三菱製紙	11,200	722.00	8,086,400		
北越紀州製紙	32,900	674.00	22,174,600	貸付株式数	9,100株
中越パルプ	26,000	220.00	5,720,000		
巴川製紙	24,000	286.00	6,864,000		
大王製紙	23,000	1,323.00	30,429,000	貸付株式数	6,700株 (6,500株)
gumi	7,000	1,122.00	7,854,000	貸付株式数	1,900株
LINE	15,800	3,835.00	60,593,000	貸付株式数	4,400株
レンゴー	53,400	629.00	33,588,600		
トーモク	19,000	376.00	7,144,000		
ザ・パック	4,400	3,800.00	16,720,000		
昭和電工	39,800	3,045.00	121,191,000		
住友化学	430,000	658.00	282,940,000		
住友精化	2,600	5,080.00	13,208,000		
日産化学	31,700	3,820.00	121,094,000		
ラサ工業	57,000	188.00	10,716,000		
クレハ	4,300	5,550.00	23,865,000	貸付株式数	1,200株
テイカ	11,000	916.00	10,076,000		
石原産業	11,600	1,447.00	16,785,200		
日東エフシー	6,000	869.00	5,214,000		
日本曹達	35,000	616.00	21,560,000		
東ソー	171,000	1,262.00	215,802,000		
トクヤマ	94,000	499.00	46,906,000		
セントラル硝子	57,000	465.00	26,505,000		
東亜合成	33,200	1,399.00	46,446,800		
大阪ソーダ	25,000	532.00	13,300,000		
関東電化	12,600	1,057.00	13,318,200	貸付株式数	3,400株
デンカ	111,000	723.00	80,253,000		
イビデン	39,100	1,762.00	68,894,200		
信越化学	105,300	9,630.00	1,014,039,000		

日本カーバイド	36,000	226.00	8,136,000	
堺化学	20,000	502.00	10,040,000	
エア・ウォーター	46,800	2,002.00	93,693,600	
大陽日酸	44,500	1,224.00	54,468,000	貸付株式数 12,600株
日本化学工業	31,000	249.00	7,719,000	
日本パーカライジング	29,600	1,633.00	48,336,800	
高压ガス	9,200	809.00	7,442,800	
四国化成	9,000	1,498.00	13,482,000	
戸田工業	17,000	487.00	8,279,000	
ステラ ケミフア	3,100	4,530.00	14,043,000	
保土谷化学	2,300	6,940.00	15,962,000	貸付株式数 600株 (600株)
日本触媒	9,100	7,870.00	71,617,000	
大日精化	24,000	1,046.00	25,104,000	
カネカ	76,000	846.00	64,296,000	貸付株式数 21,000株
協和発酵キリン	70,000	1,815.00	127,050,000	貸付株式数 3,400株
三菱瓦斯化学	54,900	2,737.00	150,261,300	
三井化学	265,000	637.00	168,805,000	
J S R	58,400	2,098.00	122,523,200	
東京応化工業	10,900	3,920.00	42,728,000	
大阪有機化学	6,600	1,292.00	8,527,200	
三菱ケミカルHLDGS	395,100	997.90	394,270,290	
ダイセル	78,800	1,362.00	107,325,600	
住友ベークライト	51,000	797.00	40,647,000	
積水化学	129,300	2,100.00	271,530,000	
日本ゼオン	50,000	1,385.00	69,250,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
アイカ工業	18,200	3,610.00	65,702,000	
宇部興産	295,000	304.00	89,680,000	
積水樹脂	8,400	2,005.00	16,842,000	貸付株式数 700株
タキロンシーアイ	13,000	636.00	8,268,000	
旭有機材	31,000	284.00	8,804,000	
日立化成	32,400	2,944.00	95,385,600	
ニチバン	7,000	1,102.00	7,714,000	
リケンテクノス	13,600	615.00	8,364,000	貸付株式数 3,800株
大倉工業	18,000	699.00	12,582,000	
積水化成成品	8,900	1,162.00	10,341,800	
群栄化学	1,900	3,635.00	6,906,500	
タイガース ポリマー	6,200	753.00	4,668,600	
ダイキョーニシカワ	10,400	1,657.00	17,232,800	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
日本化薬	37,000	1,735.00	64,195,000	
カーリットホールディングス	16,100	637.00	10,255,700	
E P Sホールディングス	8,300	2,093.00	17,371,900	
プレステージ・インター	13,200	1,123.00	14,823,600	貸付株式数 3,300株
アミューズ	3,900	2,709.00	10,565,100	貸付株式数 100株
野村総合研究所	41,500	4,180.00	173,470,000	
ドリームインキュベータ	2,700	2,080.00	5,616,000	貸付株式数 200株
クイック	5,100	1,639.00	8,358,900	
ケネディクス	76,400	525.00	40,110,000	

電通	65,100	4,475.00	291,322,500	貸付株式数	18,800株 (18,800株)
インテージホールディングス	3,900	2,612.00	10,186,800		
イオンファンタジー	2,100	3,525.00	7,402,500	貸付株式数	700株 (700株)
シーティーエス	9,800	734.00	7,193,200		
日本精化	8,300	941.00	7,810,300		
扶桑化学工業	4,800	3,560.00	17,088,000		
ADEKA	22,800	1,871.00	42,658,800		
日油	45,000	1,585.00	71,325,000		
ミヨシ油脂	6,700	1,392.00	9,326,400		
花王	137,600	6,754.00	929,350,400		
第一工業製薬	19,000	611.00	11,609,000		
三洋化成	3,200	5,740.00	18,368,000		
武田薬品	219,700	5,963.00	1,310,071,100		
アステラス製薬	572,700	1,381.00	790,898,700		
大日本住友製薬	40,300	1,460.00	58,838,000	貸付株式数	11,700株
塩野義製薬	74,300	5,741.00	426,556,300		
田辺三菱製薬	68,500	2,576.00	176,456,000		
あすか製薬	6,700	1,676.00	11,229,200		
日本新薬	13,700	7,420.00	101,654,000		
中外製薬	59,000	4,305.00	253,995,000		
科研製薬	10,900	5,700.00	62,130,000		
エーザイ	72,200	5,627.00	406,269,400		
理研ビタミン	1,900	4,205.00	7,989,500		
ロート製薬	28,900	2,559.00	73,955,100		
小野薬品	133,400	2,198.50	293,279,900		
久光製薬	16,400	5,110.00	83,804,000	貸付株式数	4,500株
持田製薬	3,600	8,110.00	29,196,000	貸付株式数	400株
参天製薬	105,800	1,762.00	186,419,600	貸付株式数	29,700株
扶桑薬品	2,700	2,753.00	7,433,100		
日本ケミファ	1,600	5,020.00	8,032,000		
ツムラ	20,100	4,005.00	80,500,500		
日医工	13,600	1,631.00	22,181,600	貸付株式数	3,900株
テルモ	85,300	4,415.00	376,599,500		
みらかホールディングス	14,600	4,890.00	71,394,000		
キッセイ薬品工業	10,200	2,758.00	28,131,600		
生化学工業	10,900	1,850.00	20,165,000		
栄研化学	5,200	3,935.00	20,462,000	貸付株式数	1,300株
日水製薬	4,200	1,406.00	5,905,200		
鳥居薬品	3,900	2,840.00	11,076,000		
JCRファーマ	4,800	2,946.00	14,140,800	貸付株式数	1,300株
東和薬品	2,800	5,130.00	14,364,000	貸付株式数	100株
富士製薬工業	2,700	3,585.00	9,679,500		
沢井製薬	9,600	5,900.00	56,640,000	貸付株式数	2,200株
ゼリア新薬工業	12,500	1,989.00	24,862,500		
第一三共	171,800	2,531.50	434,911,700		
キョーリン製薬HD	13,600	2,170.00	29,512,000		
大幸薬品	4,500	2,299.00	10,345,500		
ダイト	3,900	2,706.00	10,553,400		

大塚ホールディングス	116,300	4,358.00	506,835,400		
大正製薬HD	12,100	8,550.00	103,455,000		
ペプチドリーム	22,500	3,490.00	78,525,000	貸付株式数	6,200株 (600株)
大日本塗料	37,000	325.00	12,025,000		
日本ペイントHOLD	45,700	3,775.00	172,517,500	貸付株式数	12,700株
関西ペイント	61,600	2,767.00	170,447,200		
中国塗料	15,800	904.00	14,283,200		
日本特殊塗料	5,000	1,843.00	9,215,000		
藤倉化成	9,800	640.00	6,272,000		
太陽ホールディングス	4,800	5,290.00	25,392,000		
D I C	23,000	3,820.00	87,860,000		
サカタインクス	12,400	1,980.00	24,552,000		
東洋インキSCホールディン	47,000	612.00	28,764,000		
T&K TOKA	5,300	1,252.00	6,635,600		
アルプス技研	3,100	3,535.00	10,958,500		
オリエンタルランド	63,300	8,255.00	522,541,500	貸付株式数	17,600株
ダスキン	14,400	3,080.00	44,352,000		
パーク24	30,900	2,599.00	80,309,100	貸付株式数	8,500株
明光ネットワークジャパン	7,900	1,439.00	11,368,100		
ファルコホールディングス	6,600	1,571.00	10,368,600		
フジ・メディア・HD	56,400	1,566.00	88,322,400	貸付株式数	16,100株
ラウンドワン	19,500	1,267.00	24,706,500		
リゾートトラスト	22,700	2,034.00	46,171,800		
オービック	19,200	6,750.00	129,600,000		
ジャストシステム	10,100	2,373.00	23,967,300		
TDCソフトウェアエンジニア	5,400	1,088.00	5,875,200		
ヤフー	405,400	500.00	202,700,000	貸付株式数	114,100株
ビー・エム・エル	7,500	2,377.00	17,827,500		
トレンドマイクロ	27,000	4,975.00	134,325,000		
りらいあコミュニケーション	10,700	1,203.00	12,872,100		
リソー教育	12,900	817.00	10,539,300		
日本オラクル	8,900	8,030.00	71,467,000		
フューチャー	10,300	927.00	9,548,100		
CAC HOLDINGS	6,000	1,013.00	6,078,000		
ソフトバンク・テクノ	4,000	1,748.00	6,992,000	貸付株式数	1,000株 (600株)
ユー・エス・エス	70,800	2,180.00	154,344,000		
オービックビジネスC	2,900	5,510.00	15,979,000	貸付株式数	100株
伊藤忠テクノソリュー	12,900	3,965.00	51,148,500		
アイティフォー	14,200	583.00	8,278,600		
サイバーエージェント	36,000	3,450.00	124,200,000		
楽天	276,300	1,291.50	356,841,450	貸付株式数	55,800株
テー・オー・ダブリュー	8,900	817.00	7,271,300		
大塚商会	16,800	6,930.00	116,424,000		
総合メディカル	3,000	5,070.00	15,210,000		
サイボウズ	14,200	473.00	6,716,600		
ソフトブレイン	8,000	396.00	3,168,000	貸付株式数	2,400株
セントラルスポーツ	3,200	4,085.00	13,072,000	貸付株式数	700株

パラカ	3,500	2,342.00	8,197,000	貸付株式数	700株
電通国際情報S	4,200	2,403.00	10,092,600		
デジタルガレージ	11,300	2,076.00	23,458,800	貸付株式数	3,100株
ウェザーニューズ	2,600	3,440.00	8,944,000	貸付株式数	700株 (700株)
C I J	16,400	629.00	10,315,600		
WOWOW	3,400	3,610.00	12,274,000	貸付株式数	900株
フルキャストホールディングス	6,000	1,864.00	11,184,000		
富士フイルムHLDGS	114,800	4,285.00	491,918,000		
コニカミノルタ	129,200	857.00	110,724,400	貸付株式数	7,800株
資生堂	105,100	4,574.00	480,727,400		
ライオン	78,900	2,183.00	172,238,700		
高砂香料	4,000	4,000.00	16,000,000	貸付株式数	600株
マンダム	5,800	6,310.00	36,598,000		
ミルボン	4,100	6,480.00	26,568,000		
ファンケル	13,200	2,458.00	32,445,600		
コーセー	9,600	13,870.00	133,152,000		
シーズ・ホールディングス	8,100	4,305.00	34,870,500		
ポーラ・オルビスHD	24,800	3,600.00	89,280,000		
ノエビアホールディングス	4,200	6,410.00	26,922,000		
コニシ	9,500	1,887.00	17,926,500		
長谷川香料	7,300	2,141.00	15,629,300		
星光PMC	4,400	1,173.00	5,161,200	貸付株式数	1,200株 (200株)
小林製薬	15,900	6,610.00	105,099,000		
荒川化学工業	5,600	2,452.00	13,731,200		
メック	6,300	1,614.00	10,168,200	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	4,300	2,695.00	11,588,500		
タカラバイオ	17,100	1,449.00	24,777,900	貸付株式数	4,400株
JCU	4,300	4,885.00	21,005,500		
新田ゼラチン	8,200	739.00	6,059,800	貸付株式数	800株
デクセリアルズ	16,000	1,431.00	22,896,000		
アース製薬	4,300	5,110.00	21,973,000	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
北興化学	12,900	618.00	7,972,200		
大成ラミック	3,300	2,965.00	9,784,500		
クミアイ化学	26,300	643.00	16,910,900	貸付株式数	7,300株 (3,700株)
日本農薬	15,600	616.00	9,609,600	貸付株式数	4,200株 (100株)
昭和シェル石油	51,500	1,199.00	61,748,500		
ニチレキ	9,200	1,328.00	12,217,600	貸付株式数	300株
ユシロ化学	4,700	1,573.00	7,393,100		
富士石油	18,900	401.00	7,578,900	貸付株式数	3,700株
MORESCO	4,200	2,010.00	8,442,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
出光興産	36,500	2,777.00	101,360,500		
JXTGホールディングス	889,300	537.10	477,643,030		

コスモエネルギーHLDGS	17,700	2,302.00	40,745,400	貸付株式数	4,800株
横浜ゴム	32,500	2,066.00	67,145,000		
東洋ゴム	33,800	2,199.00	74,326,200		
ブリヂストン	197,700	4,717.00	932,550,900		
住友ゴム	54,400	1,863.00	101,347,200	貸付株式数	15,200株 (15,000株)
藤倉ゴム	10,700	876.00	9,373,200		
オカモト	19,000	1,120.00	21,280,000		
アキレス	5,100	2,188.00	11,158,800		
ニッタ	5,000	3,830.00	19,150,000		
住友理工	9,400	1,052.00	9,888,800		
三ツ星ベルト	14,000	1,281.00	17,934,000	貸付株式数	1,000株
バンドー化学	9,200	1,087.00	10,000,400		
旭硝子	57,100	4,155.00	237,250,500		
日本板硝子	25,900	815.00	21,108,500		
有沢製作所	12,700	987.00	12,534,900		
日本山村硝子	41,000	192.00	7,872,000		
日本電気硝子	24,300	4,005.00	97,321,500		
住友大阪セメント	109,000	492.00	53,628,000		
太平洋セメント	356,000	423.00	150,588,000		
日本ヒューム	10,300	667.00	6,870,100		
日本コンクリート	17,500	427.00	7,472,500		
アジアパイルHD	10,800	581.00	6,274,800		
東海カーボン	53,000	796.00	42,188,000		
日本カーボン	3,300	3,950.00	13,035,000	貸付株式数	300株
東洋炭素	4,000	2,528.00	10,112,000	貸付株式数	1,100株
ノリタケ	3,600	4,820.00	17,352,000		
TOTO	42,900	4,085.00	175,246,500		
日本碍子	73,100	2,017.00	147,442,700		
日本特殊陶業	50,200	2,120.00	106,424,000	貸付株式数	10,200株
MARUWA	2,400	5,820.00	13,968,000		
品川リフラクトリーズ	16,000	354.00	5,664,000		
黒崎播磨	16,000	512.00	8,192,000		
フジインコーポレーテッド	5,400	2,359.00	12,738,600	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
ニチアス	32,000	1,314.00	42,048,000		
新日鐵住金	263,100	2,628.00	691,426,800		
神戸製鋼所	101,100	1,343.00	135,777,300	貸付株式数	28,900株
中山製鋼所	6,400	719.00	4,601,600		
合同製鐵	3,900	2,082.00	8,119,800		
JFEホールディングス	159,800	2,257.00	360,668,600		
日新製鋼	18,200	1,418.00	25,807,600		
東京製鐵	31,700	917.00	29,068,900	貸付株式数	8,500株
共英製鋼	6,600	1,636.00	10,797,600	貸付株式数	1,800株
大和工業	11,300	3,100.00	35,030,000		
東京鐵鋼	18,000	437.00	7,866,000		
大阪製鐵	3,600	2,361.00	8,499,600		
淀川製鋼所	7,600	3,025.00	22,990,000		
東洋鋼鈑	16,000	522.00	8,352,000		
丸一鋼管	18,700	3,260.00	60,962,000	貸付株式数	5,200株

大同特殊鋼	99,000	642.00	63,558,000	
日本高周波	64,000	111.00	7,104,000	
日本冶金工	56,800	218.00	12,382,400	貸付株式数 15,700株
山陽特殊製鋼	36,000	573.00	20,628,000	
愛知製鋼	3,000	4,275.00	12,825,000	
日立金属	59,800	1,488.00	88,982,400	
大太平洋金属	43,000	320.00	13,760,000	貸付株式数 2,000株
新日本電工	37,500	461.00	17,287,500	貸付株式数 10,000株
栗本鉄工所	3,100	2,231.00	6,916,100	
日本鑄鉄管	25,000	173.00	4,325,000	
日本製鋼所	19,000	2,206.00	41,914,000	
三菱製鋼	46,000	282.00	12,972,000	
大紀アルミニウム	15,000	774.00	11,610,000	
日本軽金属HD	146,200	327.00	47,807,400	
三井金属	163,000	573.00	93,399,000	
東邦亜鉛	37,000	519.00	19,203,000	
三菱マテリアル	36,400	3,965.00	144,326,000	
住友鉱山	152,000	1,892.50	287,660,000	貸付株式数 42,000株
DOWAホールディングス	64,000	822.00	52,608,000	
古河機金	92,000	191.00	17,572,000	
大阪チタニウム	7,400	1,509.00	11,166,600	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
東邦チタニウム	11,500	793.00	9,119,500	貸付株式数 3,100株 (200株)
UACJ	83,000	287.00	23,821,000	
古河電工	19,900	5,740.00	114,226,000	
住友電工	219,600	1,675.00	367,830,000	
フジクラ	78,000	858.00	66,924,000	
昭和電線HLDGS	96,000	92.00	8,832,000	
タツタ電線	15,000	704.00	10,560,000	
リョービ	34,000	571.00	19,414,000	
アーレステイ	8,000	894.00	7,152,000	
アサヒHD	8,700	2,318.00	20,166,600	
東洋製罐グループHD	39,300	1,828.00	71,840,400	
ホッカンホールディングス	18,000	408.00	7,344,000	
横河ブリッジHLDGS	10,500	1,972.00	20,706,000	
OSJB HD	27,800	314.00	8,729,200	貸付株式数 7,600株
駒井ハルテック	2,500	2,316.00	5,790,000	
三和ホールディングス	57,500	1,257.00	72,277,500	貸付株式数 15,300株
文化シヤッター	15,900	857.00	13,626,300	
三協立山	8,400	1,537.00	12,910,800	
アルインコ	6,400	1,255.00	8,032,000	
LIXILグループ	82,000	2,886.00	236,652,000	
ノーリツ	11,900	1,907.00	22,693,300	貸付株式数 3,300株
長府製作所	5,700	2,669.00	15,213,300	
リンナイ	10,000	9,530.00	95,300,000	
ユニプレス	10,500	2,826.00	29,673,000	
岡部	11,600	1,000.00	11,600,000	貸付株式数 600株
ジーテクト	6,100	2,123.00	12,950,300	
東プレ	10,900	3,095.00	33,735,500	貸付株式数 3,100株

高周波熱錬	11,200	1,074.00	12,028,800		
東京製綱	4,800	1,537.00	7,377,600	貸付株式数	1,300株
パイオラックス	9,500	2,885.00	27,407,500	貸付株式数	600株
日本発条	52,900	1,129.00	59,724,100	貸付株式数	14,900株
三浦工業	23,900	2,470.00	59,033,000		
タクマ	19,700	1,256.00	24,743,200		
テクノプロ・ホールディング	10,000	5,120.00	51,200,000		
ジャパンマテリアル	4,500	2,692.00	12,114,000	貸付株式数	1,400株 (600株)
ベクトル	6,200	1,334.00	8,270,800	貸付株式数	1,500株
アサンテ	4,200	1,833.00	7,698,600		
N・フィールド	4,500	1,218.00	5,481,000	貸付株式数	1,200株
リクルートホールディングス	385,700	2,346.00	904,852,200		
ツガミ	18,000	861.00	15,498,000	貸付株式数	4,000株
オークマ	38,000	1,059.00	40,242,000		
東芝機械	31,000	536.00	16,616,000		
アマダホールディングス	77,200	1,221.00	94,261,200		
アイダエンジニア	16,100	1,237.00	19,915,700		
滝澤鉄工所	56,000	182.00	10,192,000		
富士機械製造	18,500	1,906.00	35,261,000		
牧野フライス	30,000	872.00	26,160,000	貸付株式数	8,000株 (8,000株)
オーエスジー	24,400	2,327.00	56,778,800	貸付株式数	7,600株 (7,600株)
旭ダイヤモンド	16,700	951.00	15,881,700		
DMG森精機	30,900	1,780.00	55,002,000		
ソデイツク	16,600	1,302.00	21,613,200		
ディスコ	7,000	20,040.00	140,280,000		
日東工器	3,400	2,749.00	9,346,600		
日本郵政	149,800	1,329.00	199,084,200		
ベルシステム24HLDGS	10,100	1,100.00	11,110,000	貸付株式数	2,800株
豊田自動織機	51,000	5,800.00	295,800,000		
OKK	59,000	125.00	7,375,000		
島精機製作所	8,000	5,320.00	42,560,000	貸付株式数	2,100株
フリー	4,500	1,097.00	4,936,500		
日阪製作所	9,300	962.00	8,946,600		
やまびこ	11,300	1,311.00	14,814,300		
ペガサスミシン製造	9,600	736.00	7,065,600		
ナブテスコ	30,000	3,910.00	117,300,000	貸付株式数	8,400株
三井海洋開発	6,100	2,415.00	14,731,500	貸付株式数	1,600株
レオン自動機	6,900	1,336.00	9,218,400		
SMC	17,600	38,050.00	669,680,000	貸付株式数	1,800株
新川	8,200	705.00	5,781,000		
ホソカワミクロン	2,600	5,540.00	14,404,000		
ユニオンツール	2,900	3,480.00	10,092,000	貸付株式数	800株
オイレス工業	6,600	1,982.00	13,081,200		
サトーホールディングス	7,700	2,481.00	19,103,700	貸付株式数	2,100株
日精樹脂工業	6,500	1,416.00	9,204,000		
小松製作所	270,600	3,109.00	841,295,400		
住友重機械	170,000	817.00	138,890,000		

日立建機	26,200	3,210.00	84,102,000		
巴工業	4,800	1,870.00	8,976,000		
井関農機	5,500	2,378.00	13,079,000		
TOWA	5,600	1,663.00	9,312,800	貸付株式数	100株
丸山製作所	4,600	1,790.00	8,234,000		
北川鉄工所	3,400	2,533.00	8,612,200		
シンニッタン	8,800	726.00	6,388,800		
ローツェ	3,300	2,152.00	7,101,600	貸付株式数	800株 (200株)
クボタ	301,600	1,920.50	579,222,800	貸付株式数	78,100株
東洋エンジニア	37,000	280.00	10,360,000	貸付株式数	10,000株
三菱化工機	36,000	230.00	8,280,000		
月島機械	10,800	1,354.00	14,623,200		
帝国電機製作所	6,600	1,169.00	7,715,400		
新東工業	14,200	1,164.00	16,528,800		
渋谷工業	5,300	3,460.00	18,338,000		
アイチ コーポレーション	9,700	727.00	7,051,900		
小森コーポレーション	14,300	1,367.00	19,548,100		
鶴見製作所	4,900	1,944.00	9,525,600		
住友精密	19,000	347.00	6,593,000		
荏原製作所	26,100	3,490.00	91,089,000		
西島製作所	6,400	1,136.00	7,270,400		
北越工業	10,000	1,035.00	10,350,000		
千代田化工建	44,000	584.00	25,696,000	貸付株式数	12,000株
ダイキン工業	76,300	10,945.00	835,103,500		
オルガノ	16,000	541.00	8,656,000		
トーヨーカネツ	31,000	358.00	11,098,000		
栗田工業	31,300	3,145.00	98,438,500		
椿本チエイン	31,000	865.00	26,815,000		
日 機 装	20,000	977.00	19,540,000	貸付株式数	1,000株
新興プランテック	13,800	933.00	12,875,400		
アネスト岩田	10,800	1,049.00	11,329,200		
ダイフク	28,300	4,835.00	136,830,500		
加藤製作所	3,600	3,365.00	12,114,000		
油研工業	36,000	247.00	8,892,000		
タダノ	29,800	1,258.00	37,488,400		
フジテック	16,200	1,585.00	25,677,000	貸付株式数	4,600株
CKD	17,400	1,931.00	33,599,400		
キトー	8,100	1,285.00	10,408,500		
平和	17,100	2,162.00	36,970,200	貸付株式数	4,800株
理想科学工業	5,500	2,046.00	11,253,000		
SANKYO	14,300	3,510.00	50,193,000		
日本金銭機械	6,500	1,136.00	7,384,000	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	3,500	2,255.00	7,892,500		
福島工業	3,700	3,975.00	14,707,500		
ダイコク電機	3,300	1,669.00	5,507,700		
竹内製作所	10,700	2,048.00	21,913,600	貸付株式数	2,700株
ア マ ノ	17,100	2,555.00	43,690,500		
JUKI	8,900	1,513.00	13,465,700		

サンデンホールディングス	41,000	361.00	14,801,000	貸付株式数	10,000株
蛇の目ミシン	7,500	771.00	5,782,500		
ブラザー工業	68,800	2,536.00	174,476,800		
マックス	10,000	1,441.00	14,410,000		
モリタホールディングス	10,400	1,685.00	17,524,000	貸付株式数	1,700株
グローリー	17,100	3,890.00	66,519,000		
新晃工業	6,200	1,796.00	11,135,200		
大和冷機工業	10,200	1,190.00	12,138,000		
セガサミーホールディングス	55,300	1,525.00	84,332,500		
日本ピストンリング	4,000	2,233.00	8,932,000		
リケン	2,800	5,050.00	14,140,000		
T P R	6,400	3,415.00	21,856,000		
ツバキ・ナカシマ	6,300	2,375.00	14,962,500	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,700	9,820.00	173,814,000	貸付株式数	4,900株
大豊工業	5,200	1,584.00	8,236,800		
日本精工	115,600	1,342.00	155,135,200	貸付株式数	33,100株 (33,100株)
N T N	129,000	436.00	56,244,000	貸付株式数	36,000株
ジェイテクト	57,600	1,450.00	83,520,000		
不二越	53,000	579.00	30,687,000	貸付株式数	14,000株
ミネベアミツミ	103,300	1,752.00	180,981,600		
日本トムソン	20,100	598.00	12,019,800		
T H K	39,600	3,610.00	142,956,000		
ユーシン精機	3,300	3,075.00	10,147,500	貸付株式数	900株 (800株)
イーグル工業	6,300	1,906.00	12,007,800		
日本ピラー工業	7,000	1,551.00	10,857,000		
キッツ	28,800	876.00	25,228,800	貸付株式数	800株
日立	1,342,000	734.90	986,235,800		
三菱電機	595,000	1,649.00	981,155,000		
富士電機	167,000	601.00	100,367,000		
東洋電機製造	3,800	2,038.00	7,744,400	貸付株式数	1,300株
安川電機	65,200	3,275.00	213,530,000	貸付株式数	18,200株
シンフォニアテクノロジー	42,000	412.00	17,304,000		
明電舎	51,000	372.00	18,972,000		
山洋電気	16,000	1,210.00	19,360,000		
デンヨー	5,600	1,917.00	10,735,200		
三桜工業	10,300	876.00	9,022,800		
マキタ	73,100	4,485.00	327,853,500		
東芝テック	35,000	616.00	21,560,000		
芝浦メカトロニクス	19,000	322.00	6,118,000		
マブチモーター	15,400	5,120.00	78,848,000		
日本電産	72,600	12,190.00	884,994,000	貸付株式数	20,400株
東光高岳	3,800	1,758.00	6,680,400		
ダブル・スコープ	8,400	2,098.00	17,623,200	貸付株式数	2,300株 (100株)
ダイヘン	32,000	927.00	29,664,000		
田淵電機	16,000	285.00	4,560,000	貸付株式数	5,700株 (600株)

JVCケンウッド	43,900	298.00	13,082,200	貸付株式数	13,200株
日新電機	11,400	1,306.00	14,888,400		
大崎電気	12,000	850.00	10,200,000		
オムロン	59,400	5,420.00	321,948,000	貸付株式数	16,700株 (100株)
日東工業	7,600	1,911.00	14,523,600		
I D E C	9,600	1,915.00	18,384,000		
ジーエス・ユアサ コーポ	106,000	537.00	56,922,000		
サクサホールディングス	28,000	200.00	5,600,000		
メルコホールディングス	3,300	3,550.00	11,715,000	貸付株式数	1,000株
日本電気	762,000	289.00	220,218,000		
富士通	541,000	785.00	424,685,000		
沖電気	23,900	1,452.00	34,702,800		
電気興業	17,000	552.00	9,384,000		
サンケン電気	34,000	528.00	17,952,000		
アイホン	4,200	1,787.00	7,505,400	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
ルネサスエレクトロニクス	31,000	1,083.00	33,573,000	貸付株式数	8,700株
セイコーエプソン	83,700	2,730.00	228,501,000	貸付株式数	200株
ワコム	44,700	503.00	22,484,100	貸付株式数	15,100株 (15,100株)
アルバック	9,700	5,940.00	57,618,000		
アクセル	4,900	737.00	3,611,300		
E I Z O	5,800	4,400.00	25,520,000		
ジャパンディスプレイ	108,200	186.00	20,125,200	貸付株式数	32,000株 (31,700株)
日本信号	15,400	1,129.00	17,386,600	貸付株式数	4,600株
京三製作所	20,000	554.00	11,080,000	貸付株式数	5,000株
能美防災	6,500	1,665.00	10,822,500		
ホーチキ	5,100	2,016.00	10,281,600		
エレコム	5,200	2,223.00	11,559,600		
日本無線	3,500	1,468.00	5,138,000		
パナソニック	642,100	1,482.50	951,913,250		
アンリツ	42,100	847.00	35,658,700		
富士通ゼネラル	19,500	2,315.00	45,142,500		
日立国際電気	14,700	2,745.00	40,351,500	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
ソニー	395,200	4,258.00	1,682,761,600		
T D K	31,100	7,150.00	222,365,000		
帝国通信工業	30,000	222.00	6,660,000		
タムラ製作所	25,000	580.00	14,500,000		
アルプス電気	51,800	2,898.00	150,116,400		
パイオニア	83,300	200.00	16,660,000	貸付株式数	24,000株
日本電波工業	7,400	818.00	6,053,200	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
日本トリム	1,400	4,485.00	6,279,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド ディー. ジー.	3,500	2,705.00	9,467,500		
フオスター電機	6,900	2,333.00	16,097,700		
クラリオン	31,000	420.00	13,020,000		

S M K	17,000	439.00	7,463,000		
ヨコオ	6,300	1,420.00	8,946,000	貸付株式数	1,500株
ホシデン	17,200	1,701.00	29,257,200		
ヒロセ電機	9,000	15,170.00	136,530,000	貸付株式数	2,500株
日本航空電子	16,000	1,713.00	27,408,000		
T O A	7,000	1,147.00	8,029,000		
日立マクセル	8,500	2,503.00	21,275,500		
古野電気	8,800	665.00	5,852,000		
ユニデンホールディングス	30,000	263.00	7,890,000	貸付株式数	4,000株
アルパイン	14,100	1,953.00	27,537,300		
スミダコーポレーション	6,400	1,898.00	12,147,200	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
アイコム	3,500	2,508.00	8,778,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
リオン	3,400	2,129.00	7,238,600		
船井電機	6,300	837.00	5,273,100	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
横河電機	60,300	1,768.00	106,610,400		
新電元工業	25,000	649.00	16,225,000		
アズビル	16,600	4,560.00	75,696,000	貸付株式数	4,600株
日本光電工業	23,000	2,489.00	57,247,000		
共和電業	16,800	431.00	7,240,800	貸付株式数	2,700株
堀場製作所	10,800	6,370.00	68,796,000		
アドバンテスト	38,600	1,909.00	73,687,400	貸付株式数	10,800株
エスベック	5,600	1,988.00	11,132,800		
キーエンス	25,400	57,140.00	1,451,356,000		
日置電機	3,200	2,155.00	6,896,000		
シスメックス	43,500	6,850.00	297,975,000	貸付株式数	12,200株
日本マイクロニクス	10,700	940.00	10,058,000	貸付株式数	3,100株
メガチップス	5,600	3,595.00	20,132,000	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,500	5,950.00	20,825,000		
デンソー	137,600	5,229.00	719,510,400		
コーセル	8,600	1,420.00	12,212,000		
イリゾ電子工業	4,800	5,670.00	27,216,000		
オブテックスグループ	4,800	4,180.00	20,064,000		
千代田インテグレ	2,900	2,322.00	6,733,800		
レーザーテック	13,400	1,977.00	26,491,800		
スタンレー電気	39,700	3,645.00	144,706,500		
岩崎電気	33,000	187.00	6,171,000		
ウシオ電機	32,700	1,481.00	48,428,700		
日本セラミック	6,200	2,792.00	17,310,400	貸付株式数	100株
遠藤照明	4,200	1,358.00	5,703,600		
古河電池	8,000	892.00	7,136,000		
山一電機	6,300	1,889.00	11,900,700	貸付株式数	1,600株
図研	5,600	1,448.00	8,108,800	貸付株式数	1,400株
日本電子	21,000	503.00	10,563,000	貸付株式数	2,000株
カシオ	44,500	1,530.00	68,085,000	貸付株式数	6,800株
ファナック	56,700	21,100.00	1,196,370,000		
日本シイエムケイ	13,500	1,003.00	13,540,500	貸付株式数	3,700株

				(3,600株)
エンプラス	2,600	4,575.00	11,895,000	貸付株式数 700株 (700株)
ローム	27,200	8,250.00	224,400,000	
浜松ホトニクス	39,800	3,400.00	135,320,000	
三井ハイテック	8,600	2,285.00	19,651,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
新光電気工業	22,400	718.00	16,083,200	
京セラ	91,300	6,519.00	595,184,700	
太陽誘電	27,000	1,664.00	44,928,000	
村田製作所	58,700	16,300.00	956,810,000	
ユーシン	13,500	764.00	10,314,000	貸付株式数 3,900株 (3,500株)
双葉電子工業	8,400	1,984.00	16,665,600	
日東電工	42,200	9,487.00	400,351,400	
北陸電気工業	45,000	143.00	6,435,000	
東海理化電機	13,700	2,076.00	28,441,200	
ニチコン	18,600	1,240.00	23,064,000	
日本ケミコン	51,000	372.00	18,972,000	
K O A	8,900	1,941.00	17,274,900	
三井造船	197,000	137.00	26,989,000	
日立造船	42,600	544.00	23,174,400	
三菱重工業	932,000	420.90	392,278,800	
川崎重工業	429,000	340.00	145,860,000	貸付株式数 122,000株
I H I	432,000	376.00	162,432,000	
名村造船所	18,400	643.00	11,831,200	
日本車輛	26,000	294.00	7,644,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
F P G	20,700	1,202.00	24,881,400	貸付株式数 1,400株
じもとホールディングス	59,200	191.00	11,307,200	
全国保証	16,000	4,445.00	71,120,000	
めぶきフィナンシャルG	266,800	384.00	102,451,200	
東京TYフィナンシャルG	8,100	2,520.00	20,412,000	
九州フィナンシャルG	88,900	640.00	56,896,000	貸付株式数 24,500株
かんぽ生命保険	20,100	2,284.00	45,908,400	
ゆうちょ銀行	155,400	1,370.00	212,898,000	
富山第一銀行	14,400	509.00	7,329,600	
コンコルディア・フィナンシャル	357,400	531.80	190,065,320	
西日本フィナンシャルHD	35,800	1,113.00	39,845,400	
日産自動車	658,900	1,092.50	719,848,250	貸付株式数 185,900株
いすゞ自動車	161,700	1,433.00	231,716,100	
トヨタ自動車 ※	679,300	6,235.00	4,235,435,500	
日野自動車	80,600	1,311.00	105,666,600	
三菱自動車工業	206,000	794.00	163,564,000	
エフテック	5,000	1,734.00	8,670,000	貸付株式数 1,200株
武蔵精密工業	6,900	3,215.00	22,183,500	貸付株式数 1,800株
日産車体	23,900	1,232.00	29,444,800	
新明和工業	22,700	969.00	21,996,300	
極東開発工業	11,800	1,779.00	20,992,200	

日信工業	12,000	1,900.00	22,800,000	貸付株式数	3,600株 (3,600株)
トピー工業	4,700	3,675.00	17,272,500		
ティラド	25,000	432.00	10,800,000		
曙ブレーキ	29,200	351.00	10,249,200		
タチエス	9,800	1,910.00	18,718,000		
N O K	26,700	2,449.00	65,388,300		
フタバ産業	18,900	1,077.00	20,355,300		
KYB	64,000	613.00	39,232,000		
市光工業	15,000	684.00	10,260,000	貸付株式数	3,000株
大同メタル工業	7,400	964.00	7,133,600		
プレス工業	30,100	574.00	17,277,400		
太平洋工業	13,400	1,381.00	18,505,400		
ケーヒン	11,600	1,801.00	20,891,600		
河西工業	8,500	1,610.00	13,685,000		
アイシン精機	51,400	5,650.00	290,410,000		
マツダ	175,600	1,559.00	273,760,400		
今仙電機製作所	8,100	1,263.00	10,230,300		
本田技研	502,000	3,079.00	1,545,658,000		
スズキ	111,300	5,698.00	634,187,400		
SUBARU	173,800	3,842.00	667,739,600		
ヤマハ発動機	79,200	3,090.00	244,728,000	貸付株式数	22,000株
ショーワ	15,900	1,246.00	19,811,400		
小糸製作所	33,600	6,940.00	233,184,000		
TBK	20,000	493.00	9,860,000		
エクセディ	7,600	3,265.00	24,814,000		
ミツバ	10,600	1,553.00	16,461,800		
豊田合成	17,100	2,544.00	43,502,400		
愛三工業	10,000	973.00	9,730,000		
ヨロズ	5,200	2,228.00	11,585,600		
エフ・シー・シー	9,200	2,450.00	22,540,000		
シマノ	22,600	14,590.00	329,734,000	貸付株式数	6,300株
テイ・エス テック	12,500	3,400.00	42,500,000		
ジャムコ	3,500	2,458.00	8,603,000	貸付株式数	1,100株 (900株)
小野建	5,500	1,811.00	9,960,500		
ノジマ	9,200	2,087.00	19,200,400		
佐鳥電機	8,500	894.00	7,599,000		
カップ・クリエイト	7,500	1,292.00	9,690,000		
伯東	5,300	1,516.00	8,034,800		
コンドーテック	7,700	1,030.00	7,931,000		
ライトオン	5,700	904.00	5,152,800	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	7,400	2,757.00	20,401,800		
三菱食品	5,500	3,210.00	17,655,000		
良品計画	7,400	31,550.00	233,470,000		
松田産業	4,600	1,571.00	7,226,600		
第一興商	8,900	5,340.00	47,526,000		
メディパルHD	55,100	1,903.00	104,855,300		
アドヴァン	6,900	930.00	6,417,000	貸付株式数	1,900株

				(600株)
萩原電気	3,500	2,465.00	8,627,500	
アルビス	2,200	4,070.00	8,954,000	貸付株式数 500株 (100株)
アズワン	4,200	5,970.00	25,074,000	
シモジマ	4,900	1,109.00	5,434,100	
ドウシシャ	6,800	2,281.00	15,510,800	
小津産業	4,000	2,111.00	8,444,000	
コナカ	12,000	587.00	7,044,000	
コーナン商事	7,600	2,022.00	15,367,200	
黒田電気	7,300	1,920.00	14,016,000	
ネットワンシステムズ	25,800	1,093.00	28,199,400	
ワタミ	7,200	1,521.00	10,951,200	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	36,000	4,275.00	153,900,000	
丸文	5,800	792.00	4,593,600	
西松屋チェーン	9,700	1,163.00	11,281,100	貸付株式数 2,600株
ゼンショーホールディングス	29,200	2,049.00	59,830,800	貸付株式数 8,200株
ハピネット	5,800	1,718.00	9,964,400	
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,697.00	11,709,300	貸付株式数 1,900株 (1,600株)
日本ライフライン	6,700	5,720.00	38,324,000	貸付株式数 1,700株
サイゼリヤ	8,600	3,205.00	27,563,000	
エクセル	4,200	1,735.00	7,287,000	
VTホールディングス	19,500	594.00	11,583,000	
マルカキカイ	4,000	1,828.00	7,312,000	
アルゴグラフィックス	3,800	3,100.00	11,780,000	
I DOM	17,000	673.00	11,441,000	貸付株式数 4,600株
ポプラ	10,500	574.00	6,027,000	
ユナイテッドアローズ	7,600	3,820.00	29,032,000	貸付株式数 2,000株
進和	5,400	2,142.00	11,566,800	
ハイデイ日高	6,500	3,140.00	20,410,000	
シークス	3,600	4,485.00	16,146,000	
京都きもの友禅	11,300	930.00	10,509,000	
コロワイド	17,600	1,998.00	35,164,800	貸付株式数 5,100株
壺番屋	3,900	4,530.00	17,667,000	貸付株式数 900株
スギホールディングス	12,100	5,880.00	71,148,000	
島津製作所	71,900	2,089.00	150,199,100	
J M S	22,000	326.00	7,172,000	
ブイ・テクノロジー	1,200	17,940.00	21,528,000	貸付株式数 300株 (300株)
スター精密	10,100	1,802.00	18,200,200	貸付株式数 2,700株
東京計器	29,000	301.00	8,729,000	
東京精密	10,700	3,710.00	39,697,000	
マニー	7,000	2,661.00	18,627,000	貸付株式数 400株
ニコン	96,100	1,801.00	173,076,100	
トプコン	28,400	1,912.00	54,300,800	
オリンパス	89,000	3,800.00	338,200,000	貸付株式数 25,300株 (25,300株)
理研計器	5,900	2,165.00	12,773,500	

SCREENホールディングス	11,500	7,350.00	84,525,000	
キヤノン電子	6,100	2,216.00	13,517,600	
タムロン	4,200	2,051.00	8,614,200	
HOYA	115,000	6,056.00	696,440,000	
ノーリツ鋼機	6,700	1,343.00	8,998,100	
エー・アンド・デイ	13,100	467.00	6,117,700	
キヤノン	299,500	3,767.00	1,128,216,500	
リコー	166,800	1,085.00	180,978,000	
シチズン時計	58,000	759.00	44,022,000	
リズム時計	39,000	240.00	9,360,000	
大研医器	7,100	767.00	5,445,700	貸付株式数 1,400株
メニコン	3,900	4,260.00	16,614,000	
パラマウントベッドHD	5,200	4,815.00	25,038,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ニホンフラッシュ	4,500	1,520.00	6,840,000	
前田工織	7,700	1,632.00	12,566,400	
永大産業	15,000	529.00	7,935,000	
アートネイチャー	8,000	710.00	5,680,000	
ダンロップスポーツ	4,100	1,450.00	5,945,000	
バンダイナムコHLDGS	61,900	3,695.00	228,720,500	
共立印刷	27,100	341.00	9,241,100	
SHOEI	3,200	3,200.00	10,240,000	
フランスベッドHLDGS	4,300	1,023.00	4,398,900	
マーベラス	10,800	935.00	10,098,000	貸付株式数 3,000株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	9,700	4,945.00	47,966,500	貸付株式数 2,500株
萩原工業	2,600	3,245.00	8,437,000	
エイベックス・グループHD	10,500	1,428.00	14,994,000	
トッパン・フォームズ	8,900	1,130.00	10,057,000	
フジシールインターナショナル	12,800	3,235.00	41,408,000	
タカラトミー	22,500	1,411.00	31,747,500	
レック	4,500	3,125.00	14,062,500	貸付株式数 1,100株
大建工業	4,600	2,558.00	11,766,800	
きもと	22,500	233.00	5,242,500	
凸版印刷	153,000	1,103.00	168,759,000	
大日本印刷	154,000	1,296.00	199,584,000	
共同印刷	19,000	353.00	6,707,000	
日本写真印刷	10,100	2,851.00	28,795,100	貸付株式数 2,800株 (2,700株)
光村印刷	29,000	242.00	7,018,000	
藤森工業	4,900	3,845.00	18,840,500	貸付株式数 1,200株
宝印刷	5,700	1,602.00	9,131,400	
前澤化成工業	8,700	1,228.00	10,683,600	
アシックス	55,100	1,622.00	89,372,200	貸付株式数 15,400株
ツツミ	2,000	1,832.00	3,664,000	
ジェイエスピー	3,000	3,280.00	9,840,000	
ニチハ	8,400	4,015.00	33,726,000	
エフピコ	5,300	5,590.00	29,627,000	

ヤマハ	37,800	3,775.00	142,695,000	
河合楽器	3,400	2,240.00	7,616,000	
クリナップ	7,100	878.00	6,233,800	
ピジョン	34,000	3,995.00	135,830,000	
天馬	3,700	2,126.00	7,866,200	
キングジム	8,200	998.00	8,183,600	
リンテック	11,900	2,961.00	35,235,900	
信越ポリマー	12,500	982.00	12,275,000	
東リ	23,600	384.00	9,062,400	
イトーキ	13,500	846.00	11,421,000	貸付株式数 1,300株
任天堂	34,500	35,420.00	1,221,990,000	
三菱鉛筆	9,600	2,875.00	27,600,000	貸付株式数 2,200株
松風	4,400	1,303.00	5,733,200	
タカラスタANDARD	10,600	1,888.00	20,012,800	
コクヨ	26,500	1,757.00	46,560,500	
ナカバヤシ	21,000	328.00	6,888,000	
ニフコ	10,100	6,560.00	66,256,000	貸付株式数 2,800株
グローブライド	3,600	1,941.00	6,987,600	
岡村製作所	19,200	1,095.00	21,024,000	
日本バルカー	5,400	2,689.00	14,520,600	
伊藤忠	405,000	1,753.50	710,167,500	
丸紅	546,100	720.40	393,410,440	
スクロール	12,700	381.00	4,838,700	
高島	32,000	212.00	6,784,000	
ヨンドシーホールディングス	5,700	3,150.00	17,955,000	貸付株式数 1,300株
三陽商会	4,400	1,614.00	7,101,600	
長瀬産業	30,000	1,826.00	54,780,000	
蝶理	4,800	1,995.00	9,576,000	
豊田通商	61,900	3,390.00	209,841,000	
オンワードホールディングス	37,000	799.00	29,563,000	
兼松	121,000	265.00	32,065,000	
美津濃	30,000	656.00	19,680,000	
ユニー・ファミリーマートHD	24,400	5,770.00	140,788,000	貸付株式数 6,800株
三井物産	499,000	1,631.00	813,869,000	
日本紙パルプ	27,000	440.00	11,880,000	
東京エレクトロン	37,500	15,235.00	571,312,500	
日立ハイテクノロジーズ	19,300	3,905.00	75,366,500	
カメイ	7,600	1,624.00	12,342,400	
OUGホールディングス	27,000	280.00	7,560,000	
スターゼン	2,500	5,040.00	12,600,000	
セイコーHD	38,000	477.00	18,126,000	
山善	20,600	1,135.00	23,381,000	
住友商事	344,900	1,551.50	535,112,350	
日本ユニシス	15,700	1,715.00	26,925,500	
内田洋行	3,200	3,385.00	10,832,000	
三菱商事	414,600	2,524.50	1,046,657,700	
第一実業	17,000	591.00	10,047,000	
キヤノンマーケティングJPN	16,000	2,497.00	39,952,000	

西華産業	22,000	515.00	11,330,000		
菱洋エレクトロ	5,200	1,914.00	9,952,800		
ユアサ商事	5,600	3,705.00	20,748,000		
神鋼商事	2,600	3,605.00	9,373,000		
阪和興業	56,000	729.00	40,824,000		
カナデン	8,900	1,129.00	10,048,100		
菱電商事	10,000	789.00	7,890,000		
ニプロ	38,600	1,459.00	56,317,400		
岩谷産業	59,000	649.00	38,291,000		
すてきナイスグループ	45,000	153.00	6,885,000		
兼松エレクトロニクス	3,900	3,065.00	11,953,500		
三愛石油	15,100	1,191.00	17,984,100		
稲畑産業	12,700	1,590.00	20,193,000		
ゴールドウイン	2,600	7,470.00	19,422,000	貸付株式数	700株 (700株)
ユニ・チャーム	118,700	2,569.00	304,940,300	貸付株式数	12,800株
デサント	13,500	1,407.00	18,994,500	貸付株式数	3,500株
ワキタ	12,800	1,296.00	16,588,800		
東邦ホールディングス	16,800	2,112.00	35,481,600	貸付株式数	2,300株
サンゲツ	17,700	1,950.00	34,515,000		
ミツウロコグループ	9,500	848.00	8,056,000		
シナネンホールディングス	2,700	2,219.00	5,991,300		
伊藤忠エネクス	10,200	1,126.00	11,485,200	貸付株式数	2,600株
サンリオ	16,400	2,015.00	33,046,000	貸付株式数	4,600株
リョーサン	7,300	4,445.00	32,448,500		
新光商事	6,900	1,843.00	12,716,700		
トーヨー	3,200	2,670.00	8,544,000		
三信電気	6,900	1,584.00	10,929,600		
東陽テクニカ	7,400	1,013.00	7,496,200		
モスフード サービス	7,200	3,485.00	25,092,000	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
加賀電子	5,400	2,840.00	15,336,000		
三益半導体	5,800	1,710.00	9,918,000		
木曾路	6,700	2,802.00	18,773,400		
サトレストランシシステムズ	10,100	933.00	9,423,300	貸付株式数	2,800株 (2,600株)
千趣会	13,600	670.00	9,112,000	貸付株式数	2,600株
ケーヨー	14,500	738.00	10,701,000	貸付株式数	3,500株
上新電機	14,000	1,698.00	23,772,000		
日本瓦斯	10,500	3,490.00	36,645,000	貸付株式数	1,400株
ロイヤルホールディングス	9,600	2,812.00	26,995,200	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
いなげや	6,900	1,825.00	12,592,500		
島忠	13,500	2,818.00	38,043,000	貸付株式数	3,800株
チョダ	6,300	2,759.00	17,381,700		
ライフコーポレーション	4,200	2,769.00	11,629,800	貸付株式数	1,100株
リンガーハット	6,700	2,517.00	16,863,900	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
AOKIホールディングス	9,400	1,442.00	13,554,800		
オークワ	9,000	1,180.00	10,620,000		

コメリ	8,100	3,180.00	25,758,000	貸付株式数	2,300株
青山商事	11,200	3,950.00	44,240,000	貸付株式数	2,900株
しまむら	6,400	13,280.00	84,992,000		
高島屋	91,000	1,016.00	92,456,000		
松屋	13,600	976.00	13,273,600	貸付株式数	3,800株 (3,500株)
エイチ・ツー・オーリテイリング	28,100	1,925.00	54,092,500		
近鉄百貨店	1,500	3,635.00	5,452,500		
丸井グループ	58,800	1,565.00	92,022,000		
クレディセゾン	41,200	1,947.00	80,216,400	貸付株式数	11,500株
アクシアルリテイリング	4,400	4,280.00	18,832,000	貸付株式数	500株
イオン	226,000	1,603.00	362,278,000	貸付株式数	63,400株
イズミ	10,300	5,860.00	60,358,000		
平和堂	10,600	2,459.00	26,065,400	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
フジ	5,900	2,663.00	15,711,700	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ヤオコー	6,000	5,260.00	31,560,000		
ゼビオホールディングス	7,000	2,123.00	14,861,000		
ケーズホールディングス	22,800	2,410.00	54,948,000	貸付株式数	6,600株 (3,000株)
PALTAC	9,300	4,260.00	39,618,000		
新生銀行	523,000	172.00	89,956,000		
あおぞら銀行	346,000	409.00	141,514,000		
三菱UFJフィナンシャルG	4,183,000	656.90	2,747,812,700		
りそなホールディングス	647,200	531.50	343,986,800		
三井住友トラストHD	114,900	3,727.00	428,232,300		
三井住友フィナンシャルG	442,400	4,015.00	1,776,236,000		
第四銀行	63,000	498.00	31,374,000		
北越銀行	6,400	2,465.00	15,776,000		
千葉銀行	213,000	721.00	153,573,000		
群馬銀行	119,200	621.00	74,023,200		
武蔵野銀行	8,000	3,050.00	24,400,000		
千葉興業銀行	17,600	542.00	9,539,200		
筑波銀行	30,700	342.00	10,499,400		
七十七銀行	84,000	503.00	42,252,000		
青森銀行	40,000	410.00	16,400,000	貸付株式数	12,000株 (12,000株)
秋田銀行	32,000	329.00	10,528,000		
山形銀行	27,000	504.00	13,608,000	貸付株式数	8,000株
岩手銀行	2,800	4,190.00	11,732,000	貸付株式数	600株
東邦銀行	43,000	379.00	16,297,000	貸付株式数	1,000株
東北銀行	73,000	150.00	10,950,000		
みちのく銀行	41,000	188.00	7,708,000		
ふくおかフィナンシャルG	220,000	465.00	102,300,000		
静岡銀行	143,000	944.00	134,992,000		
十六銀行	62,000	339.00	21,018,000		
スルガ銀行	56,400	2,250.00	126,900,000	貸付株式数	15,100株
八十二銀行	103,500	643.00	66,550,500		

山梨中央銀行	33,000	418.00	13,794,000	
大垣共立銀行	84,000	291.00	24,444,000	
福井銀行	51,000	272.00	13,872,000	
北國銀行	55,000	460.00	25,300,000	
清水銀行	3,000	3,230.00	9,690,000	
滋賀銀行	43,000	568.00	24,424,000	
南都銀行	6,500	3,025.00	19,662,500	
百五銀行	44,000	449.00	19,756,000	
京都銀行	99,000	996.00	98,604,000	
紀陽銀行	19,500	1,725.00	33,637,500	
三重銀行	3,800	2,485.00	9,443,000	
ほくほくフィナンシャルG	35,100	1,618.00	56,791,800	
広島銀行	160,000	427.00	68,320,000	
山陰合同銀行	30,600	894.00	27,356,400	貸付株式数 8,100株
中国銀行	37,500	1,430.00	53,625,000	
鳥取銀行	6,000	1,695.00	10,170,000	
伊予銀行	78,100	803.00	62,714,300	貸付株式数 21,600株
百十四銀行	52,000	362.00	18,824,000	
四国銀行	45,000	302.00	13,590,000	貸付株式数 1,000株
阿波銀行	45,000	661.00	29,745,000	
大分銀行	29,000	427.00	12,383,000	
宮崎銀行	38,000	368.00	13,984,000	
佐賀銀行	32,000	261.00	8,352,000	
十八銀行	39,000	257.00	10,023,000	
沖縄銀行	5,200	4,255.00	22,126,000	貸付株式数 600株
琉球銀行	11,500	1,604.00	18,446,000	貸付株式数 1,200株
セブン銀行	208,500	403.00	84,025,500	貸付株式数 58,500株
みずほフィナンシャルG	7,486,600	186.10	1,393,256,260	
高知銀行	85,000	120.00	10,200,000	
山口フィナンシャルG	49,000	1,211.00	59,339,000	貸付株式数 13,000株
芙蓉総合リース	6,500	6,630.00	43,095,000	
興銀リース	9,900	2,750.00	27,225,000	
東京センチュリー	11,000	4,665.00	51,315,000	
SBIホールディングス	62,500	1,511.00	94,437,500	貸付株式数 17,300株
日本証券金融	23,800	557.00	13,256,600	
アイフル	99,100	362.00	35,874,200	貸付株式数 27,400株 (300株)
長野銀行	4,600	1,921.00	8,836,600	貸付株式数 800株
名古屋銀行	4,000	4,125.00	16,500,000	貸付株式数 1,200株
北洋銀行	84,800	323.00	27,390,400	
愛知銀行	2,000	6,140.00	12,280,000	
第三銀行	3,500	1,627.00	5,694,500	
中京銀行	2,200	2,301.00	5,062,200	
大光銀行	30,000	230.00	6,900,000	
愛媛銀行	7,100	1,381.00	9,805,100	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
トマト銀行	6,200	1,529.00	9,479,800	
みなと銀行	5,400	1,892.00	10,216,800	
京葉銀行	33,000	468.00	15,444,000	
関西アーバン銀行	8,800	1,279.00	11,255,200	

栃木銀行	31,500	433.00	13,639,500	
北日本銀行	3,100	2,992.00	9,275,200	
東和銀行	119,000	112.00	13,328,000	
福島銀行	108,000	91.00	9,828,000	
大東銀行	45,000	169.00	7,605,000	
リコーリース	4,800	3,795.00	18,216,000	貸付株式数 1,300株
イオンフィナンシャルサービス	35,500	2,300.00	81,650,000	貸付株式数 10,100株 (10,100株)
アコム	116,700	428.00	49,947,600	貸付株式数 32,900株
ジャックス	32,000	543.00	17,376,000	
オリコ	118,000	174.00	20,532,000	貸付株式数 35,700株
日立キャピタル	12,900	2,480.00	31,992,000	
オリックス	390,200	1,717.00	669,973,400	
三菱UFJリース	140,000	541.00	75,740,000	
ジャフコ	9,500	5,010.00	47,595,000	
トモニホールディングス	44,000	477.00	20,988,000	貸付株式数 900株
大和証券G本社	497,000	601.60	298,995,200	
野村ホールディングス	1,128,300	577.70	651,818,910	
岡三証券グループ	44,000	601.00	26,444,000	
丸三証券	17,400	921.00	16,025,400	貸付株式数 5,000株 (300株)
東洋証券	32,000	232.00	7,424,000	
東海東京HD	57,500	606.00	34,845,000	
光世証券	39,000	154.00	6,006,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
水戸証券	28,500	297.00	8,464,500	
いちよし証券	12,500	989.00	12,362,500	
松井証券	27,200	826.00	22,467,200	
SOMPOホールディングス	115,200	4,168.00	480,153,600	
日本取引所グループ	173,400	1,816.00	314,894,400	
マネックスG	56,300	273.00	15,369,900	貸付株式数 16,700株
カブドットコム証券	37,900	324.00	12,279,600	
極東証券	8,000	1,503.00	12,024,000	貸付株式数 2,000株
岩井コスモホールディング	8,000	1,232.00	9,856,000	
藍澤証券	14,800	731.00	10,818,800	貸付株式数 1,000株
フィデアホール	68,800	185.00	12,728,000	貸付株式数 7,600株
池田泉州HD	55,200	406.00	22,411,200	
アニコムホールディングス	4,200	2,974.00	12,490,800	貸付株式数 1,100株
MS&AD	154,200	3,528.00	544,017,600	
SONY FH	53,100	1,708.00	90,694,800	貸付株式数 14,800株
マネーパートナーズGP	10,000	460.00	4,600,000	
第一生命HLDGS	333,200	1,722.00	573,770,400	
東京海上HD	221,900	4,239.00	940,634,100	
イー・ギャランティ	2,700	3,120.00	8,424,000	貸付株式数 700株 (700株)
NECキャピタルソリューション	3,500	2,056.00	7,196,000	
T&Dホールディングス	200,800	1,484.00	297,987,200	
アドバンスクリエイト	3,500	1,944.00	6,804,000	
三井不動産	293,200	2,312.50	678,025,000	

三菱地所	411,400	1,855.50	763,352,700	
平和不動産	11,300	1,835.00	20,735,500	
東京建物	59,000	1,324.00	78,116,000	
ダイビル	14,400	1,137.00	16,372,800	
京阪神ビルディング	12,700	691.00	8,775,700	
住友不動産	133,000	3,227.00	429,191,000	
大京	105,000	216.00	22,680,000	
テーオーシー	19,500	983.00	19,168,500	
東京楽天地	1,400	5,660.00	7,924,000	
レオパレス21	68,700	794.00	54,547,800	
スターツコーポレーション	7,800	2,721.00	21,223,800	
フジ住宅	10,500	790.00	8,295,000	
空港施設	7,600	581.00	4,415,600	
ゴールドクレスト	5,400	2,457.00	13,267,800	
リログループ	30,400	2,376.00	72,230,400	
日神不動産	11,100	666.00	7,392,600	
タカラレーベン	25,200	533.00	13,431,600	貸付株式数 7,100株
サンヨーハウジ名古屋	8,200	1,059.00	8,683,800	
イオンモール	36,000	1,928.00	69,408,000	
ファースト住建	4,000	1,679.00	6,716,000	貸付株式数 900株
東祥	2,100	5,390.00	11,319,000	
トーセイ	10,100	892.00	9,009,200	
エヌ・ティ・ティ都市開発	34,000	1,053.00	35,802,000	
サンフロンティア不動産	7,100	1,085.00	7,703,500	貸付株式数 1,700株 (100株)
エフ・ジェー・ネクスト	8,900	949.00	8,446,100	
グランディハウス	16,000	411.00	6,576,000	
東武鉄道	294,000	597.00	175,518,000	
相鉄ホールディングス	85,000	537.00	45,645,000	
東京急行	149,600	1,582.00	236,667,200	
京浜急行	155,000	1,154.00	178,870,000	
小田急電鉄	88,600	2,102.00	186,237,200	貸付株式数 25,100株
京王電鉄	152,000	903.00	137,256,000	
京成電鉄	41,500	3,030.00	125,745,000	
富士急行	16,000	1,213.00	19,408,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
新京成電鉄	14,000	416.00	5,824,000	
東日本旅客鉄道	108,300	10,030.00	1,086,249,000	
西日本旅客鉄道	53,900	7,904.00	426,025,600	
東海旅客鉄道	46,400	18,750.00	870,000,000	
西武ホールディングス	77,400	1,839.00	142,338,600	貸付株式数 22,100株
鴻池運輸	8,700	1,596.00	13,885,200	
西日本鉄道	61,000	533.00	32,513,000	
ハマキョウレックス	4,100	2,828.00	11,594,800	
サカイ引越センター	2,900	5,620.00	16,298,000	貸付株式数 700株 (100株)
近鉄グループHLDGS	547,000	419.00	229,193,000	貸付株式数 85,000株
阪急阪神HLDGS	70,000	4,120.00	288,400,000	
南海電鉄	116,000	561.00	65,076,000	
京阪ホールディングス	123,000	662.00	81,426,000	

神戸電鉄	22,000	413.00	9,086,000	貸付株式数	5,000株 (5,000株)
名古屋鉄道	199,000	496.00	98,704,000	貸付株式数	57,000株 (57,000株)
山陽電鉄	22,000	579.00	12,738,000		
トランコム	1,800	5,750.00	10,350,000		
日本通運	205,000	739.00	151,495,000		
ヤマトホールディングス	100,200	2,291.00	229,558,200		
山九	74,000	862.00	63,788,000		
日新	28,000	598.00	16,744,000		
丸全昭和運輸	21,000	496.00	10,416,000		
センコーグループHLDGS	26,500	777.00	20,590,500		
トナミホールディングス	15,000	529.00	7,935,000		
ニッコンホールディングス	17,800	2,557.00	45,514,600		
福山通運	30,000	671.00	20,130,000		
セイノーホールディングス	38,800	1,483.00	57,540,400	貸付株式数	1,000株
神奈川中央交通	8,000	727.00	5,816,000		
日立物流	11,300	2,538.00	28,679,400		
丸和運輸機関	1,700	4,590.00	7,803,000	貸付株式数	400株 (400株)
日本郵船	469,000	215.00	100,835,000	貸付株式数	135,000株
商船三井	292,000	332.00	96,944,000		
川崎汽船	208,000	291.00	60,528,000	貸付株式数	71,000株 (71,000株)
NSユナイテッド海運	29,000	223.00	6,467,000		
飯野海運	29,000	479.00	13,891,000	貸付株式数	1,800株
九州旅客鉄道	56,100	3,355.00	188,215,500		
日本航空	97,900	3,690.00	361,251,000		
ANAホールディングス	1,039,000	415.80	432,016,200		
三菱倉庫	34,000	1,340.00	45,560,000		
三井倉庫HOLD	38,000	330.00	12,540,000	貸付株式数	9,000株
住友倉庫	35,000	728.00	25,480,000		
渋沢倉庫	30,000	381.00	11,430,000		
ヤマタネ	5,800	1,840.00	10,672,000		
東陽倉庫	26,200	309.00	8,095,800		
日本トランスシティ	20,000	449.00	8,980,000		
東洋埠頭	50,000	192.00	9,600,000		
上組	66,000	1,247.00	82,302,000		
キューソー流通システム	2,100	3,080.00	6,468,000		
郵船ロジスティクス	4,700	1,000.00	4,700,000		
近鉄エクスプレス	10,200	1,726.00	17,605,200		
東海運	11,500	416.00	4,784,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
内外トランスライン	6,200	1,449.00	8,983,800		
東京放送HD	36,600	2,054.00	75,176,400	貸付株式数	10,200株
日本テレビHLDS	49,500	1,915.00	94,792,500		
テレビ朝日HD	14,900	2,143.00	31,930,700		
スカパーJSA THD	33,200	500.00	16,600,000	貸付株式数	9,200株
テレビ東京HD	5,300	2,351.00	12,460,300	貸付株式数	1,500株 (1,500株)

ワイヤレスゲート	4,700	1,283.00	6,030,100	貸付株式数	1,000株 (800株)
コネクシオ	5,500	1,981.00	10,895,500		
日本通信	56,900	132.00	7,510,800	貸付株式数	17,100株
日本電信電話	442,900	5,199.00	2,302,637,100		
KDDI	537,900	2,936.00	1,579,274,400		
光通信	6,700	13,520.00	90,584,000		
NTTドコモ	405,700	2,519.50	1,022,161,150		
エムティーアイ	10,300	719.00	7,405,700	貸付株式数	100株
GMOインターネット	21,900	1,387.00	30,375,300	貸付株式数	6,100株
カドカワ	16,300	1,297.00	21,141,100		
学研ホールディングス	3,200	3,115.00	9,968,000		
ゼンリン	8,000	3,245.00	25,960,000		
東京電力HD	472,500	447.00	211,207,500	貸付株式数	73,200株
中部電力	184,300	1,405.00	258,941,500		
関西電力	229,400	1,526.50	350,179,100	貸付株式数	64,200株
中国電力	74,400	1,240.00	92,256,000	貸付株式数	21,600株
北陸電力	51,800	1,033.00	53,509,400	貸付株式数	14,500株
東北電力	139,900	1,511.00	211,388,900		
四国電力	50,500	1,393.00	70,346,500		
九州電力	123,100	1,285.00	158,183,500	貸付株式数	34,900株
北海道電力	51,500	812.00	41,818,000		
沖縄電力	9,800	2,451.00	24,019,800		
電源開発	44,200	2,909.00	128,577,800		
イーレックス	8,200	1,038.00	8,511,600	貸付株式数	2,100株
東京瓦斯	602,000	568.10	341,996,200		
大阪瓦斯	544,000	423.90	230,601,600		
東邦瓦斯	137,000	699.00	95,763,000		
北海道瓦斯	26,000	274.00	7,124,000	貸付株式数	5,000株
広島ガス	20,600	353.00	7,271,800		
西部瓦斯	58,000	277.00	16,066,000		
静岡ガス	13,900	867.00	12,051,300		
メタウォーター	3,300	2,997.00	9,890,100	貸付株式数	600株 (600株)
松竹	3,600	15,230.00	54,828,000		
東宝	36,100	3,870.00	139,707,000		
エイチ・アイ・エス	8,700	3,460.00	30,102,000	貸付株式数	2,800株
東映	20,000	1,302.00	26,040,000		
NTTデータ	170,300	1,150.00	195,845,000		
共立メンテナンス	9,500	3,055.00	29,022,500	貸付株式数	2,700株
イチネンホールディングス	7,100	1,442.00	10,238,200		
建設技術研究所	7,200	1,004.00	7,228,800		
アインホールディングス	7,400	8,040.00	59,496,000	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
東京テアトル	60,000	147.00	8,820,000		
タナベ経営	4,300	1,404.00	6,037,200		
ナガワ	1,100	4,075.00	4,482,500		
よみうりランド	15,000	472.00	7,080,000		
東京都競馬	4,300	3,315.00	14,254,500		
常磐興産	5,800	1,830.00	10,614,000		

カナモト	8,400	3,820.00	32,088,000	
東京ドーム	22,600	1,003.00	22,667,800	
DTS	6,300	3,010.00	18,963,000	貸付株式数 2,000株
スクウェア・エニックス・HD	21,400	3,840.00	82,176,000	
シーイーシー	4,400	2,120.00	9,328,000	
カプコン	12,900	2,670.00	34,443,000	貸付株式数 3,600株
西尾レントオール	4,900	3,685.00	18,056,500	
日本空港ビルデング	17,700	3,890.00	68,853,000	
トランス・コスモス	6,800	2,449.00	16,653,200	
乃村工藝社	13,500	2,421.00	32,683,500	貸付株式数 3,000株
ジャステック	5,800	1,310.00	7,598,000	
SCSK	15,500	4,545.00	70,447,500	
藤田観光	2,200	3,430.00	7,546,000	
KNT-CTホールディングス	40,000	219.00	8,760,000	
日本管財	5,200	1,977.00	10,280,400	
トーカイ	2,700	4,725.00	12,757,500	貸付株式数 400株
セコム	60,300	8,000.00	482,400,000	
セントラル警備保障	3,500	2,057.00	7,199,500	貸付株式数 900株 (100株)
アイネス	8,800	1,002.00	8,817,600	
丹青社	12,100	1,254.00	15,173,400	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
メイテック	6,900	4,970.00	34,293,000	貸付株式数 1,800株
TKC	5,200	3,150.00	16,380,000	
アサツー ディ・ケイ	10,000	2,868.00	28,680,000	
富士ソフト	7,500	3,170.00	23,775,000	
応用地質	7,000	1,552.00	10,864,000	
船井総研ホールディング	8,300	3,575.00	29,672,500	
NSD	11,700	1,974.00	23,095,800	
丸紅建材リース	34,000	219.00	7,446,000	
コナミホールディングス	25,300	5,590.00	141,427,000	
学 究 社	5,100	1,548.00	7,894,800	
ベネッセホールディングス	19,800	3,825.00	75,735,000	
イオンディライト	6,500	3,840.00	24,960,000	
福井コンピュータHLDS	2,100	2,877.00	6,041,700	貸付株式数 500株 (500株)
ニチイ学館	11,600	1,173.00	13,606,800	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
ダイセキ	10,200	2,637.00	26,897,400	
日鉄住金物産	4,700	5,900.00	27,730,000	
元気寿司	3,200	2,435.00	7,792,000	貸付株式数 700株
トラスコ中山	11,700	2,538.00	29,694,600	貸付株式数 3,200株
ヤマダ電機	186,500	583.00	108,729,500	貸付株式数 52,400株
オートバックスセブン	18,900	1,804.00	34,095,600	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	9,700	1,552.00	15,054,400	
ニトリホールディングス	24,000	17,310.00	415,440,000	
吉野家ホールディングス	20,300	1,853.00	37,615,900	貸付株式数 5,700株

加藤産業	8,000	3,205.00	25,640,000	
イノテック	9,900	942.00	9,325,800	
イエローハット	5,200	2,906.00	15,111,200	
松屋フーズ	3,100	4,010.00	12,431,000	
JBCCHホールディングス	11,500	985.00	11,327,500	
サガミチェーン	8,500	1,391.00	11,823,500	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
日伝	2,700	4,425.00	11,947,500	
関西スーパーマーケット	6,100	1,371.00	8,363,100	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ミロク情報サービス	6,400	2,441.00	15,622,400	
因幡電機産業	6,500	4,400.00	28,600,000	
王将フードサービス	3,400	4,370.00	14,858,000	貸付株式数 1,000株
プレナス	6,500	2,427.00	15,775,500	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,300	2,191.00	9,421,300	貸付株式数 1,100株
アークス	9,500	2,452.00	23,294,000	
バローホールディングス	11,200	2,342.00	26,230,400	
ミスミグループ本社	64,200	2,783.00	178,668,600	
ベルク	2,800	5,380.00	15,064,000	
大庄	4,300	1,699.00	7,305,700	貸付株式数 1,200株
ファーストリテイリング	9,300	30,720.00	285,696,000	貸付株式数 2,500株
ソフトバンクグループ	248,800	8,520.00	2,119,776,000	
スズケン	25,000	3,930.00	98,250,000	
サンドラッグ	21,100	4,525.00	95,477,500	
サックスバーホールディング	6,900	1,259.00	8,687,100	
ジェコス	5,500	1,219.00	6,704,500	
ベルーナ	14,100	1,070.00	15,087,000	
合計			129,924,539,150	

(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	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		245,695,310
コール・ローン		134,451,228
株式		84,403,845,417
投資証券		2,394,269,980
派生商品評価勘定		5,164,687
未収入金		17,796,046
未収配当金		178,137,991
差入委託証拠金		636,833,562
流動資産合計		88,016,194,221
資産合計		88,016,194,221
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,389,443
未払解約金		133,853,000
流動負債合計		135,242,443
負債合計		135,242,443
純資産の部		
元本等		
元本	※1	39,855,140,897
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		48,025,810,881
元本等合計		87,880,951,778
純資産合計		87,880,951,778
負債純資産合計		88,016,194,221

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 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

	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
1. ※1 期首	平成28年9月8日
期首元本額	40,323,742,556円
期中追加設定元本額	6,008,573,701円
期中一部解約元本額	6,477,175,360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VA	603,705,926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
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
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
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
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
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
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)	234,557,237円
D-I's 外国株式インデックス	1,083,376円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	172,046円
iFree 外国株式インデックス	351,885,678円
iFree 8資産バランス	246,793,552円
DCダイワ外国株式インデッ	23,541,947,617円

クス	
ダイワ・ライフ・バランス30	520,035,841円
ダイワ・ライフ・バランス50	707,330,244円
ダイワ・ライフ・バランス70	557,456,983円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,442,412,215円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	6,396,162円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	16,139,262円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,312,847円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	89,936円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	178,417円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	3,455,756円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	21,688,287円
ダイワ世界バランスファンド40VA	753,674,687円
ダイワ世界バランスファンド60VA	431,180,890円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,000,406,306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
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	473,363,333円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	31,669,595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
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,905,325,880円
ダイワライフスタイル25	21,418,049円
ダイワライフスタイル50	72,275,283円
ダイワライフスタイル75	58,243,598円
計	39,855,140,897円
2. 期末日における受益権の総数	39,855,140,897口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成 29 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	
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	
株式		8,316,627,468
投資証券		175,935,500
合計		8,492,562,968

(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) 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			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数先物取引				
買 建	1,073,056,535	—	1,076,831,779	3,775,244
合計	1,073,056,535	—	1,076,831,779	3,775,244

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1 口当たり情報)

	平成 29 年 9 月 7 日現在
1 口当たり純資産額	2.2050 円
(1 万口当たり純資産額)	(22,050 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 SOLUTIONS INC	2,700	78.540	212,058.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,100	144.730	303,933.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,350	148.600	200,610.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	18,800	29.960	563,248.000	
	ABBOTT LABORATORIES	40,416	51.190	2,068,895.040	
	ARCONIC INC	8,933	24.340	217,429.220	
	VERISK ANALYTICS INC	3,750	81.060	303,975.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	9,300	63.260	588,318.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	6,950	80.580	560,031.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,579	92.470	700,830.130	
	QORVO INC	2,900	73.320	212,628.000	
	AFLAC INC	9,300	81.680	759,624.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	2,750	78.360	215,490.000	
	ADOBE SYSTEMS INC	11,350	153.760	1,745,176.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,500	31.200	171,600.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,500	61.490	153,725.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	8,000	16.450	131,600.000	
	GARMIN LTD	2,900	52.110	151,119.000	
	AETNA INC	7,929	158.760	1,258,808.040	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,050	144.500	729,725.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16,500	136.550	2,253,075.000	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,751	68.920	258,518.920	
	WR BERKLEY CORP	2,100	63.690	133,749.000	
	AUTOZONE INC	670	540.650	362,235.500	
	DOLLAR TREE INC	5,571	82.730	460,888.830	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,900	15.520	324,368.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL	2,650	89.000	235,850.000	
	CELANESE CORP-SERIES A	3,300	97.050	320,265.000	
	DR HORTON INC	7,966	36.100	287,572.600	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,100	35.490	74,529.000	
	DENTSPLY SIRONA INC	5,200	56.940	296,088.000	
	AUTODESK INC	4,550	113.790	517,744.500	
	MOODY'S CORP	4,050	134.240	543,672.000	
	DEVON ENERGY CORP	11,750	32.680	383,990.000	
	ALBEMARLE CORP	2,600	118.660	308,516.000	
	ATMOS ENERGY CORP	2,500	86.730	216,825.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	5,400	42.600	230,040.000	
	CITIGROUP INC	62,823	67.320	4,229,244.360	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,300	108.050	1,112,915.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	11,500	73.300	842,950.000		
ALLEGHANY CORP	350	544.060	190,421.000		
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	182.630	200,893.000		
HESS CORP	6,500	41.040	266,760.000		
DAVITA INC	3,800	57.420	218,196.000		
DANAHER CORP	14,200	84.020	1,193,084.000		
FORTIVE CORP	7,200	64.730	466,056.000		

AVNET INC	2,800	36.840	103,152.000
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	13,500	65.770	887,895.000
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,000	17.030	68,120.000
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,028	15.800	63,642.400
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,900	42.400	546,960.000
BUNGE LTD	3,100	75.600	234,360.000
TE CONNECTIVITY LTD	8,225	79.150	651,008.750
APPLE INC	119,400	161.910	19,332,054.000
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,100	58.860	535,626.000
BOEING CO/THE	13,250	234.620	3,108,715.000
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,465	75.120	260,290.800
BECTON DICKINSON AND CO	5,187	199.230	1,033,406.010
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,000	22.660	135,960.000
LEIDOS HOLDINGS INC	3,300	57.960	191,268.000
CDK GLOBAL INC	2,900	63.450	184,005.000
NISOURCE INC	7,300	26.790	195,567.000
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,350	72.770	243,779.500
CR BARD INC	1,680	320.960	539,212.800
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	24,271	51.270	1,244,374.170
VERIZON COMMUNICATIONS INC	93,904	46.910	4,405,036.640
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	28,750	176.790	5,082,712.500
ANSYS INC	1,900	127.680	242,592.000
H&R BLOCK INC	5,100	26.000	132,600.000
BB&T CORP	18,350	45.070	827,034.500
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	38,050	59.870	2,278,053.500
JPMORGAN CHASE & CO	81,470	90.110	7,341,261.700
T ROWE PRICE GROUP INC	5,600	82.780	463,568.000
CIGNA CORP	5,900	182.100	1,074,390.000
LKQ CORP	6,800	34.830	236,844.000
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,000	127.960	127,960.000
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,000	54.040	270,200.000
CADENCE DESIGN SYS INC	6,400	38.270	244,928.000
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,660	135.100	494,466.000
DOLLAR GENERAL CORP	6,500	75.290	489,385.000
SERVICENOW INC	4,000	114.680	458,720.000
CATERPILLAR INC	13,500	116.980	1,579,230.000
CMS ENERGY CORP	6,400	48.180	308,352.000
MOSAIC CO/THE	7,550	19.740	149,037.000
DELTA AIR LINES INC	4,400	47.390	208,516.000
CORNING INC	21,600	28.580	617,328.000
CISCO SYSTEMS INC	114,100	31.870	3,636,367.000
MORGAN STANLEY	31,800	45.070	1,433,226.000
WABCO HOLDINGS INC	1,250	141.960	177,450.000
MSCI INC	2,000	112.090	224,180.000
LENNOX INTERNATIONAL INC	900	163.250	146,925.000
MIDDLEBY CORP	1,300	120.420	156,546.000
COTY INC-CL A	11,139	16.490	183,682.110
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,100	38.690	158,629.000
BROADCOM LTD	9,152	249.380	2,282,325.760
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,050	135.030	141,781.500
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,000	27.300	54,600.000
ACUITY BRANDS INC	1,000	179.900	179,900.000
ARAMARK	5,850	40.350	236,047.500
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,900	29.020	142,198.000

DTE ENERGY COMPANY	4,150	111.680	463,472.000
CENTENE CORP	4,000	88.320	353,280.000
CBOE HOLDINGS INC	2,400	103.730	248,952.000
CITIZENS FINANCIAL GROUP	11,600	32.770	380,132.000
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,050	58.180	235,629.000
GARTNER INC	2,100	121.340	254,814.000
SPLUNK INC	3,200	67.990	217,568.000
AGCO CORP	1,450	66.750	96,787.500
DOMINION ENERGY INC	14,300	77.990	1,115,257.000
MONSTER BEVERAGE CORP	9,300	56.330	523,869.000
SMITH (A. O.) CORP	3,400	55.530	188,802.000
DEERE & CO	6,350	116.220	737,997.000
GLOBAL PAYMENTS INC	3,600	94.770	341,172.000
TIME WARNER INC	17,633	100.800	1,777,406.400
VMWARE INC-CLASS A	1,650	107.290	177,028.500
NASDAQ INC	2,700	74.190	200,313.000
VAIL RESORTS INC	950	226.300	214,985.000
EAST WEST BANCORP INC	3,400	54.920	186,728.000
TARGA RESOURCES CORP	5,050	45.630	230,431.500
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,500	129.790	194,685.000
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,800	97.500	175,500.000
CONSOLIDATED EDISON INC	7,000	84.050	588,350.000
MEDNAX INC	2,200	42.550	93,610.000
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,400	97.610	234,264.000
TELEFLEX INC	1,000	225.410	225,410.000
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,100	99.090	208,089.000
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,500	58.240	145,600.000
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	1,750	73.400	128,450.000
IDEX CORP	1,800	117.240	211,032.000
COLGATE-PALMOLIVE CO	19,150	71.490	1,369,033.500
ROLLINS INC	2,200	44.430	97,746.000
AMETEK INC	5,225	63.460	331,578.500
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,800	49.820	288,956.000
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,000	91.720	733,760.000
COSTCO WHOLESALE CORP	10,250	158.860	1,628,315.000
SCANA CORP	3,100	60.030	186,093.000
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,350	172.990	233,536.500
WR GRACE & CO	1,600	71.340	114,144.000
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	650	317.880	206,622.000
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,600	22.840	173,584.000
UGI CORP	3,900	48.520	189,228.000
CUMMINS INC	3,700	159.480	590,076.000
ACTIVISION BLIZZARD INC	16,700	64.000	1,068,800.000
SABRE CORP	4,600	17.870	82,202.000
CDW CORP/DE	3,750	59.860	224,475.000
SIGNATURE BANK	1,300	125.860	163,618.000
COSTAR GROUP INC	750	281.470	211,102.500
SVB FINANCIAL GROUP	1,200	167.840	201,408.000
AMERCO	170	379.690	64,547.300
MERCADOLIBRE INC	1,000	257.880	257,880.000
HANESBRANDS INC	8,500	25.230	214,455.000
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,800	101.490	182,682.000
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,566	63.670	290,717.220
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,600	32.720	150,512.000

DEXCOM INC	1,900	75.130	142,747.000
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,050	92.660	189,953.000
SEATTLE GENETICS INC	2,250	51.900	116,775.000
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,700	176.630	300,271.000
TRANSDIGM GROUP INC	1,200	250.430	300,516.000
NIELSEN HOLDINGS PLC	8,000	38.980	311,840.000
KINDER MORGAN INC	46,081	19.330	890,745.730
HCA HEALTHCARE INC	6,800	77.280	525,504.000
CABOT OIL & GAS CORP	10,550	26.920	284,006.000
T-MOBILE US INC	6,850	63.790	436,961.500
ZILLOW GROUP INC - C	2,500	38.800	97,000.000
COCA-COLA CO/THE	93,450	45.960	4,294,962.000
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,000	56.470	225,880.000
EATON VANCE CORP	2,500	45.610	114,025.000
FRANKLIN RESOURCES INC	8,200	41.610	341,202.000
CSX CORP	21,400	50.210	1,074,494.000
FLUOR CORP	3,300	38.620	127,446.000
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,350	158.480	372,428.000
EXPEDIA INC	2,875	144.390	415,121.250
AUTOLIV INC	2,000	108.850	217,700.000
AMAZON.COM INC	9,400	967.800	9,097,320.000
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	5,000	25.340	126,700.000
FLOWSERVE CORP	2,900	39.960	115,884.000
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,900	112.230	549,927.000
EXXON MOBIL CORP	97,805	78.780	7,705,077.900
FLIR SYSTEMS INC	3,100	38.140	118,234.000
AES CORP	15,600	11.110	173,316.000
L3 TECHNOLOGIES INC	1,800	181.100	325,980.000
EVEREST RE GROUP LTD	1,000	227.380	227,380.000
EOG RESOURCES INC	13,250	87.850	1,164,012.500
EQT CORP	4,050	62.920	254,826.000
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,900	46.890	182,871.000
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,800	80.720	306,736.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,290	64.710	471,735.900
FORD MOTOR CO	85,323	11.500	981,214.500
TESARO INC	900	129.770	116,793.000
MACY'S INC	6,898	22.170	152,928.660
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,440	21.860	75,198.400
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,687	34.360	195,405.320
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,120	20.630	105,625.600
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	300	105.490	31,647.000
AERCAP HOLDINGS NV	3,800	49.190	186,922.000
FORTINET INC	3,500	37.400	130,900.000
MARKEL CORP	320	1,028.500	329,120.000
NEXTERA ENERGY INC	10,700	148.250	1,586,275.000
FREEMPORT-MCMORAN INC	31,808	15.060	479,028.480
US BANCORP	38,750	50.910	1,972,762.500
UNITED RENTALS INC	1,900	121.160	230,204.000
F5 NETWORKS INC	1,450	116.580	169,041.000
FASTENAL CO	6,500	42.370	275,405.000
FISERV INC	4,950	122.410	605,929.500
GENERAL ELECTRIC CO	199,900	24.920	4,981,508.000
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4,350	57.120	248,472.000
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	6,150	30.440	187,206.000

GENERAL MOTORS CO	31,100	37.670	1,171,537.000
TRIPADVISOR INC	2,750	44.310	121,852.500
GENERAL DYNAMICS CORP	5,900	196.740	1,160,766.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,150	218.830	1,783,464.500
ALPHABET INC-CL A	6,870	942.020	6,471,677.400
ALPHABET INC-CL C	7,217	927.810	6,696,004.770
GENERAL MILLS INC	13,600	54.700	743,920.000
FIRSTENERGY CORP	9,968	32.300	321,966.400
GENUINE PARTS CO	3,500	85.310	298,585.000
IHS MARKIT LTD	9,534	47.350	451,434.900
FIFTH THIRD BANCORP	17,500	25.770	450,975.000
HARRIS CORP	2,750	122.720	337,480.000
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	44.310	132,930.000
HALLIBURTON CO	19,850	41.010	814,048.500
HOME DEPOT INC	27,800	156.560	4,352,368.000
ASSURANT INC	1,400	91.070	127,498.000
HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,600	12.510	307,746.000
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,100	211.600	232,760.000
HERSHEY CO/THE	3,300	105.290	347,457.000
HARLEY-DAVIDSON INC	4,000	46.650	186,600.000
HUMANA INC	3,400	256.880	873,392.000
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,200	112.160	919,712.000
HELMERICH & PAYNE	2,600	46.350	120,510.000
HENRY SCHEIN INC	1,800	172.440	310,392.000
HP INC	38,900	19.370	753,493.000
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	37,700	13.770	519,129.000
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,500	43.170	194,265.000
HOLLYFRONTIER CORP	3,900	31.260	121,914.000
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,100	43.300	90,930.000
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,100	94.730	293,663.000
KRAFT HEINZ CO/THE	13,853	81.330	1,126,664.490
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,550	143.820	2,955,501.000
INTERNATIONAL PAPER CO	8,800	54.880	482,944.000
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,600	63.320	227,952.000
ZOETIS INC	11,400	63.390	722,646.000
INGERSOLL-RAND PLC	5,779	84.390	487,689.810
CHENIERE ENERGY INC	4,700	43.530	204,591.000
ALLEGION PLC	2,200	80.260	176,572.000
LEGGETT & PLATT INC	3,100	46.540	144,274.000
LIBERTY GLOBAL PLC- C	13,723	33.300	456,975.900
WASTE CONNECTIONS INC	6,157	66.000	406,362.000
JUNIPER NETWORKS INC	8,900	27.500	244,750.000
JM SMUCKER CO/THE	2,720	106.210	288,891.200
JOHNSON & JOHNSON	61,950	130.670	8,095,006.500
ABBVIE INC	36,679	77.050	2,826,116.950
HOLOGIC INC	6,550	39.060	255,843.000
KIMBERLY-CLARK CORP	8,150	120.310	980,526.500
KROGER CO	21,700	22.550	489,335.000
KLA-TENCOR CORP	3,650	94.500	344,925.000
LOCKHEED MARTIN CORP	6,000	301.450	1,808,700.000
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,100	140.360	294,756.000
L BRANDS INC	5,600	37.400	209,440.000
LOWE'S COS INC	19,750	77.470	1,530,032.500
ELI LILLY & CO	22,850	80.510	1,839,653.500

LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	6,900	53.470	368,943.000
LAM RESEARCH CORP	3,700	165.010	610,537.000
RANGE RESOURCES CORP	5,700	18.320	104,424.000
JONES LANG LASALLE INC	1,000	119.340	119,340.000
LOEWS CORP	6,500	46.170	300,105.000
LINCOLN NATIONAL CORP	5,149	67.160	345,806.840
MCDONALD' S CORP	18,850	158.220	2,982,447.000
3M CO	13,700	202.050	2,768,085.000
FACEBOOK INC-A	54,650	172.090	9,404,718.500
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,954	74.680	369,964.720
MANPOWERGROUP INC	1,500	110.250	165,375.000
S&P GLOBAL INC	5,950	151.200	899,640.000
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,400	209.110	292,754.000
CONCHO RESOURCES INC	3,450	115.000	396,750.000
ENVISION HEALTHCARE CORP	2,636	48.770	128,557.720
FIRST DATA CORP- CLASS A	8,300	18.210	151,143.000
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	4,300	34.300	147,490.000
PHILLIPS 66	9,950	83.360	829,432.000
MURPHY OIL CORP	3,600	24.510	88,236.000
TECHNIPFMC PLC	10,000	26.240	262,400.000
MGM RESORTS INTERNATIONAL	10,750	33.770	363,027.500
MATTEL INC	7,800	15.690	122,382.000
DXC TECHNOLOGY CO	6,538	84.010	549,257.380
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,650	97.540	258,481.000
MYLAN NV	10,450	32.240	336,908.000
METLIFE INC	21,350	47.950	1,023,732.500
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	10,500	17.610	184,905.000
ARISTA NETWORKS INC	1,100	172.730	190,003.000
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,500	52.860	132,150.000
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,828	85.720	328,136.160
MONSANTO CO	10,056	117.540	1,181,982.240
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	605.470	363,282.000
BAKER HUGHES A GE CO	9,173	34.740	318,670.020
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,950	162.320	478,844.000
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1,940	53.180	103,169.200
MERCK & CO. INC.	62,971	64.000	4,030,144.000
DOWDUPONT INC	53,055	64.870	3,441,677.850
MASCO CORP	7,400	36.800	272,320.000
M & T BANK CORP	3,169	145.160	460,012.040
MICRO FOCUS INTL-SPN ADR	5,177	31.730	164,266.210
MARSH & MCLENNAN COS	11,750	78.970	927,897.500
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,522	101.800	765,739.600
WORKDAY INC-CLASS A	2,950	108.500	320,075.000
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,950	42.650	168,467.500
VANTIV INC - CL A	3,850	70.560	271,656.000
NETAPP INC	6,150	38.850	238,927.500
NIKE INC -CL B	30,550	52.760	1,611,818.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,550	122.440	801,982.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,450	86.120	469,354.000
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,000	76.150	228,450.000
ALLY FINANCIAL INC	10,200	22.560	230,112.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,830	265.270	1,015,984.100
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,200	96.730	599,726.000
NEWMONT MINING CORP	12,000	38.380	460,560.000

MCKESSON CORP	4,950	152.090	752,845.500
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,400	46.560	297,984.000
XYLEM INC	4,200	62.020	260,484.000
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	35,750	118.620	4,240,665.000
NUCOR CORP	7,150	55.310	395,466.500
WESTERN UNION CO	11,346	18.510	210,014.460
NEWELL BRANDS INC	10,892	47.030	512,250.760
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,400	61.620	1,072,188.000
LIBERTY BROADBAND-C	2,550	103.550	264,052.500
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	600	104.950	62,970.000
PAYCHEX INC	7,550	57.200	431,860.000
PATTERSON COS INC	1,900	38.890	73,891.000
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,120	202.280	428,833.600
ALTRIA GROUP INC	44,350	63.270	2,806,024.500
P G & E CORP	12,000	69.680	836,160.000
PFIZER INC	137,563	33.990	4,675,766.370
ALKERMES PLC	3,600	49.810	179,316.000
XCEL ENERGY INC	11,500	49.560	569,940.000
STRYKER CORP	7,850	141.120	1,107,792.000
PARKER HANNIFIN CORP	3,050	160.070	488,213.500
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,900	133.080	519,012.000
POLARIS INDUSTRIES INC	1,400	99.780	139,692.000
PROCTER & GAMBLE CO/THE	58,917	92.720	5,462,784.240
EXELON CORP	21,222	37.550	796,886.100
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,100	145.120	740,112.000
NVR INC	90	2,704.000	243,360.000
CONOCOPHILLIPS	28,250	45.060	1,272,945.000
PEPSICO INC	32,600	116.350	3,793,010.000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,900	100.580	995,742.000
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,050	80.850	327,442.500
ACCENTURE PLC-CL A	14,200	131.120	1,861,904.000
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,950	55.590	108,400.500
PENTAIR PLC	4,005	61.740	247,268.700
QUALCOMM INC	34,350	50.450	1,732,957.500
INVESCO LTD	9,150	32.050	293,257.500
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,700	95.610	162,537.000
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,600	61.290	404,514.000
RAYTHEON COMPANY	6,700	180.250	1,207,675.000
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,050	85.450	175,172.500
RED HAT INC	4,200	106.340	446,628.000
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,830	500.220	915,402.600
REPUBLIC SERVICES INC	5,350	64.470	344,914.500
PRICELINE GROUP INC/THE	1,120	1,842.450	2,063,544.000
ROSS STORES INC	9,000	59.150	532,350.000
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,100	111.630	234,423.000
RESMED INC	3,250	77.660	252,395.000
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,100	107.260	332,506.000
ROBERT HALF INTL INC	2,800	44.390	124,292.000
RALPH LAUREN CORP	1,300	90.550	117,715.000
AUTONATION INC	1,700	44.760	76,092.000
ROCKWELL COLLINS INC	3,813	130.550	497,787.150
REGIONS FINANCIAL CORP	27,435	13.620	373,664.700
CHEVRON CORP	43,668	111.790	4,881,645.720
EDISON INTERNATIONAL	7,500	79.550	596,625.000

TESLA INC	3,050	344.530	1,050,816.500
SYMANTEC CORP	13,900	29.600	411,440.000
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,472	142.530	494,864.160
SYNOPSIS INC	3,400	80.000	272,000.000
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,905	402.500	1,974,262.500
CBRE GROUP INC - A	7,100	35.680	253,328.000
TWITTER INC	14,400	16.830	242,352.000
NAVIENT CORP	7,100	13.800	97,980.000
SOUTHERN CO/THE	23,150	49.280	1,140,832.000
SYSCO CORP	11,850	52.910	626,983.500
TRAVELERS COS INC/THE	6,523	117.730	767,952.790
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,200	56.200	179,840.000
STERICYCLE INC	1,950	70.500	137,475.000
STEEL DYNAMICS INC	5,700	34.160	194,712.000
SCHLUMBERGER LTD	31,652	65.720	2,080,169.440
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,900	44.820	174,798.000
AT&T INC	141,691	36.570	5,181,639.870
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	51.670	175,678.000
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,930	342.960	661,912.800
SEMPRA ENERGY	5,400	117.200	632,880.000
TIFFANY & CO	2,800	93.480	261,744.000
SEAGATE TECHNOLOGY	7,100	32.790	232,809.000
TEXAS INSTRUMENTS INC	22,750	82.070	1,867,092.500
SALESFORCE.COM INC	15,800	95.820	1,513,956.000
SIGNET JEWELERS LTD	1,300	65.670	85,371.000
WESTROCK CO	5,930	56.790	336,764.700
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	21,584	39.620	855,158.080
ANDEAVOR	3,450	99.540	343,413.000
UNION PACIFIC CORP	18,600	105.010	1,953,186.000
MARATHON OIL CORP	19,000	11.730	222,870.000
MARATHON PETROLEUM CORP	11,900	52.370	623,203.000
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,600	109.610	1,929,136.000
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,700	113.810	1,786,817.000
UNUM GROUP	5,400	47.770	257,958.000
SPRINT CORP	17,765	8.130	144,429.450
ANTERO RESOURCES CORP	5,100	19.950	101,745.000
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	3,494	96.250	336,297.500
VOYA FINANCIAL INC	4,500	37.380	168,210.000
AMEREN CORPORATION	5,500	59.470	327,085.000
UNITEDHEALTH GROUP INC	22,176	198.380	4,399,274.880
VERISIGN INC	2,200	102.790	226,138.000
VALERO ENERGY CORP	10,392	68.110	707,799.120
ULTA BEAUTY INC	1,310	228.000	298,680.000
FNF GROUP	5,738	45.770	262,628.260
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,000	107.470	214,940.000
ANTHEM INC	6,050	193.650	1,171,582.500
WALT DISNEY CO/THE	35,950	101.500	3,648,925.000
WELLS FARGO & CO	108,472	49.880	5,410,583.360
FOOT LOCKER INC	3,200	36.700	117,440.000
WASTE MANAGEMENT INC	10,000	76.130	761,300.000
WILLIAMS COS INC	18,700	30.110	563,057.000
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,100	60.020	186,062.000
WHIRLPOOL CORP	1,700	170.200	289,340.000
WAL-MART STORES INC	35,150	80.080	2,814,812.000

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,600	115.630	531,898.000
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	22,100	4.180	92,378.000
WYNN RESORTS LTD	1,950	143.380	279,591.000
XEROX CORP	4,811	32.150	154,673.650
WABTEC CORP	1,900	69.700	132,430.000
TJX COMPANIES INC	14,900	73.030	1,088,147.000
WATERS CORP	1,800	183.910	331,038.000
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,800	60.330	108,594.000
ALLERGAN PLC	7,807	223.610	1,745,723.270
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,100	81.760	1,725,136.000
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,033	147.620	447,731.460
WESTERN DIGITAL CORP	6,850	89.560	613,486.000
WEC ENERGY GROUP INC	7,430	65.580	487,259.400
WESTAR ENERGY INC	3,200	50.430	161,376.000
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,750	45.900	539,325.000
VISA INC-CLASS A SHARES	42,550	103.180	4,390,309.000
PPL CORP	15,400	39.120	602,448.000
PULTEGROUP INC	6,700	25.630	171,721.000
PPG INDUSTRIES INC	5,950	104.200	619,990.000
NORTHERN TRUST CORP	4,900	86.590	424,291.000
NVIDIA CORP	13,850	165.810	2,296,468.500
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,093	123.560	1,370,651.080
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	9,550	22.960	219,268.000
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4,700	33.790	158,813.000
TYSON FOODS INC-CL A	6,500	64.950	422,175.000
NETFLIX INC	9,900	179.250	1,774,575.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,950	189.410	1,695,219.500
TORCHMARK CORP	2,675	76.050	203,433.750
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,700	94.460	349,502.000
TEXTRON INC	6,350	48.790	309,816.500
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	23,950	26.430	632,998.500
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,300	25.970	267,491.000
NEWS CORP - CLASS A	8,337	13.390	111,632.430
OGE ENERGY CORP	4,700	35.700	167,790.000
OMNICOM GROUP	5,500	73.100	402,050.000
ORACLE CORP	71,183	51.010	3,631,044.830
MASTERCARD INC - A	21,800	132.890	2,897,002.000
ONEOK INC	8,800	56.340	495,792.000
CENTURYLINK INC	12,795	19.000	243,105.000
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,300	229.590	528,057.000
YUM! BRANDS INC	7,900	76.210	602,059.000
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,150	220.380	253,437.000
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,350	88.720	385,932.000
NOBLE ENERGY INC	10,900	25.220	274,898.000
BANK OF AMERICA CORP	228,401	23.410	5,346,867.410
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,100	89.840	368,344.000
NORDSTROM INC	3,000	46.720	140,160.000
AMERICAN EXPRESS CO	17,800	85.230	1,517,094.000
ANALOG DEVICES INC	8,299	82.510	684,750.490
ADVANCED MICRO DEVICES	19,300	12.860	248,198.000
TD AMERITRADE HOLDING CORP	6,000	42.970	257,820.000
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	22,122	59.470	1,315,595.340
ANADARKO PETROLEUM CORP	12,700	42.350	537,845.000
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,150	106.170	440,605.500

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,050	118.820	481,221.000
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,500	26.440	118,980.000
MALLINCKRODT PLC	2,500	36.280	90,700.000
AVERY DENNISON CORP	2,100	93.090	195,489.000
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,750	70.930	975,287.500
EMERSON ELECTRIC CO	15,050	59.910	901,645.500
AON PLC	6,000	140.230	841,380.000
AMGEN INC	16,950	178.380	3,023,541.000
CORE LABORATORIES N.V.	1,000	91.060	91,060.000
COACH INC	6,400	41.520	265,728.000
EATON CORP PLC	10,136	71.330	723,000.880
CELGENE CORP	18,050	140.160	2,529,888.000
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,020	202.520	814,130.400
APPLIED MATERIALS INC	24,500	44.730	1,095,885.000
CIT GROUP INC	3,300	44.580	147,114.000
CIMAREX ENERGY CO	2,100	102.890	216,069.000
CME GROUP INC	7,800	128.420	1,001,676.000
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,844	31.830	281,504.520
ECOLAB INC	5,900	130.890	772,251.000
EQUIFAX INC	2,750	141.390	388,822.500
GAP INC/THE	5,800	25.820	149,756.000
GILEAD SCIENCES INC	30,000	82.950	2,488,500.000
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,398	92.080	404,967.840
HORMEL FOODS CORP	6,850	30.850	211,322.500
STATE STREET CORP	8,793	91.630	805,702.590
SUNTRUST BANKS INC	11,198	53.820	602,676.360
SCHWAB (CHARLES) CORP	27,700	38.930	1,078,361.000
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,450	62.530	715,968.500
CAMPBELL SOUP CO	4,600	47.530	218,638.000
CROWN HOLDINGS INC	3,100	58.110	180,141.000
CARDINAL HEALTH INC	7,150	68.610	490,561.500
FEDEX CORP	5,900	211.910	1,250,269.000
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,954	79.470	870,514.380
FMC CORP	3,200	86.300	276,160.000
FLEX LTD	12,200	16.240	198,128.000
CERNER CORP	7,000	67.630	473,410.000
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,800	139.060	250,308.000
CITRIX SYSTEMS INC	3,650	76.350	278,677.500
INTEL CORP	108,000	35.760	3,862,080.000
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,800	20.550	180,840.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,650	52.770	456,460.500
ILLINOIS TOOL WORKS	7,200	136.900	985,680.000
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,500	5.600	215,600.000
ILLUMINA INC	3,350	207.420	694,857.000
SEALED AIR CORP	4,400	43.440	191,136.000
INTUITIVE SURGICAL INC	870	1,022.370	889,461.900
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,100	111.020	344,162.000
SNAP-ON INC	1,300	145.700	189,410.000
CARMAX INC	4,250	69.080	293,590.000
COMERICA INC	4,000	66.880	267,520.000
INGREDION INC	1,600	123.990	198,384.000
DUKE ENERGY CORP	16,078	86.990	1,398,625.220
TARGET CORP	11,950	58.020	693,339.000
DOVER CORP	3,500	85.960	300,860.000

WW GRAINGER INC	1,300	163.940	213,122.000
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,900	54.490	158,021.000
CINTAS CORP	2,100	133.400	280,140.000
CA INC	7,105	33.070	234,962.350
CONAGRA BRANDS INC	9,500	34.240	325,280.000
CLOROX COMPANY	2,950	136.370	402,291.500
ENTERGY CORP	4,250	78.730	334,602.500
MICROSOFT CORP	167,550	73.400	12,298,170.000
INCYTE CORP	4,100	135.860	557,026.000
CVS HEALTH CORP	23,624	79.880	1,887,085.120
MEDTRONIC PLC	31,538	79.870	2,518,940.060
MICRON TECHNOLOGY INC	24,100	32.250	777,225.000
BLACKROCK INC	2,750	412.190	1,133,522.500
CENTERPOINT ENERGY INC	9,100	29.440	267,904.000
HASBRO INC	2,600	93.660	243,516.000
KELLOGG CO	6,100	67.840	413,824.000
KEYCORP	25,800	16.910	436,278.000
KANSAS CITY SOUTHERN	2,400	103.640	248,736.000
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	35,211	40.590	1,429,214.490
KOHL'S CORP	3,900	42.370	165,243.000
COOPER COS INC/THE	1,100	241.140	265,254.000
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	11,100	11.990	133,089.000
APACHE CORP	8,760	40.130	351,538.800
CHUBB LTD	10,899	137.710	1,500,901.290
ARROW ELECTRONICS INC	2,000	77.230	154,460.000
ALLSTATE CORP	8,350	87.500	730,625.000
EBAY INC	24,200	36.760	889,592.000
PAYPAL HOLDINGS INC	26,150	61.240	1,601,426.000
EASTMAN CHEMICAL CO	3,250	85.070	276,477.500
XILINX INC	5,600	64.110	359,016.000
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	13,910	62.690	872,017.900
DISH NETWORK CORP-A	5,300	57.600	305,280.000
ZIONS BANCORPORATION	4,800	42.610	204,528.000
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,150	108.070	556,560.500
TOLL BROTHERS INC	3,800	38.900	147,820.000
TRIMBLE INC	5,900	38.610	227,799.000
LENNAR CORP-A	4,800	50.050	240,240.000
LEAR CORP	1,550	153.040	237,212.000
E*TRADE FINANCIAL CORP	6,500	40.120	260,780.000
PROGRESSIVE CORP	13,400	44.940	602,196.000
PRAXAIR INC	6,700	131.770	882,859.000
PACCAR INC	7,987	65.240	521,071.880
PVH CORP	1,900	129.110	245,309.000
BIOGEN INC	4,980	317.360	1,580,452.800
IDEXX LABORATORIES INC	2,000	156.870	313,740.000
STARBUCKS CORP	33,100	54.310	1,797,661.000
PERRIGO CO PLC	3,150	78.330	246,739.500
EVERSOURCE ENERGY	7,130	62.610	446,409.300
INTUIT INC	5,600	141.140	790,384.000
BORGWARNER INC	4,800	46.420	222,816.000
BEST BUY CO INC	6,500	55.660	361,790.000
BALL CORP	7,584	40.000	303,360.000
BOSTON SCIENTIFIC CORP	31,047	28.220	876,146.340
BED BATH & BEYOND INC	3,600	27.890	100,404.000

	XL GROUP LTD	6,100	38.450	234,545.000
	ELECTRONIC ARTS INC	7,100	117.000	830,700.000
	VULCAN MATERIALS CO	3,050	119.050	363,102.500
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,650	157.080	887,502.000
	VF CORP	8,150	63.370	516,465.500
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	8,771	61.980	543,626.580
	VIACOM INC-CLASS B	8,171	28.220	230,585.620
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,500	255.560	383,340.000
	VCA INC	1,900	92.970	176,643.000
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,300	15.910	100,233.000
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,200	106.730	234,806.000
	CARNIVAL CORP	8,050	66.960	539,028.000
	COMCAST CORP-CLASS A	108,540	41.170	4,468,591.800
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	5,200	44.050	229,060.000
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,800	65.330	313,584.000
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	26,500	7.270	192,655.000
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 495,975,558.680 (54,155,571,252)
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド
	MERLIN ENTERTAINMENT	16,300	4.615	75,224.500
	TUI AG-DI	10,247	13.080	134,030.760
	BP PLC	464,600	4.467	2,075,600.500
	UNILEVER PLC	30,060	44.970	1,351,798.200
	BARCLAYS PLC	395,500	1.858	735,036.750
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	38,400	8.920	342,528.000
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	38,100	3.250	123,825.000
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,150	80.200	172,430.000
	PRUDENTIAL PLC	61,300	17.610	1,079,493.000
	INMARSAT PLC	10,300	6.630	68,289.000
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	83,891	2.446	205,197.380
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,564	28.340	129,343.760
	BAE SYSTEMS PLC	74,800	5.940	444,312.000
	AVIVA PLC	97,166	5.065	492,145.790
	GLAXOSMITHKLINE PLC	116,102	15.060	1,748,496.120
	WORLDPAY GROUP PLC	47,100	4.110	193,581.000
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	8,000	7.465	59,720.000
	AUTO TRADER GROUP PLC	22,400	3.582	80,236.800
	DCC PLC	2,000	72.200	144,400.000
	CONVATEC GROUP PLC	33,000	2.711	89,463.000
	ROYAL MAIL PLC	22,400	3.823	85,635.200
	RELX PLC	24,846	16.620	412,940.520
	DIAGEO PLC	58,600	25.650	1,503,090.000
	RIO TINTO PLC	29,250	37.010	1,082,542.500
	STANDARD CHARTERED PLC	78,400	7.493	587,451.200
	TESCO PLC	191,100	1.860	355,446.000
	FRESNILLO PLC	5,000	16.080	80,400.000
	SMITH & NEPHEW PLC	20,300	13.840	280,952.000
	GLENCORE PLC	285,125	3.658	1,042,987.250
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	6,500	13.790	89,635.000
	SMITHS GROUP PLC	9,333	15.440	144,101.520
	BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	8.170	49,837.000
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	31,083	3.716	115,504.420

DIXONS CARPHONE PLC	24,800	1.726	42,804.800
PEARSON PLC	18,863	5.990	112,989.370
SAINSBURY (J) PLC	38,125	2.370	90,356.250
NEXT PLC	3,300	43.740	144,342.000
TAYLOR WIMPEY PLC	73,900	1.954	144,400.600
WHITBREAD PLC	4,311	37.400	161,231.400
IMI PLC	6,650	11.240	74,746.000
BUNZL PLC	7,755	22.600	175,263.000
GKN PLC	40,600	3.212	130,407.200
VODAFONE GROUP PLC	623,683	2.154	1,343,725.020
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,993	38.290	114,601.970
KINGFISHER PLC	51,911	2.973	154,331.400
WPP PLC	29,800	14.030	418,094.000
UNITED UTILITIES GROUP PLC	15,927	9.115	145,174.600
SEVERN TRENT PLC	5,733	22.770	130,540.410
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	15,800	71.390	1,127,962.000
ST JAMES' S PLACE PLC	11,900	11.270	134,113.000
SCHRODERS PLC	2,800	32.840	91,952.000
TATE & LYLE PLC	11,400	6.600	75,240.000
SSE PLC	23,900	14.300	341,770.000
WEIR GROUP PLC/THE	5,400	18.390	99,306.000
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,700	5.955	135,178.500
ASTRAZENECA PLC	29,650	45.765	1,356,932.250
FERGUSON PLC	5,965	45.300	270,214.500
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	138,100	2.543	351,188.300
3I GROUP PLC	22,991	9.360	215,195.760
SKY PLC	24,500	9.535	233,607.500
ASHTED GROUP PLC	11,400	16.570	188,898.000
SAGE GROUP PLC/THE	24,214	6.820	165,139.480
NATIONAL GRID PLC	80,234	9.704	778,590.730
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,698,965	0.630	1,071,197.430
RSA INSURANCE GROUP PLC	24,260	6.490	157,447.400
IMPERIAL BRANDS PLC	22,750	32.100	730,275.000
CENTRICA PLC	128,360	1.968	252,612.480
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,000	36.570	109,710.000
PROVIDENT FINANCIAL PLC	3,650	7.900	28,835.000
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	53,660	48.120	2,582,119.200
BHP BILLITON PLC	49,577	14.845	735,970.560
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,600	32.830	282,338.000
HSBC HOLDINGS PLC	472,400	7.289	3,443,323.600
SHIRE PLC	21,574	39.560	853,467.440
OLD MUTUAL PLC	117,025	2.011	235,337.270
ANGLO AMERICAN PLC	31,883	14.155	451,303.860
MONDI PLC	8,300	20.380	169,154.000
WM MORRISON SUPERMARKETS	50,900	2.463	125,366.700
CARNIVAL PLC	4,511	51.050	230,286.550
EASYJET PLC	3,500	11.510	40,285.000
COMPASS GROUP PLC	37,389	16.250	607,571.250
PERSIMMON PLC	7,050	25.610	180,550.500
BT GROUP PLC	196,600	2.854	561,096.400
COCA-COLA HBC AG-DI	4,400	26.350	115,940.000
BURBERRY GROUP PLC	10,489	17.600	184,606.400
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,286	37.490	160,682.140
CAPITA PLC	15,090	6.440	97,179.600

	TRAVIS PERKINS PLC	5,900	15.030	88,677.000	
	INTERTEK GROUP PLC	3,800	49.710	188,898.000	
	ITV PLC	86,800	1.594	138,359.200	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	7,599	38.550	292,941.450	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	105,600	21.335	2,252,976.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	87,218	21.690	1,891,758.420	
	MEGGITT PLC	17,700	5.065	89,650.500	
	G4S PLC	34,600	2.760	95,496.000	
	COBHAM PLC	55,600	1.363	75,782.800	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,300	11.880	39,204.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	4,500	18.750	84,375.000	
	INVESTEC PLC	16,000	5.840	93,440.000	
	ANTOFAGASTA PLC	9,800	10.420	102,116.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	64,957	4.177	271,325.380	
	EXPERIAN PLC	22,054	15.200	335,220.800	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 43,970,846.540 (6,265,405,924)	
イスラエル・シ ケル		株	イスラエル・シケル	イスラエル・シケル	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	196.000	196,000.000	
	FRUTAROM	900	269.600	242,640.000	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	56,400	5.190	292,716.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	15.600	218,400.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	496.800	298,080.000	
	BANK HAPOALIM BM	26,500	24.000	636,000.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	33,400	18.250	609,550.000	
	NICE LTD	1,400	276.700	387,380.000	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,000	64.300	192,900.000		
イスラエル・シケル 小計				イスラエル・シケル 3,073,666.000 (94,515,230)	
オーストラリ ア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	HEALTHSCOPE LTD	37,500	1.675	62,812.500	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	61,700	3.000	185,100.000	
	BHP BILLITON LIMITED	74,700	27.730	2,071,431.000	
	SOUTH32 LTD	127,200	3.080	391,776.000	
	ALUMINA LTD	56,900	2.140	121,766.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,300	28.930	529,419.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	35,500	5.960	211,580.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	11.370	134,166.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	62,600	30.150	1,887,390.000	
	WESTPAC BANKING CORP	78,498	30.950	2,429,513.100	
	SANTOS LTD	42,800	3.900	166,920.000	
	AUSNET SERVICES	41,000	1.710	70,110.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	68,400	29.200	1,997,280.000	
	RIO TINTO LTD	10,000	68.250	682,500.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	41,400	7.750	320,850.000	
	AMCOR LIMITED	28,100	15.520	436,112.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,800	4.940	231,192.000	
	OIL SEARCH LTD	32,900	6.700	220,430.000	
	SEEK LTD	7,500	16.440	123,300.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	17,100	14.390	246,069.000		

NEWCREST MINING LTD	18,600	23.490	436,914.000
INCITEC PIVOT LTD	38,200	3.430	131,026.000
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	40,800	73.700	3,006,960.000
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,000	32.450	194,700.000
ORICA LTD	8,300	20.450	169,735.000
QBE INSURANCE GROUP LTD	32,300	10.100	326,230.000
CIMIC GROUP LTD	2,100	42.230	88,683.000
WOOLWORTHS LTD	30,000	25.760	772,800.000
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	7.990	109,463.000
TABCORP HOLDINGS LTD	20,500	4.080	83,640.000
CROWN RESORTS LTD	9,600	11.580	111,168.000
QANTAS AIRWAYS LTD	10,254	5.710	58,550.340
TELSTRA CORP LTD	98,600	3.620	356,932.000
AMP LTD	71,300	4.980	355,074.000
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	10,300	18.000	185,400.000
MACQUARIE GROUP LTD	7,734	84.000	649,656.000
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,600	21.030	264,978.000
BANK OF QUEENSLAND LTD	9,100	12.800	116,480.000
CSL LTD	10,600	132.280	1,402,168.000
WESFARMERS LTD	26,495	42.250	1,119,413.750
COCHLEAR LTD	1,400	157.300	220,220.000
BLUESCOPE STEEL LTD	13,400	10.870	145,658.000
SUNCORP GROUP LTD	31,400	12.530	393,442.000
BORAL LTD	27,700	6.460	178,942.000
ASX LTD	4,700	53.450	251,215.000
COMPUTERSHARE LTD	10,400	13.860	144,144.000
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	3.860	54,040.000
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	54,900	6.200	340,380.000
SONIC HEALTHCARE LTD	9,500	21.430	203,585.000
CHALLENGER LTD	13,900	12.250	170,275.000
TATTS GROUP LTD	30,500	3.970	121,085.000
AGL ENERGY LTD	15,500	23.710	367,505.000
BRAMBLES LTD	37,300	9.270	345,771.000
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	48.740	68,236.000
RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,300	65.990	217,767.000
TPG TELECOM LTD	6,500	5.390	35,035.000
REA GROUP LTD	1,200	66.650	79,980.000
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,400	42.150	59,010.000
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 25,855,977.690 (2,262,398,048)
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル
IMPERIAL OIL LTD	6,700	37.410	250,647.000
CONSTELLATION SOFTWARE INC	440	680.310	299,336.400
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,696	29.670	139,330.320
RESTAURANT BRANDS INTERN	5,387	74.010	398,691.870
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	10,700	25.210	269,747.000
INTACT FINANCIAL CORP	3,150	101.610	320,071.500
BCE INC	3,430	58.600	200,998.000
FRANCO-NEVADA CORP	4,300	101.340	435,762.000
SUNCOR ENERGY INC	38,830	39.790	1,545,045.700
METRO INC	5,500	39.470	217,085.000
NATIONAL BANK OF CANADA	8,100	56.820	460,242.000
BANK OF NOVA SCOTIA	28,200	76.550	2,158,710.000

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	10,150	104.980	1,065,547.000
TORONTO-DOMINION BANK	43,200	66.560	2,875,392.000
GREAT-WEST LIFE CO INC	6,700	34.400	230,480.000
ROYAL BANK OF CANADA	34,050	90.890	3,094,804.500
TOURMALINE OIL CORP	5,400	24.730	133,542.000
VERMILION ENERGY INC	2,800	41.350	115,780.000
TRANSCANADA CORP	20,650	62.340	1,287,321.000
PEMBINA PIPELINE CORP	9,600	40.280	386,688.000
BOMBARDIER INC-B	45,400	2.430	110,322.000
BARRICK GOLD CORP	27,300	21.830	595,959.000
CAE INC	5,800	20.450	118,610.000
THOMSON REUTERS CORP	6,704	55.710	373,479.840
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	20,300	21.610	438,683.000
EMPIRE CO LTD 'A'	3,900	19.310	75,309.000
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,400	64.300	90,020.000
VERESEN INC	8,000	17.640	141,120.000
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,450	56.930	196,408.500
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	9,700	8.960	86,912.000
LINAMAR CORP	1,100	70.620	77,682.000
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	5,400	19.110	103,194.000
HYDRO ONE LTD	7,200	23.100	166,320.000
LOBLAW COMPANIES LTD	5,160	65.330	337,102.800
EMERA INC	1,300	47.730	62,049.000
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,800	39.000	109,200.000
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,600	63.960	550,056.000
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,200	61.780	321,256.000
KINROSS GOLD CORP	29,500	5.700	168,150.000
BANK OF MONTREAL	15,400	89.000	1,370,600.000
POWER CORP OF CANADA	8,700	30.690	267,003.000
METHANEX CORP	2,200	61.870	136,114.000
SHOPIFY INC - CLASS A	1,900	134.570	255,683.000
CAMECO CORP	9,200	12.300	113,160.000
TELUS CORP	5,400	44.620	240,948.000
POWER FINANCIAL CORP	6,200	33.840	209,808.000
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,400	29.620	396,908.000
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,600	145.090	232,144.000
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	20,800	4.050	84,240.000
AGRIUM INC	3,300	121.180	399,894.000
CANADIAN NATURAL RESOURCES	26,600	40.020	1,064,532.000
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	640	622.030	398,099.200
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,900	59.220	527,058.000
WESTON (GEORGE) LTD	1,100	105.670	116,237.000
BLACKBERRY LTD	11,900	11.060	131,614.000
SUN LIFE FINANCIAL INC	14,250	46.830	667,327.500
ENBRIDGE INC	38,700	49.900	1,931,130.000
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	20,750	47.570	987,077.500
MANULIFE FINANCIAL CORP	47,000	23.920	1,124,240.000
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	7,100	16.080	114,168.000
GOLDCORP INC	19,959	16.920	337,706.280
ENCANA CORP	23,100	11.630	268,653.000
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,400	193.080	656,472.000
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,500	52.600	131,500.000
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,200	38.540	200,408.000
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,950	99.220	1,780,999.000

	CGI GROUP INC - CLASS A	5,000	62.970	314,850.000	
	HUSKY ENERGY INC	7,558	14.670	110,875.860	
	ONEX CORPORATION	2,000	96.180	192,360.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	9,500	27.580	262,010.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	3,900	27.940	108,966.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	4,200	53.540	224,868.000	
	IGM FINANCIAL INC	2,300	40.610	93,403.000	
	OPEN TEXT CORP	6,200	39.110	242,482.000	
	CI FINANCIAL CORP	6,400	27.290	174,656.000	
	SAPUTO INC	4,800	42.350	203,280.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	15,800	14.420	227,836.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,800	61.030	598,094.000	
	YAMANA GOLD INC	23,300	3.730	86,909.000	
	FORTIS INC	9,900	45.330	448,767.000	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	13,300	8.750	116,375.000	
	CENOVUS ENERGY INC	24,000	10.290	246,960.000	
	DOLLARAMA INC	2,500	121.760	304,400.000	
	ATCO LTD -CLASS I	1,700	45.260	76,942.000	
	ALTAGAS LTD	3,900	27.550	107,445.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	3,800	20.010	76,038.000	
	KEYERA CORP	4,400	35.850	157,740.000	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,900	20.930	81,627.000	
	INTER PIPELINE LTD	8,800	23.120	203,456.000	
	ARC RESOURCES LTD	8,300	16.530	137,199.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 38,948,316.770 (3,474,968,822)	
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	31,300	23.500	735,550.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	41,500	20.450	848,675.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,470	10.230	127,568.100	
	KEPPEL CORP LTD	34,500	6.300	217,350.000	
	UOL GROUP LTD	13,200	8.050	106,260.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	11,200	11.580	129,696.000	
	CAPITALAND LTD	59,000	3.700	218,300.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	42,000	1.435	60,270.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	2.730	111,930.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,300	39.590	91,057.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	74,200	10.960	813,232.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	153,000	1.150	175,950.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	188,650	3.690	696,118.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	35,000	3.590	125,650.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	22,700	2.970	67,419.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.390	64,116.000	
	SATS LTD	16,000	4.750	76,000.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	19,000	7.460	141,740.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,800	2.190	102,492.000	
	STARHUB LTD	16,000	2.630	42,080.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	48,500	3.270	158,595.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	69,000	3.260	224,940.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 5,334,988.600 (431,867,328)	

スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン
	DUFREY AG-REG	850	146.500	124,525.000
	UBS GROUP AG-REG	85,500	15.560	1,330,380.000
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	200	641.000	128,200.000
	ADECCO GROUP AG-REG	3,950	69.700	275,315.000
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	16,550	242.600	4,015,030.000
	PARGESA HOLDING SA-BR	950	77.550	73,672.500
	SIKA AG-BR	50	6,800.000	340,000.000
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	66,050.000	132,100.000
	ABB LTD-REG	47,300	22.730	1,075,129.000
	SWISS RE AG	7,550	83.750	632,312.500
	NESTLE SA-REG	72,550	80.550	5,843,902.500
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	420	610.500	256,410.000
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	910	204.500	186,095.000
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	57,620	14.010	807,256.200
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,200	53.350	277,420.000
	SGS SA-REG	130	2,176.000	282,880.000
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	500	199.900	99,950.000
	VIFOR PHARMA AG	1,200	101.500	121,800.000
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	750	375.400	281,550.000
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,522	280.500	987,921.000
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,200	147.800	177,360.000
	NOVARTIS AG-REG	52,400	80.100	4,197,240.000
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	50	1,385.000	69,250.000
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	12,200	86.100	1,050,420.000
	SWISSCOM AG-REG	630	475.100	299,313.000
	GEBERIT AG-REG	890	438.500	390,265.000
	GIVAUDAN-REG	220	1,973.000	434,060.000
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	220	605.000	133,100.000
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,200	164.200	197,040.000
	LONZA GROUP AG-REG	1,750	242.500	424,375.000
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,300	72.800	94,640.000
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	10,890	55.950	609,295.500
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	770	335.400	258,258.000
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,250	171.000	213,750.000
	SWISS PRIME SITE-REG	1,650	85.700	141,405.000
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	5,445.000	125,235.000
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 26,086,855.200 (2,979,118,864)
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	315.700	599,830.000
	ERICSSON LM-B SHS	71,030	45.780	3,251,753.400
	VOLVO AB-B SHS	36,800	145.100	5,339,680.000
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,500	510.000	765,000.000
	SKF AB-B SHARES	8,750	155.500	1,360,625.000
	ELECTROLUX AB-SER B	5,450	277.800	1,514,010.000
	NORDEA BANK AB	70,850	104.800	7,425,080.000
	SWEDISH MATCH AB	4,550	280.800	1,277,640.000
	TELE2 AB-B SHS	8,950	91.050	814,897.500
	GETINGE AB-B SHS	5,600	142.900	800,240.000
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	36,150	100.100	3,618,615.000
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	35,200	115.700	4,072,640.000

	SWEDBANK AB - A SHARES	20,900	210.700	4,403,630.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	22,700	199.800	4,535,460.000	
	SKANSKA AB-B SHS	7,650	176.800	1,352,520.000	
	SANDVIK AB	26,250	133.800	3,512,250.000	
	INVESTOR AB-B SHS	10,900	366.400	3,993,760.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,700	313.100	4,915,670.000	
	SECURITAS AB-B SHS	7,400	126.700	937,580.000	
	TELIA CO AB	60,000	37.570	2,254,200.000	
	ALFA LAVAL AB	7,000	181.200	1,268,400.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	286.100	2,603,510.000	
	ASSA ABLOY AB-B	23,300	174.300	4,061,190.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	900	611.500	550,350.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	4,200	179.600	754,320.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	14,100	221.600	3,124,560.000	
	BOLIDEN AB	6,500	279.700	1,818,050.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	9,750	79.200	772,200.000	
	KINNEVIK AB - B	5,300	236.700	1,254,510.000	
	HEXAGON AB-B SHS	6,200	386.300	2,395,060.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,000	192.600	770,400.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 76,117,630.900 (1,043,572,720)	
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	43,800	299.000	13,096,200.000	
	DANSKE BANK A/S	17,550	237.300	4,164,615.000	
	ISS A/S	3,900	242.000	943,800.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	85	11,610.000	986,850.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	402.100	683,570.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,200	565.000	2,938,000.000	
	TDC A/S	19,300	36.220	699,046.000	
	CARLSBERG AS-B	2,450	716.500	1,755,425.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,500	312.600	1,719,300.000	
	COLOPLAST-B	2,800	508.000	1,422,400.000	
	DSV A/S	4,250	443.800	1,886,150.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,675	164.400	439,770.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	150	12,140.000	1,821,000.000	
	TRYG A/S	2,500	141.700	354,250.000	
	PANDORA A/S	2,550	633.500	1,615,425.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,350	543.500	1,277,225.000	
	GENMAB A/S	1,300	1,425.000	1,852,500.000	
	DONG ENERGY A/S	4,100	327.400	1,342,340.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 38,997,866.000 (682,462,655)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	26,000	2.920	75,920.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.850	202,852.650	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	6.400	149,760.000	
	CONTACT ENERGY LTD	13,000	5.420	70,460.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	8.120	163,212.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,800	9.130	80,344.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル	

				742,548.650 (58,460,856)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	30,600	57.000	1,744,200.000	
	DNB ASA	22,550	148.600	3,350,930.000	
	ORKLA ASA	19,050	79.100	1,506,855.000	
	TELENOR ASA	18,000	155.500	2,799,000.000	
	STATOIL ASA	26,973	149.000	4,018,977.000	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,500	190.300	285,450.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,160	332.300	1,382,368.000	
	MARINE HARVEST	9,900	153.100	1,515,690.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,850	133.600	647,960.000	
SCHIBSTED ASA-B SHS	1,800	175.500	315,900.000		
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 17,567,330.000 (245,942,621)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	19,550	108.750	2,126,062.500	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,800	27.700	105,260.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	48,950	13.415	656,664.250	
	COMMERZBANK AG	24,685	10.190	251,540.150	
	VOLKSWAGEN AG	800	135.000	108,000.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	4,300	131.200	564,160.000	
	MAN SE	850	94.640	80,444.000	
	SIEMENS AG-REG	17,950	112.650	2,022,067.500	
	E.ON SE	51,700	9.398	485,876.600	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,800	81.760	637,728.000	
	GEA GROUP AG	4,200	37.030	155,526.000	
	OSRAM LICHT AG	1,910	67.990	129,860.900	
	CONTINENTAL AG	2,550	194.100	494,955.000	
	BASF SE	21,700	83.170	1,804,789.000	
	LINDE AG	4,300	160.800	691,440.000	
	K+S AG-REG	4,400	20.285	89,254.000	
	ALLIANZ SE-REG	10,650	179.450	1,911,142.500	
	THYSSENKRUPP AG	8,500	25.065	213,052.500	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,100	116.200	476,420.000	
	RWE AG	12,500	20.600	257,500.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	5,650	21.800	123,170.000	
	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	900	81.540	73,386.000	
	BRENTAG AG	3,650	44.045	160,764.250	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	9,650	71.240	687,466.000	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,000	50.110	150,330.000	
	HOCHTIEF AG	500	147.050	73,525.000	
	SAP SE	22,992	88.650	2,038,240.800	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,720	169.500	630,540.000	
	SCHAEFFLER AG	3,800	12.020	45,676.000	
	ZALANDO SE	2,600	40.100	104,260.000	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,500	80.920	283,220.000	
KION GROUP AG	1,800	76.050	136,890.000		
COVESTRO AG	2,600	63.660	165,516.000		
INNOGY SE	3,400	36.890	125,426.000		
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,750	50.000	187,500.000		
METRO AG	4,100	16.680	68,388.000		

BEIERSDORF AG	2,300	90.530	208,219.000
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,500	47.150	70,725.000
MERCK KGAA	3,100	95.090	294,779.000
ADIDAS AG	4,410	191.250	843,412.500
HENKEL AG & CO KGAA	2,400	103.600	248,640.000
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	77,300	15.000	1,159,500.000
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,050	79.030	399,101.500
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	22,500	64.400	1,449,000.000
QIAGEN N.V.	5,248	26.740	140,331.520
INFINEON TECHNOLOGIES AG	26,200	19.805	518,891.000
HANNOVER RUECK SE	1,400	97.570	136,598.000
DEUTSCHE POST AG-REG	23,200	34.995	811,884.000
DEUTSCHE BOERSE AG	4,450	92.670	412,381.500
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	5,550	28.210	156,565.500
LANXESS AG	2,200	62.270	136,994.000
AXEL SPRINGER SE	1,200	51.470	61,764.000
DEUTSCHE WOHNEN SE	8,400	35.000	294,000.000
SYMRISE AG	3,000	61.850	185,550.000
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,500	4.482	73,953.000
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,200	72.710	87,252.000
HUGO BOSS AG -ORD	1,450	74.010	107,314.500
RTL GROUP	1,000	62.550	62,550.000
VONOVIA SE	10,900	35.550	387,495.000
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,976	32.650	717,516.400
NN GROUP NV	7,500	32.680	245,100.000
ARCELORMITTAL	15,600	22.455	350,298.000
UNILEVER NV-CVA	37,950	50.300	1,908,885.000
HEINEKEN NV	5,500	87.370	480,535.000
RELX NV	22,719	17.560	398,945.640
AEGON NV	40,744	4.690	191,089.360
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	29,483	15.160	446,962.280
AKZO NOBEL	5,800	78.870	457,446.000
KONINKLIJKE DSM NV	4,350	64.530	280,705.500
WOLTERS KLUWER	6,900	37.295	257,335.500
BOSKALIS WESTMINSTER	2,100	27.945	58,684.500
ING GROEP NV	90,350	14.615	1,320,465.250
KONINKLIJKE KPN NV	78,250	2.925	228,881.250
ASML HOLDING NV	8,750	131.150	1,147,562.500
ABN AMRO GROUP NV-CVA	8,800	22.745	200,156.000
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,200	36.750	191,100.000
VOPAK	1,600	35.550	56,880.000
RANDSTAD HOLDING NV	2,850	49.700	141,645.000
HEINEKEN HOLDING NV	2,300	82.590	189,957.000
GEMALTO	2,000	39.465	78,930.000
ALTICE NV - A	11,500	18.750	215,625.000
ALTICE NV - B	2,100	18.720	39,312.000
JCDECAUX SA	1,600	28.425	45,480.000
TOTAL SA	55,650	44.030	2,450,269.500
MICHELIN (CGDE)	4,050	116.450	471,622.500
AIR LIQUIDE SA	9,048	103.000	931,944.000
KERING	1,800	315.500	567,900.000
SCHNEIDER ELECTRIC SE	13,200	69.200	913,440.000
BOUYGUES SA	5,000	38.830	194,150.000
BNP PARIBAS	26,550	62.590	1,661,764.500

PEUGEOT SA	12,350	18.555	229,154.250
NATIXIS	22,950	6.317	144,975.150
THALES SA	2,550	93.010	237,175.500
DANONE	13,850	66.880	926,288.000
CARREFOUR SA	12,800	16.810	215,168.000
SUEZ	8,875	16.080	142,710.000
VIVENDI	23,741	20.115	477,550.210
L'OREAL	5,850	177.700	1,039,545.000
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	11,500	46.470	534,405.000
LEGRAND SA	6,067	58.210	353,160.070
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,300	48.620	63,206.000
PERNOD RICARD SA	4,917	114.850	564,717.450
SOCIETE BIC SA	700	101.100	70,770.000
EURAZEO SA	1,116	69.670	77,751.720
REXEL SA	7,050	13.250	93,412.500
SOCIETE GENERALE SA	18,000	46.180	831,240.000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,590	217.900	1,435,961.000
ACCOR SA	4,400	39.660	174,504.000
CAPGEMINI SE	3,750	93.250	349,687.500
VALEO SA	5,650	57.730	326,174.500
PUBLICIS GROUPE	4,750	56.600	268,850.000
BUREAU VERITAS SA	6,050	20.200	122,210.000
EIFFAGE	1,700	86.680	147,356.000
SODEXO SA	2,150	99.170	213,215.500
IPSEN	900	115.100	103,590.000
INGENICO GROUP	1,350	80.360	108,486.000
ZODIAC AEROSPACE	4,800	24.285	116,568.000
EUROFINS SCIENTIFIC	270	481.800	130,086.000
SEB SA	500	149.400	74,700.000
ESSILOR INTERNATIONAL	4,950	105.950	524,452.500
DASSAULT AVIATION SA	60	1,264.700	75,882.000
AXA SA	45,500	23.960	1,090,180.000
LAGARDERE SCA	2,650	26.910	71,311.500
EDENRED	5,350	22.700	121,445.000
RENAULT SA	4,100	77.150	316,315.000
HERMES INTERNATIONAL	730	442.650	323,134.500
STMICROELECTRONICS NV	15,300	15.080	230,724.000
REMY COINTREAU	550	95.700	52,635.000
ATOS SE	2,150	126.200	271,330.000
DASSAULT SYSTEMES SA	3,050	83.340	254,187.000
WENDEL	600	135.150	81,090.000
ORANGE	46,800	13.890	650,052.000
ALSTOM	3,650	29.840	108,916.000
CNP ASSURANCES	3,750	18.995	71,231.250
SANOFI	27,175	82.380	2,238,676.500
VINCI SA	11,900	79.460	945,574.000
AIRBUS SE	13,550	71.410	967,605.500
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,450	19.755	226,194.750
CREDIT AGRICOLE SA	27,000	14.585	393,795.000
ENGIE	39,573	14.410	570,246.930
IMERYS SA	900	73.690	66,321.000
EDF	12,750	9.663	123,203.250
SES	8,350	18.975	158,441.250
SAFRAN SA	7,200	81.250	585,000.000

ILIAD SA	600	218.250	130,950.000
ARKEMA	1,550	93.100	144,305.000
ADP	750	145.450	109,087.500
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	23.750	96,187.500
SCOR SE	4,150	33.810	140,311.500
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	10,450	10.060	105,127.000
BOLLORE	19,000	3.986	75,734.000
UCB SA	3,000	58.300	174,900.000
KBC GROEP NV	5,800	67.850	393,530.000
COLRUYT SA	1,600	47.105	75,368.000
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,850	85.130	157,490.500
SOLVAY SA	1,700	122.250	207,825.000
UMICORE	2,250	63.860	143,685.000
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	17,780	100.050	1,778,889.000
AGEAS	4,490	38.480	172,775.200
PROXIMUS	3,500	29.035	101,622.500
TELENET GROUP HOLDING NV	1,200	54.990	65,988.000
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	21,750	1.884	40,977.000
PRYSMIAN SPA	4,800	26.670	128,016.000
ASSICURAZIONI GENERALI	29,043	15.080	437,968.440
SAIPEM SPA	13,430	3.280	44,050.400
MEDIOBANCA SPA	13,015	8.440	109,846.600
TENARIS SA	10,550	11.840	124,912.000
UNICREDIT SPA	46,856	16.930	793,272.080
TELECOM ITALIA SPA	266,282	0.776	206,634.830
TELECOM ITALIA-RSP	134,950	0.622	84,006.370
INTESA SANPAOLO-RSP	21,000	2.626	55,146.000
INTESA SANPAOLO	293,897	2.812	826,438.360
ATLANTIA SPA	10,607	26.840	284,691.880
POSTE ITALIANE SPA	11,800	6.065	71,567.000
RECORDATI SPA	2,600	36.170	94,042.000
ENI SPA	60,200	13.480	811,496.000
LEONARDO SPA	9,525	14.750	140,493.750
ENEL SPA	193,334	5.145	994,703.430
SNAM SPA	53,200	4.158	221,205.600
LUXOTTICA GROUP SPA	4,150	48.100	199,615.000
TERNA SPA	35,400	4.954	175,371.600
EXOR NV	2,500	53.450	133,625.000
CNH INDUSTRIAL NV	24,300	9.455	229,756.500
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	25,050	13.680	342,684.000
FERRARI NV	2,835	97.750	277,121.250
TELEFONICA SA	104,627	8.864	927,413.720
ENDESA SA	7,650	20.755	158,775.750
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	153,712	7.234	1,111,952.600
IBERDROLA SA	138,734	6.850	950,327.900
BANCO DE SABADELL SA	122,909	1.764	216,811.470
BANKINTER SA	15,100	7.775	117,402.500
REPSOL SA	28,700	14.710	422,177.000
GRIFOLS SA	6,700	24.100	161,470.000
BANCO SANTANDER SA	378,050	5.303	2,004,799.150
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	15,800	16.855	266,309.000
AMADEUS IT GROUP SA	10,100	52.220	527,422.000
GAS NATURAL SDG SA	8,450	20.310	171,619.500
MAPFRE SA	25,450	2.858	72,736.100

CAIXABANK S. A	81,600	4.124	336,518.400
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	17,700	6.474	114,589.800
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,376	31.920	171,601.920
AENA SA	1,600	159.200	254,720.000
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	25,300	31.200	789,360.000
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	5,600	12.985	72,716.000
ENAGAS SA	5,400	24.500	132,300.000
RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,000	18.805	188,050.000
FERROVIAL SA	11,700	19.160	224,172.000
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	15,700	5.253	82,472.100
BANKIA SA	27,105	3.900	105,709.500
UPM-KYMMENE OYJ	12,400	21.900	271,560.000
NOKIA OYJ	138,150	5.160	712,854.000
WARTSILA OYJ ABP	3,350	57.750	193,462.500
STORA ENSO OYJ-R SHS	13,100	10.880	142,528.000
METSO OYJ	2,400	28.830	69,192.000
ELISA OYJ	3,250	35.880	116,610.000
SAMPO OYJ-A SHS	10,700	43.850	469,195.000
FORTUM OYJ	10,450	15.530	162,288.500
KONE OYJ-B	7,850	45.480	357,018.000
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,650	35.580	94,287.000
NESTE OYJ	2,950	36.360	107,262.000
ORION OYJ-CLASS B	2,450	41.990	102,875.500
OMV AG	3,550	48.000	170,400.000
ERSTE GROUP BANK AG	6,650	35.000	232,750.000
VOESTALPINE AG	2,850	42.700	121,695.000
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	27.130	92,242.000
ANDRITZ AG	1,600	45.475	72,760.000
BANK OF IRELAND GROUP PLC	22,060	6.791	149,809.460
JERONIMO MARTINS	6,000	16.710	100,260.000
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,500	3.223	159,538.500
GALP ENERGIA SGPS SA	11,650	14.105	164,323.250
KERRY GROUP PLC-A	3,850	78.590	302,571.500
CRH PLC	19,400	29.175	565,995.000
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,900	78.800	149,720.000
ユーロ 小計			ユーロ 89,058,131.340 (11,593,587,537)
香港・ドル	株	香港・ドル	香港・ドル
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	33,000	68.450	2,258,850.000
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	55,000	51.200	2,816,000.000
MTR CORP	34,500	45.850	1,581,825.000
SUN HUNG KAI PROPERTIES	34,000	128.400	4,365,600.000
SINO LAND CO	74,000	13.360	988,640.000
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	63,169	99.350	6,275,840.150
WHARF HOLDINGS LTD	28,000	73.850	2,067,800.000
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	12,500	79.000	987,500.000
FIRST PACIFIC CO	56,000	6.300	352,800.000
CLP HOLDINGS LTD	39,500	81.400	3,215,300.000
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	27,924	49.100	1,371,068.400
HANG LUNG GROUP LTD	21,000	28.900	606,900.000
HONG KONG & CHINA GAS	199,256	14.860	2,960,944.160
HANG SENG BANK LTD	17,900	181.000	3,239,900.000
WHEELOK & CO LTD	20,000	56.950	1,139,000.000

NEW WORLD DEVELOPMENT	144,000	10.660	1,535,040.000	
WH GROUP LTD	194,500	8.170	1,589,065.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	27,300	210.800	5,754,840.000	
LI & FUNG LTD	132,000	3.600	475,200.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	18.980	873,080.000	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	5,800	104.300	604,940.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	16,500	33.600	554,400.000	
NWS HOLDINGS LTD	35,500	15.020	533,210.000	
KERRY PROPERTIES LTD	18,000	30.750	553,500.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	29,040	35.550	1,032,372.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	14,000	36.550	511,700.000	
SJM HOLDINGS LTD	47,000	7.080	332,760.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	30,000	26.450	793,500.000	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	61,669	65.900	4,063,987.100	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	15,000	70.500	1,057,500.000	
I-CABLE COMMUNICATIONS LTD	13,697	0.305	4,177.580	
PCCW LTD	95,000	4.310	409,450.000	
AIA GROUP LTD	281,200	59.850	16,829,820.000	
SANDS CHINA LTD	57,200	36.800	2,104,960.000	
SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	13.500	405,000.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	31,500	40.500	1,275,750.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	20,000	16.220	324,400.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	87,500	38.600	3,377,500.000	
WYNN MACAU LTD	38,000	18.860	716,680.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 79,940,799.390 (1,115,973,560)	
合計			84,403,845,417 [84,403,845,417]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,247	602,415.910	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,387	1,172,538.510	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,550	429,301.500	
		GGP INC	14,400	304,128.000	
		VORNADO REALTY TRUST	3,827	284,613.990	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,750	413,875.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,600	578,092.000	
		EQUINIX INC	1,828	847,314.560	
		AMERICAN TOWER CORP	9,750	1,424,182.500	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	17,293	310,928.140	
		KIMCO REALTY CORP	10,000	201,900.000	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	12,000	156,600.000	
		VENTAS INC	8,300	567,305.000	
		WEYERHAEUSER CO	17,614	585,313.220	
		AGNC INVESTMENT CORP	7,800	165,750.000	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,900	131,790.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	9,250	980,592.500	
		IRON MOUNTAIN INC	5,610	220,136.400	
		VEREIT INC	22,300	192,003.000	
		PROLOGIS INC	12,412	783,693.680	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,100	252,819.000	

	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,000	183,960.000
	DUKE REALTY CORP	8,000	235,520.000
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,480	388,899.600
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,600	206,912.000
	WELLTOWER INC	8,400	618,828.000
	HCP INC	10,700	322,284.000
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	141,273.000
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,600	276,562.000
	MACERICH CO/THE	2,700	146,826.000
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	25,100	310,487.000
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3,400	142,460.000
	REALTY INCOME CORP	6,450	375,261.000
	PUBLIC STORAGE	3,600	748,404.000
	REGENCY CENTERS CORP	3,500	226,520.000
	SL GREEN REALTY CORP	2,250	217,215.000
	UDR INC	6,300	246,078.000
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,700	442,853.000
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,000	238,170.000
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 16,073,805.510 (1,755,098,824)
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	18,200	183,092.000
	SEGRO PLC	23,750	126,587.500
	HAMMERSON PLC	19,200	106,272.000
	BRITISH LAND CO PLC	22,100	132,379.000
	INTU PROPERTIES PLC	21,100	51,673.900
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 600,004.400 (85,494,627)
オーストラリア・ドル	LENDLEASE GROUP	13,300	218,120.000
	TRANSURBAN GROUP	47,800	582,204.000
	SYDNEY AIRPORT	25,100	186,995.000
	APA GROUP	26,700	230,421.000
	SCENTRE GROUP	128,722	512,313.560
	DEXUS	23,950	228,243.500
	GPT GROUP	44,060	219,859.400
	MIRVAC GROUP	84,400	196,652.000
	STOCKLAND	57,000	252,510.000
	WESTFIELD CORP	45,496	357,598.560
	GOODMAN GROUP	41,700	341,106.000
	VICINITY CENTRES	82,873	222,928.370
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 3,548,951.390 (310,533,247)
カナダ・ドル	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1,500	44,520.000
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,000	64,140.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,300	78,177.000
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 186,837.000 (16,669,597)

シンガポール・ドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	46,000	シンガポール・ドル 78,890.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	57,400	153,258.000
	CAPITALAND MALL TRUST	63,200	132,088.000
	SUNTEC REIT	53,000	99,640.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 463,876.000 (37,550,762)
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,350	ユーロ 493,500.000
	ICADE	900	66,636.000
	GECINA SA	1,150	151,052.500
	KLEPIERRE	5,200	175,916.000
	FONCIERE DES REGIONS	750	62,137.500
ユーロ 小計			ユーロ 949,242.000 (123,572,324)
香港・ドル	LINK REIT	52,000	香港・ドル 3,354,000.000
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	64,500	459,885.000
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	87,000	867,390.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 4,681,275.000 (65,350,599)
投資証券 合計			2,394,269,980 [2,394,269,980]
合計			2,394,269,980 [2,394,269,980]

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 602 銘柄 投資証券 39 銘柄	96.9%	3.1%	64.4%
イギリス・ポンド	株式 102 銘柄 投資証券 5 銘柄	98.7%	1.3%	7.3%
イスラエル・シケル	株式 9 銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 58 銘柄 投資証券 12 銘柄	87.9%	12.1%	3.0%
カナダ・ドル	株式 90 銘柄 投資証券 3 銘柄	99.5%	0.5%	4.0%
シンガポール・ドル	株式 22 銘柄 投資証券 4 銘柄	92.0%	8.0%	0.5%
スイス・フラン	株式 36 銘柄	100%	-%	3.4%
スウェーデン・クローナ	株式 31 銘柄	100%	-%	1.2%
デンマーク・クローネ	株式 18 銘柄	100%	-%	0.8%
ニュージーランド・ドル	株式 6 銘柄	100%	-%	0.1%

ノルウェー・クローネ	株式	10 銘柄	100%	-%	0.3%
ユーロ	株式	233 銘柄	98.9%	1.1%	13.5%
	投資証券	5 銘柄			
香港・ドル	株式	39 銘柄	94.5%	5.5%	1.4%
	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	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		38,641,770
コール・ローン		34,191,203
株式		3,415,731,319
投資証券		229,607,180
未収配当金		8,568,445
差入委託証拠金		7,268,284
流動資産合計		3,734,008,201
資産合計		3,734,008,201
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		720
未払金		12,004,673
未払解約金		8,540,000
その他未払費用		47,488
流動負債合計		20,592,881
負債合計		20,592,881
純資産の部		
元本等		
元本	※1	2,419,936,327
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		1,293,478,993
元本等合計		3,713,415,320
純資産合計		3,713,415,320
負債純資産合計		3,734,008,201

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 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

	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
1. ※1 期首	平成28年9月8日
期首元本額	1,433,488,534円
期中追加設定元本額	2,077,732,404円
期中一部解約元本額	1,091,284,611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
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
D-I's 新興国株式インデックス	53,056,467円
iFree 新興国株式インデックス	670,671,594円
iFree 8資産バランス	357,159,953円
DC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
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	300,378,480円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	42,349,254円
計	2,419,936,327円
2. 期末日における受益権の総数	2,419,936,327口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成 29 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	
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	
株式		218,506,023
投資証券		11,255,611
合計		229,761,634

(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)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			
	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	21,836,720	—	21,836,000	△720
アメリカ・ドル	21,836,720	—	21,836,000	△720
合計	21,836,720	—	21,836,000	△720

(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。

- ① 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。
- ② 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
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5345円 (15,345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	13,800	5.010	69,138.000	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	12,250	10.370	127,032.500	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	45,706	2.100	95,982.600	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,840	40.430	114,821.200	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	13,270	4.736	62,846.720	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	5,260	17.030	89,577.800	
	SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	2,790	5.100	14,229.000	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1,990	41.920	83,420.800	
	MEGAFON-REG S GDR	2,490	10.150	25,273.500	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	14,390	1.385	19,930.150	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	31,960	13.560	433,377.600	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	530	106.700	56,551.000	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	10,490	50.340	528,066.600	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	22,030	5.210	114,776.300	
	GAZPROM PAO -SPON ADR	183,740	4.028	740,196.590	
	SEVERSTAL - GDR REG S	2,200	15.600	34,320.000	
	ROSSETI PJSC	1,603,720	0.018	29,538.910	
	INTER RAO UES PJSC	364,020	0.066	24,381.330	
	ALROSA PJSC	14,990	1.375	20,622.940	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	17,700	1.399	24,762.300		
TRANSNEFT PJSC	13	3,027.942	39,363.240		
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 2,748,209.080 (300,076,949)	
インド・ルピー		株	インド・ルピー	インド・ルピー	
	TATA STEEL LTD	5,320	653.000	3,473,960.000	
	AXIS BANK LTD	8,860	492.850	4,366,651.000	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	320	7,846.650	2,510,928.000	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	2,560	1,206.400	3,088,384.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	10,630	476.500	5,065,195.000	
	STATE BANK OF INDIA	22,490	274.250	6,167,882.500	
	NTPC LTD	19,760	169.950	3,358,212.000	
	JSW STEEL LTD	11,360	263.100	2,988,816.000	
	INDIAN OIL CORP LTD	14,850	428.250	6,359,512.500	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	12,705	534.900	6,795,904.500	
	IDEA CELLULAR LTD	15,060	81.800	1,231,908.000	
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	4,440	214.900	954,156.000	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	10,810	164.600	1,779,326.000	
	COAL INDIA LTD	13,910	255.800	3,558,178.000	
	NMDC LTD	10,080	134.400	1,354,752.000	

	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	2,530	1,264.300	3,198,679.000	
	GAIL INDIA LTD	3,800	382.250	1,452,550.000	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	14,650	245.800	3,600,970.000	
	WIPRO LTD	7,720	297.200	2,294,384.000	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	1,958	2,453.200	4,803,365.600	
	INFOSYS LTD	10,100	895.600	9,045,560.000	
	LARSEN & TOUBRO LTD	2,242	1,117.600	2,505,659.200	
	TATA MOTORS LTD	12,660	382.700	4,844,982.000	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	68,580	22.550	1,546,479.000	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	5,950	1,775.000	10,561,250.000	
	ICICI BANK LTD	18,704	295.350	5,524,226.400	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	16,740	1,645.400	27,543,996.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	41,405	162.300	6,720,031.500	
	ITC LTD	9,540	275.700	2,630,178.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	1,930	1,316.550	2,540,941.500	
	HERO MOTOCORP LTD	470	3,950.650	1,856,805.500	
	BHARTI AIRTEL LTD	10,760	402.500	4,330,900.000	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	2,650	474.250	1,256,762.500	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	2,330	851.050	1,982,946.500	
	VEDANTA LTD	11,520	318.250	3,666,240.000	
インド・ルピー	小計			インド・ルピー 154,960,672.200 (266,532,356)	
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	19,000	30,325.000	576,175,000.000	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	140,900	7,825.000	1,102,542,500.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	39,400	8,375.000	329,975,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	363,600	4,710.000	1,712,556,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	79,000	7,200.000	568,800,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	47,400	18,900.000	895,860,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	71,800	12,950.000	929,810,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	168,700	1,840.000	310,408,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	83,700	14,850.000	1,242,945,000.000	
	ADARO ENERGY TBK PT	171,200	1,890.000	323,568,000.000	
インドネシア・ルピア	小計			インドネシア・ルピア 7,992,639,500.000 (65,539,643)	
タイ・バーツ		株	タイ・バーツ	タイ・バーツ	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	5,800	187.000	1,084,600.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	3,300	500.000	1,650,000.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	4,900	210.000	1,029,000.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	3,200	201.000	643,200.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	25,600	147.000	3,763,200.000	
	THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	16,900	47.000	794,300.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	13,800	190.000	2,622,000.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	77,300	18.500	1,430,050.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	61,500	17.500	1,076,250.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	24,600	88.250	2,170,950.000	
	IRPC PCL - NVDR	178,800	6.000	1,072,800.000	
	BANGCHAK CORP PCL-NVDR	23,100	38.500	889,350.000	
	PTT PCL-NVDR	27,000	398.000	10,746,000.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	16,100	91.000	1,465,100.000	
	CP ALL PCL-NVDR	25,700	61.500	1,580,550.000	

	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	18,900	58.250	1,100,925.000
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	51,600	27.500	1,419,000.000
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	32,100	76.000	2,439,600.000
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 36,976,875.000 (121,653,919)
チリ・ペソ		株	チリ・ペソ	チリ・ペソ
	ENEL CHILE SA	152,310	71.920	10,954,135.200
	ENEL GENERACION CHILE SA	26,680	523.340	13,962,711.200
	LATAM AIRLINES GROUP SA	4,090	7,981.200	32,643,108.000
	CENCOSUD SA	14,380	1,883.000	27,077,540.000
	BANCO SANTANDER CHILE	752,680	44.760	33,689,956.800
	ENEL AMERICAS SA	248,920	130.140	32,394,448.800
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	500	30,216.000	15,108,000.000
	S. A. C. I. FALABELLA	3,540	6,035.200	21,364,608.000
BANCO DE CHILE	199,766	90.510	18,080,820.660	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ 205,275,328.660 (36,231,095)
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ
	TURKIYE GARANTI BANKASI	32,650	10.590	345,763.500
	AKBANK T. A. S.	30,350	10.260	311,391.000
	TURKIYE IS BANKASI-C	27,170	7.390	200,786.300
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	13,920	13.080	182,073.600
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,820	123.500	348,270.000
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	17,831	8.150	145,322.650
	HACI OMER SABANCI HOLDING	18,930	10.460	198,007.800
	TURKIYE HALK BANKASI	15,360	14.290	219,494.400
	YAPI VE KREDI BANKASI	17,370	4.710	81,812.700
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	23,130	6.930	160,290.900
	KOC HOLDING AS	11,255	17.820	200,564.100
	TURK HAVA YOLLARI AO	18,490	9.830	181,756.700
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	11,000	7.150	78,650.000
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,270	77.400	175,698.000
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 2,829,881.650 (90,188,329)
ブラジル・リアル		株	ブラジル・リアル	ブラジル・リアル
	BTG PACTUAL PARTICIPAT-UNIT	3,000	0.400	1,200.000
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	3,000	18.840	56,520.000
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	90,700	15.020	1,362,314.000
	VALE SA-PREF	32,700	33.170	1,084,659.000
	BANCO BRADESCO SA-PREF	37,040	34.270	1,269,360.800
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	39,124	42.090	1,646,729.160
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	12,000	9.830	117,960.000
	VALE SA	22,000	35.800	787,600.000
	GERDAU SA-PREF	21,500	12.910	277,565.000
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	78,600	15.500	1,218,300.000
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	29,497	8.470	249,839.590
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	19,229	10.690	205,558.010
	BRASKEM SA-PREF A	2,200	40.240	88,528.000
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,700	22.000	59,400.000
	BANCO DO BRASIL S. A.	24,100	32.760	789,516.000

	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	3,400	19.070	64,838.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	4,200	29.120	122,304.000	
	EMBRAER SA	8,400	18.250	153,300.000	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	45,300	6.240	282,672.000	
	CCR SA	6,200	17.630	109,306.000	
	BRF SA	7,100	44.980	319,358.000	
	NATURA COSMETICOS SA	2,500	29.700	74,250.000	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	3,700	33.040	122,248.000	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	3,700	14.660	54,242.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	10,426	11.290	117,709.540	
	TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	5,400	48.760	263,304.000	
	CPFL ENERGIA SA	3,587	27.160	97,422.920	
	LOJAS RENNER S. A.	3,250	33.180	107,835.000	
	JBS SA	17,000	7.970	135,490.000	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,400	36.000	86,400.000	
	MARFRIG GLOBAL FOODS SA	9,000	7.240	65,160.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	9,100	22.760	207,116.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	5,508	13.970	76,946.760	
	CIELO SA	6,828	22.400	152,947.200	
	FIBRIA CELULOSE SA	2,700	42.970	116,019.000	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	3,900	73.950	288,405.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,000	63.250	63,250.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,500	29.070	130,815.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	4,500	73.740	331,830.000	
	KROTON EDUCACIONAL SA	6,800	18.160	123,488.000	
	BANCO BRADESCO S. A.	8,617	33.200	286,084.400	
	AMBEV SA	32,500	20.130	654,225.000	
ブラジル・リアル	小計			ブラジル・リアル 13,822,015.380 (486,673,161)	
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	9,740	36.300	353,562.000	
	BANK PEKAO SA	2,400	127.750	306,600.000	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	9,870	49.060	484,222.200	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	16,200	6.890	111,618.000	
	PGE SA	14,090	13.850	195,146.500	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	5,130	118.600	608,418.000	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	28,440	3.840	109,209.600	
	ENERGA SA	9,400	13.360	125,584.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,220	125.800	405,076.000	
ポーランド・ズロチ	小計			ポーランド・ズロチ 2,699,436.300 (82,737,723)	
マレーシア・リングット		株	マレーシア・リングット	マレーシア・リングット	
	MALAYAN BANKING BHD	40,700	9.470	385,429.000	
	GENTING BHD	13,600	9.840	133,824.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	24,400	20.600	502,640.000	
	SIME DARBY BERHAD	45,700	9.070	414,499.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	18,300	4.990	91,317.000	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	3,700	24.560	90,872.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	23,400	7.390	172,926.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	21,700	5.960	129,332.000	

	IOI CORP BHD	16,900	4.530	76,557.000
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	73,900	6.750	498,825.000
	TENAGA NASIONAL BHD	38,400	14.400	552,960.000
	PETRONAS GAS BHD	7,500	18.380	137,850.000
	DIGI. COM BHD	26,900	4.860	130,734.000
	SAPURA ENERGY BHD	84,300	1.470	123,921.000
マレーシア・リンギット 小計				マレーシア・リンギット 3,441,686.000 (89,002,000)
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	534,300	16.290	8,703,747.000
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	16,000	88.740	1,419,840.000
	CEMEX SAB-CPO	195,719	16.340	3,198,048.460
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	17,300	175.730	3,040,129.000
	GRUPO FIN SANTANDER-B	24,500	36.920	904,540.000
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	4,200	143.190	601,398.000
	MEXICHEM SAB DE CV-*	11,023	47.830	527,230.090
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	10,300	43.320	446,196.000
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	960	475.770	456,739.200
	ALFA S. A. B. -A	45,100	23.950	1,080,145.000
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	33,900	58.940	1,998,066.000
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	15,700	30.910	485,287.000
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	44,600	43.000	1,917,800.000
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	20,100	121.860	2,449,386.000	
メキシコ・ペソ 小計				メキシコ・ペソ 27,228,551.750 (167,455,593)
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	31,500	10.080	317,520.000
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	60,000	6.400	384,000.000
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	14,000	25.050	350,700.000
	KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	9,500	42.100	399,950.000
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	15,000	19.320	289,800.000
	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	24,000	19.280	462,720.000
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	20,000	13.640	272,800.000
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	8,000	23.600	188,800.000
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	527,800	6.000	3,166,800.000
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	41.300	247,800.000
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	40,000	9.960	398,400.000
	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	192,000	0.830	159,360.000
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	38,000	4.250	161,500.000
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	21,000	13.460	282,660.000
	TENCENT HOLDINGS LTD	4,800	324.200	1,556,160.000
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	272,000	4.030	1,096,160.000
	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	34,000	3.750	127,500.000
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	116,000	11.280	1,308,480.000
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	15,500	16.320	252,960.000
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	26,000	14.080	366,080.000
	PETROCHINA CO LTD-H	360,000	5.020	1,807,200.000
	CNOOC LTD	326,000	9.460	3,083,960.000
	HUANENG POWER INTL INC-H	80,000	5.060	404,800.000
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	11,000	29.650	326,150.000
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	31,000	5.820	180,420.000
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,363,000	6.720	9,159,360.000

CHINA MOBILE LTD	60,000	82.000	4,920,000.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	18,800	22.700	426,760.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	120,000	5.070	608,400.000	
GF SECURITIES CO LTD-H	8,600	16.380	140,868.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	4,000	68.300	273,200.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	58,000	4.640	269,120.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	60,000	19.080	1,144,800.000	
SINOPHARM GROUP CO-H	10,000	36.300	363,000.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	28,000	24.300	680,400.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	11,000	20.550	226,050.000	
YANZHOU COAL MINING CO-H	26,000	7.700	200,200.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	413,000	3.600	1,486,800.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	5,000	48.500	242,500.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	115,000	3.630	417,450.000	
CITIC LTD	45,000	11.660	524,700.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	102,000	2.910	296,820.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,168,000	5.740	6,704,320.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	18,000	11.280	203,040.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	34,000	26.700	907,800.000	
CRRC CORP LTD - H	21,000	7.060	148,260.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	48,000	10.220	490,560.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	37,000	61.650	2,281,050.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	22,000	25.900	569,800.000	
CHINA MINSHENG BANKING-H	86,400	7.690	664,416.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	79,000	11.120	878,480.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	10,800	23.900	258,120.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	60,000	14.240	854,400.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	20,500	10.220	209,510.000	
WEICHAI POWER CO LTD-H	34,000	8.700	295,800.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	63,000	2.610	164,430.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	60,000	5.810	348,600.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	21,400	36.450	780,030.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	46,000	24.250	1,115,500.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	6,000	53.250	319,500.000	
KUNLUN ENERGY CO LTD	38,000	7.600	288,800.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,000	18.300	475,800.000	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	22,000	6.380	140,360.000	
LENOVO GROUP LTD	188,000	4.190	787,720.000	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	84,000	5.020	421,680.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	138,100	5.800	800,980.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	80,000	22.850	1,828,000.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	32,000	5.110	163,520.000	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	204,000	0.870	177,480.000	
CHINA MERCHANTS BANK-H	46,500	29.000	1,348,500.000	
BANK OF CHINA LTD-H	1,192,000	4.020	4,791,840.000	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	15,500	17.120	265,360.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	45,000	3.700	166,500.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	18,000	12.820	230,760.000	
LONGFOR PROPERTIES	19,500	19.100	372,450.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 68,426,474.000 (955,233,578)	
台湾・ドル			台湾・ドル	
TAIWAN CEMENT	株 32,000	台湾・ドル 34.100	台湾・ドル 1,091,200.000	

UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	46,112	63.900	2,946,556.800	
FORMOSA PLASTICS CORP	28,600	95.400	2,728,440.000	
NAN YA PLASTICS CORP	39,140	75.000	2,935,500.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	28,390	95.100	2,699,889.000	
WALSIN LIHWA CORP	44,000	15.200	668,800.000	
CHINA STEEL CORP	80,686	25.050	2,021,184.300	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	17,255	60.600	1,045,653.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	19,616	43.400	851,334.400	
DELTA ELECTRONICS INC	15,000	161.000	2,415,000.000	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	65,929	36.600	2,413,001.400	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	9,141	95.800	875,707.800	
INVENTEC CORP	49,000	23.650	1,158,850.000	
TATUNG CO LTD	47,000	14.050	660,350.000	
QUANTA COMPUTER INC	26,000	68.000	1,768,000.000	
AU OPTRONICS CORP	261,000	12.250	3,197,250.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	40,400	104.000	4,201,600.000	
MEDIATEK INC	17,003	271.500	4,616,314.500	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	6,000	370.000	2,220,000.000	
HTC CORP	22,257	68.500	1,524,604.500	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	35,617	33.050	1,177,141.850	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	76,411	47.600	3,637,163.600	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	83,693	48.300	4,042,371.900	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	57,120	18.350	1,048,152.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	71,828	13.050	937,355.400	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	74,993	23.800	1,784,833.400	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	63,178	13.150	830,790.700	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	135,041	9.300	1,255,881.300	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	164,028	19.350	3,173,941.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	73,258	19.700	1,443,182.600	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	7,000	115.500	808,500.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	11,000	107.500	1,182,500.000	
WISTRON CORP	73,940	27.050	2,000,077.000	
INNOLUX CORP	277,000	14.250	3,947,250.000	
TPK HOLDING CO LTD	11,000	121.500	1,336,500.000	
WPG HOLDINGS LTD	25,000	38.600	965,000.000	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	17,000	71.900	1,222,300.000	
PEGATRON CORP	37,000	93.200	3,448,400.000	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	8,000	76.100	608,800.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	7,400	91.700	678,580.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	11,000	106.500	1,171,500.000	
POU CHEN	14,440	39.350	568,214.000	
SILICONWARE PRECISION INDS	12,000	47.300	567,600.000	
COMPAL ELECTRONICS	37,453	21.950	822,093.350	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	120,000	217.000	26,040,000.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	156,128	115.500	18,032,784.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	4,000	250.000	1,000,000.000	
ASUSTEK COMPUTER INC	4,760	246.000	1,170,960.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	115,000	16.050	1,845,750.000	
台湾・ドル 小計			台湾・ドル 128,786,858.600 (467,496,297)	
南アフリカ・ランド				
GOLD FIELDS LTD	株 19,480	南アフリカ・ランド 59.540	南アフリカ・ランド 1,159,839.200	

STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	16,240	63.200	1,026,368.000	
VODACOM GROUP LTD	6,160	164.280	1,011,964.800	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	3,800	213.520	811,376.000	
NEDBANK GROUP LTD	2,930	203.230	595,463.900	
BIDVEST GROUP LTD	2,420	168.710	408,278.200	
BID CORP LTD	3,160	294.460	930,493.600	
NETCARE LTD	10,460	24.060	251,667.600	
STANDARD BANK GROUP LTD	17,810	163.270	2,907,838.700	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,200	195.800	626,560.000	
SASOL LTD	10,990	385.990	4,242,030.100	
REMGRO LTD	3,010	213.500	642,635.000	
EXXARO RESOURCES LTD	2,390	127.900	305,681.000	
KUMBA IRON ORE LTD	1,880	208.400	391,792.000	
PICK N PAY STORES LTD	3,770	61.370	231,364.900	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	4,160	80.900	336,544.000	
SANLAM LTD	17,590	68.540	1,205,618.600	
TIGER BRANDS LTD	1,050	374.340	393,057.000	
FIRSTRAND LTD	29,230	54.450	1,591,573.500	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	7,580	60.070	455,330.600	
THE FOSCHINI GROUP LTD	1,680	145.060	243,700.800	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	7,840	140.370	1,100,500.800	
NASPERS LTD-N SHS	1,050	2,870.870	3,014,413.500	
INVESTEC LTD	3,100	98.000	303,800.000	
MTN GROUP LTD	36,590	124.010	4,537,525.900	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	13,090	40.650	532,108.500	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	1,380	281.090	387,904.200	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	4,810	133.290	641,124.900	
BARLOWORLD LTD	4,250	125.000	531,250.000	
SAPPI LIMITED	7,180	83.900	602,402.000	
TELKOM SA SOC LTD	4,090	60.650	248,058.500	
MONDI LTD	840	343.620	288,640.800	
MMI HOLDINGS LTD	13,010	20.000	260,200.000	
SPAR GROUP LIMITED/THE	2,170	167.100	362,607.000	
MR PRICE GROUP LTD	1,590	179.640	285,627.600	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	9,600	25.290	242,784.000	
SIBANYE GOLD LTD	14,700	19.720	289,884.000	
BRAIT SE	3,640	54.420	198,088.800	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 33,596,098.000 (286,910,676)	
合計			3,415,731,319 [3,415,731,319]	

(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	POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT	90,000	アメリカ・ドル 1,980,900.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 1,980,900.000 (216,294,471)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	24,500	メキシコ・ペソ 784,000.000	
	メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 784,000.000	

			(4,821,600)
南アフリカ・ランド			南アフリカ・ランド
	REDEFINE PROPERTIES LTD	34,350	370,980,000
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	24,300	623,295,000
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 994,275,000 (8,491,109)
投資証券 合計			229,607,180 [229,607,180]
合計			229,607,180 [229,607,180]

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 21 銘柄	58.1%	41.9%	14.2%
	投資証券 1 銘柄			
インド・ルピー	株式 35 銘柄	100%	—%	7.3%
インドネシア・ルピア	株式 10 銘柄	100%	—%	1.8%
タイ・バーツ	株式 18 銘柄	100%	—%	3.3%
チリ・ペソ	株式 9 銘柄	100%	—%	1.0%
トルコ・リラ	株式 14 銘柄	100%	—%	2.5%
ブラジル・レアル	株式 42 銘柄	100%	—%	13.4%
ポーランド・ズロチ	株式 9 銘柄	100%	—%	2.3%
マレーシア・リングgit	株式 14 銘柄	100%	—%	2.4%
メキシコ・ペソ	株式 14 銘柄	97.2%	2.8%	4.7%
	投資証券 1 銘柄			
香港・ドル	株式 75 銘柄	100%	—%	26.2%
台湾・ドル	株式 49 銘柄	100%	—%	12.8%
南アフリカ・ランド	株式 38 銘柄	97.1%	2.9%	8.1%
	投資証券 2 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	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		112,358,775
国債証券		11,708,883,790
地方債証券		1,134,312,500
特殊債券		1,025,437,500
社債券		1,127,290,000
未収利息		49,949,873
前払費用		599,179
流動資産合計		15,158,831,617
資産合計		15,158,831,617
負債の部		
流動負債		
未払解約金		36,905,860
流動負債合計		36,905,860
負債合計		36,905,860
純資産の部		
元本等		
元本	※1	11,905,512,687
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		3,216,413,070
元本等合計		15,121,925,757
純資産合計		15,121,925,757
負債純資産合計		15,158,831,617

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 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 年 9 月 7 日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成 29 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	平成 28 年 9 月 8 日
期首元本額	11,293,335,346 円
期中追加設定元本額	2,671,437,155 円
期中一部解約元本額	2,059,259,814 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2050	44,382 円
iFree 日本債券インデ ックス	83,423,717 円
iFree 8資産バランス	430,917,656 円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	4,938,780,124 円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,446,057,023 円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	776,093,549 円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	568,177,603 円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コース)	461,622,996 円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	138,527,916 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2020	68,621,548 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2030	48,130,755 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2040	2,986,011 円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,087,968,927 円

ダイワ世界バランスファンド 60VA	224,057,853円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	248,906,168円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	381,196,459円
計	11,905,512,687円
2. 期末日における受益権の総数	11,905,512,687口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年9月8日 至 平成29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す。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29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	
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	
国債証券		△146,905,970
地方債証券		△5,633,900
特殊債券		△4,688,300
社債券		△3,342,400
合計		△160,570,570

(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) 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	
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	
1 口当たり純資産額	1.2702 円
(1 万口当たり純資産額)	(12,702 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 7 0 2 年国債	10,000,000	10,031,200	
	3 7 1 2 年国債	75,000,000	75,250,500	
	3 7 3 2 年国債	125,000,000	125,473,750	
	3 7 6 2 年国債	20,000,000	20,088,800	
	3 7 7 2 年国債	25,000,000	25,116,750	
	1 1 6 5 年国債	155,000,000	155,720,750	
	1 1 9 5 年国債	41,000,000	41,193,110	
	1 2 0 5 年国債	10,000,000	10,074,100	
	1 2 1 5 年国債	55,000,000	55,295,900	
	1 2 2 5 年国債	83,000,000	83,501,320	
	1 2 3 5 年国債	100,000,000	100,670,000	
	1 2 4 5 年国債	35,000,000	35,253,400	
	1 2 5 5 年国債	150,000,000	151,161,000	
	1 2 6 5 年国債	124,000,000	125,019,280	
	1 2 8 5 年国債	107,000,000	107,994,030	
	1 2 9 5 年国債	110,000,000	111,090,100	
	1 3 0 5 年国債	127,000,000	128,365,250	

1 3 1	5年国債	60,000,000	60,696,000
1 3 2	5年国債	20,000,000	20,235,400
1	40年国債	60,000,000	85,221,600
2	40年国債	23,000,000	31,542,200
3	40年国債	19,000,000	26,100,110
4	40年国債	30,000,000	41,319,900
5	40年国債	35,000,000	46,173,400
6	40年国債	28,000,000	36,119,720
7	40年国債	31,000,000	38,078,230
8	40年国債	23,000,000	26,079,240
9	40年国債	20,000,000	16,212,000
1 0	40年国債	4,000,000	3,853,920
2 9 7	10年国債	20,000,000	20,399,400
2 9 8	10年国債	61,000,000	62,140,700
3 0 0	10年国債	8,000,000	8,203,040
3 0 1	10年国債	35,000,000	36,036,000
3 0 2	10年国債	54,000,000	55,502,280
3 0 5	10年国債	100,000,000	103,343,000
3 0 6	10年国債	10,000,000	10,396,100
3 0 8	10年国債	100,000,000	104,080,000
3 0 9	10年国債	103,000,000	106,628,690
3 1 0	10年国債	30,000,000	31,052,700
3 1 1	10年国債	42,000,000	43,218,840
3 1 2	10年国債	94,000,000	98,174,540
3 1 3	10年国債	34,000,000	35,744,540
3 1 4	10年国債	77,000,000	80,406,480
3 1 5	10年国債	90,000,000	94,591,800
3 1 6	10年国債	56,000,000	58,644,320
3 1 7	10年国債	40,000,000	42,016,000
3 1 8	10年国債	33,000,000	34,529,550
3 1 9	10年国債	140,000,000	147,463,400
3 2 0	10年国債	35,000,000	36,715,350
3 2 1	10年国債	65,000,000	68,370,900
3 2 2	10年国債	140,000,000	146,623,400
3 2 3	10年国債	70,000,000	73,479,700
3 2 4	10年国債	80,000,000	83,592,800
3 2 5	10年国債	137,000,000	143,443,110
3 2 6	10年国債	20,000,000	20,881,400
3 2 8	10年国債	60,000,000	62,418,000
3 2 9	10年国債	50,000,000	52,673,500
3 3 0	10年国債	81,000,000	85,522,230
3 3 1	10年国債	93,000,000	97,063,170
3 3 2	10年国債	35,000,000	36,592,850
3 3 3	10年国債	53,000,000	55,489,410
3 3 4	10年国債	156,000,000	163,556,640
3 3 5	10年国債	140,000,000	145,993,400
3 3 6	10年国債	18,000,000	18,791,280
3 3 7	10年国債	10,000,000	10,293,000
3 3 8	10年国債	152,000,000	157,639,200
3 3 9	10年国債	45,000,000	46,689,300

3 4 0	1 0年国債	55,000,000	57,085,600
3 4 1	1 0年国債	15,000,000	15,448,950
3 4 2	1 0年国債	40,000,000	40,513,200
3 4 3	1 0年国債	152,000,000	153,872,640
3 4 4	1 0年国債	58,000,000	58,682,080
3 4 5	1 0年国債	150,000,000	151,671,000
3 4 6	1 0年国債	143,000,000	144,567,280
3 4 7	1 0年国債	105,000,000	106,077,300
2	3 0年国債	9,000,000	11,529,990
3	3 0年国債	4,000,000	5,089,760
4	3 0年国債	8,000,000	10,852,880
5	3 0年国債	8,000,000	10,172,320
6	3 0年国債	9,000,000	11,740,500
7	3 0年国債	12,000,000	15,551,280
8	3 0年国債	5,000,000	6,134,650
9	3 0年国債	11,000,000	12,832,710
1 0	3 0年国債	15,000,000	16,829,400
1 1	3 0年国債	9,000,000	10,930,410
1 2	3 0年国債	11,000,000	14,048,760
1 3	3 0年国債	11,000,000	13,890,690
1 4	3 0年国債	22,000,000	29,225,900
1 5	3 0年国債	21,000,000	28,264,740
1 6	3 0年国債	26,000,000	35,065,940
1 7	3 0年国債	17,000,000	22,676,640
1 8	3 0年国債	20,000,000	26,351,200
1 9	3 0年国債	15,000,000	19,811,100
2 0	3 0年国債	16,000,000	21,703,680
2 1	3 0年国債	16,000,000	21,176,800
2 2	3 0年国債	17,000,000	23,096,030
2 3	3 0年国債	16,000,000	21,771,840
2 4	3 0年国債	15,000,000	20,442,450
2 5	3 0年国債	17,000,000	22,577,870
2 6	3 0年国債	32,000,000	43,080,960
2 7	3 0年国債	32,000,000	43,768,640
2 8	3 0年国債	34,000,000	46,655,480
2 9	3 0年国債	43,000,000	58,320,900
3 0	3 0年国債	47,000,000	62,948,040
3 1	3 0年国債	38,000,000	50,267,920
3 2	3 0年国債	49,000,000	65,984,380
3 3	3 0年国債	55,000,000	70,720,100
3 4	3 0年国債	50,000,000	66,557,500
3 5	3 0年国債	56,000,000	72,234,400
3 6	3 0年国債	59,000,000	76,248,650
3 7	3 0年国債	57,000,000	72,491,460
3 8	3 0年国債	39,000,000	48,764,040
3 9	3 0年国債	37,000,000	47,157,240
4 0	3 0年国債	29,000,000	36,302,200
4 1	3 0年国債	29,000,000	35,633,460
4 2	3 0年国債	33,000,000	40,562,610
4 3	3 0年国債	37,000,000	45,495,940

4 4	3 0年国債	35,000,000	43,051,750
4 5	3 0年国債	28,000,000	33,054,000
4 6	3 0年国債	40,000,000	47,220,400
4 7	3 0年国債	44,000,000	53,022,640
4 8	3 0年国債	45,000,000	51,953,850
4 9	3 0年国債	45,000,000	51,944,400
5 0	3 0年国債	44,000,000	44,051,040
5 1	3 0年国債	45,000,000	39,232,800
5 2	3 0年国債	47,000,000	43,321,310
5 3	3 0年国債	40,000,000	37,833,200
5 4	3 0年国債	45,000,000	44,839,350
5 5	3 0年国債	32,000,000	31,846,720
4 1	2 0年国債	40,000,000	41,015,200
4 2	2 0年国債	22,000,000	22,927,080
4 3	2 0年国債	14,000,000	14,870,100
4 4	2 0年国債	32,000,000	34,153,920
4 5	2 0年国債	20,000,000	21,295,600
4 6	2 0年国債	19,000,000	20,248,300
4 7	2 0年国債	23,000,000	24,639,900
4 8	2 0年国債	9,000,000	9,783,720
4 9	2 0年国債	4,000,000	4,319,000
5 0	2 0年国債	30,000,000	32,179,800
5 1	2 0年国債	25,000,000	27,035,500
5 2	2 0年国債	19,000,000	20,723,680
5 3	2 0年国債	13,000,000	14,248,910
5 4	2 0年国債	14,000,000	15,405,180
5 5	2 0年国債	41,000,000	44,993,810
5 6	2 0年国債	12,000,000	13,230,600
5 7	2 0年国債	24,000,000	26,346,000
5 8	2 0年国債	35,000,000	38,583,650
5 9	2 0年国債	3,000,000	3,290,640
6 1	2 0年国債	40,000,000	42,489,600
6 2	2 0年国債	16,000,000	16,855,520
6 3	2 0年国債	30,000,000	33,348,000
6 4	2 0年国債	35,000,000	39,278,400
6 5	2 0年国債	42,000,000	47,333,160
6 6	2 0年国債	30,000,000	33,630,300
6 7	2 0年国債	19,000,000	21,508,000
6 8	2 0年国債	25,000,000	28,792,750
6 9	2 0年国債	12,000,000	13,741,680
7 0	2 0年国債	18,000,000	21,075,480
7 1	2 0年国債	17,000,000	19,672,740
7 2	2 0年国債	53,000,000	61,248,390
7 3	2 0年国債	30,000,000	34,590,600
7 4	2 0年国債	22,000,000	25,527,480
7 5	2 0年国債	14,000,000	16,315,320
7 6	2 0年国債	25,000,000	28,756,000
7 8	2 0年国債	17,000,000	19,624,800
7 9	2 0年国債	14,000,000	16,271,080
8 0	2 0年国債	20,000,000	23,400,800

8 1	2 0年国債	39,000,000	45,496,230
8 2	2 0年国債	28,000,000	32,889,920
8 3	2 0年国債	25,000,000	29,477,750
8 4	2 0年国債	27,000,000	31,611,600
8 5	2 0年国債	31,000,000	36,687,260
8 6	2 0年国債	6,000,000	7,203,420
8 7	2 0年国債	20,000,000	23,840,400
8 8	2 0年国債	33,000,000	39,780,510
8 9	2 0年国債	15,000,000	17,950,050
9 0	2 0年国債	37,000,000	44,446,250
9 1	2 0年国債	12,000,000	14,523,480
9 2	2 0年国債	45,000,000	53,863,650
9 3	2 0年国債	18,000,000	21,457,980
9 4	2 0年国債	45,000,000	54,073,800
9 5	2 0年国債	30,000,000	36,760,800
9 6	2 0年国債	23,000,000	27,733,630
9 7	2 0年国債	25,000,000	30,483,000
9 8	2 0年国債	34,000,000	41,116,200
9 9	2 0年国債	53,000,000	64,302,780
1 0 0	2 0年国債	35,000,000	42,964,950
1 0 1	2 0年国債	18,000,000	22,473,900
1 0 2	2 0年国債	10,000,000	12,531,400
1 0 3	2 0年国債	21,000,000	26,090,610
1 0 4	2 0年国債	34,000,000	41,512,640
1 0 5	2 0年国債	38,000,000	46,540,880
1 0 6	2 0年国債	16,000,000	19,771,680
1 0 7	2 0年国債	20,000,000	24,568,800
1 0 8	2 0年国債	48,000,000	57,889,920
1 0 9	2 0年国債	35,000,000	42,319,550
1 1 0	2 0年国債	27,000,000	33,263,730
1 1 1	2 0年国債	35,000,000	43,653,750
1 1 2	2 0年国債	29,000,000	35,831,820
1 1 3	2 0年国債	74,000,000	91,693,400
1 1 4	2 0年国債	45,000,000	55,912,500
1 1 5	2 0年国債	22,000,000	27,601,640
1 1 6	2 0年国債	27,000,000	33,948,180
1 1 7	2 0年国債	37,000,000	46,065,000
1 1 8	2 0年国債	13,000,000	16,064,360
1 1 9	2 0年国債	13,000,000	15,727,530
1 2 0	2 0年国債	60,000,000	71,081,400
1 2 1	2 0年国債	56,000,000	68,606,720
1 2 2	2 0年国債	10,000,000	12,123,300
1 2 3	2 0年国債	42,000,000	52,658,760
1 2 4	2 0年国債	35,000,000	43,426,950
1 2 5	2 0年国債	25,000,000	31,749,250
1 2 6	2 0年国債	21,000,000	26,096,280
1 2 7	2 0年国債	23,000,000	28,277,580
1 2 8	2 0年国債	32,000,000	39,423,360
1 2 9	2 0年国債	34,000,000	41,430,020
1 3 0	2 0年国債	28,000,000	34,158,040

131	20年国債	37,000,000	44,631,990
132	20年国債	25,000,000	30,183,000
133	20年国債	47,000,000	57,395,930
134	20年国債	15,000,000	18,347,700
135	20年国債	20,000,000	24,182,000
136	20年国債	40,000,000	47,800,800
137	20年国債	18,000,000	21,795,840
138	20年国債	24,000,000	28,354,560
139	20年国債	32,000,000	38,263,360
140	20年国債	60,000,000	72,703,200
141	20年国債	48,000,000	58,196,640
142	20年国債	30,000,000	36,813,900
143	20年国債	48,000,000	57,466,560
144	20年国債	24,000,000	28,376,160
145	20年国債	65,000,000	78,882,700
146	20年国債	58,000,000	70,414,900
147	20年国債	74,000,000	88,720,080
148	20年国債	59,000,000	69,814,110
149	20年国債	67,000,000	79,332,020
150	20年国債	61,000,000	71,233,360
151	20年国債	64,000,000	72,565,760
152	20年国債	69,000,000	78,165,270
153	20年国債	72,000,000	82,751,760
154	20年国債	67,000,000	75,819,880
155	20年国債	59,000,000	64,642,760
156	20年国債	63,000,000	62,248,410
157	20年国債	77,000,000	73,097,640
158	20年国債	63,000,000	63,000,000
159	20年国債	60,000,000	60,947,400
160	20年国債	54,000,000	55,722,060
161	20年国債	49,000,000	49,524,790
国債証券 合計			11,708,883,790
地方債証券	751 東京都公債	100,000,000	102,402,800
	21-35 兵庫県公債	100,000,000	103,481,000
	3 兵庫県公債12年	100,000,000	103,659,800
	28-1 静岡県公債	100,000,000	99,873,900
	24-16 愛知県公債	100,000,000	104,020,300
	21-2 埼玉県公債	100,000,000	102,721,800
	76 共同発行地方	100,000,000	102,654,300
	116 共同発行地方	100,000,000	104,100,300
	117 共同発行地方	100,000,000	103,737,700
	21-6 大阪市公債	100,000,000	103,507,300
	25-6 大阪市公債	100,000,000	104,153,300
地方債証券 合計			1,134,312,500
特殊債券	5 日本政策投資CO	100,000,000	102,690,800
	98 政保道路機構	100,000,000	103,187,100
	122 政保道路機構	100,000,000	102,980,300
	190 政保道路機構	100,000,000	103,513,900
	261 政保道路機構	100,000,000	102,829,100
	2 政保地方公営機	100,000,000	101,934,900

	3 6 地方公共団体	100,000,000	104,091,800	
	1 4 政保地方公共6	100,000,000	100,636,400	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	103,361,400	
	い7 8 9 利付商工債	100,000,000	100,211,800	
特殊債券	合計		1,025,437,500	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,453,000	
	2 5 東日本高速道	100,000,000	100,466,600	
	2 7 東日本高速道	100,000,000	100,447,600	
	3 3 中日本高速道	100,000,000	104,248,100	
	1 明治安田2 0 1 4基	100,000,000	100,508,900	
	3 5 みずほBK	100,000,000	100,422,300	
	6 2 トヨタファイナンス	100,000,000	100,434,000	
	1 6 4 オリックス	100,000,000	102,106,600	
	4 4 野村ホールディング	100,000,000	101,805,000	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	113,876,900	
	7 0 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,521,000	
社債券	合計		1,127,290,000	
合計			14,995,923,790	

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	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		1,633,564,159
コール・ローン		451,188,048
国債証券		162,325,211,598
派生商品評価勘定		370,031
未収入金		44,756
未収利息		1,200,173,652
前払費用		23,656,605
流動資産合計		165,634,208,849
資産合計		165,634,208,849
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,543,074
未払金		1,366,031,668
未払解約金		162,287,938
流動負債合計		1,529,862,680
負債合計		1,529,862,680
純資産の部		
元本等		
元本	※1	59,538,261,711
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		104,566,084,458
元本等合計		164,104,346,169
純資産合計		164,104,346,169
負債純資産合計		165,634,208,849

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 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。 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。 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。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成 29 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	平成 28 年 9 月 8 日
期首元本額	58,588,793,458 円
期中追加設定元本額	6,320,540,547 円
期中一部解約元本額	5,371,072,294 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VA	1,020,130,026 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私)	35,360,132 円

募)	
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
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
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
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
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
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
D-I's 外国債券インデックス	914,677円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	21,393円
iFree 外国債券インデックス	497,286,602円
iFree 8資産バランス	198,703,402円
DCダイワ外国債券インデックス	39,579,736,638円
ダイワ・ライフ・バランス30	623,165,132円
ダイワ・ライフ・バランス50	282,848,524円
ダイワ・ライフ・バランス70	178,451,800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
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
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
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	12,735,474円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	18,870,238円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,151,888円
ダイワ世界バランスファンド40VA	697,242,909円
ダイワ世界バランスファンド60VA	172,085,786円
ダイワ・バランスファンド3	6,446,530,502円

5VA	
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	458,929,261円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	264,927,846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
ダイワ・インデックスセレクト ト 外国債券	124,514,091円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	15,516,378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
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,637,411,782円
ダイワライフスタイル25	34,550,194円
ダイワライフスタイル50	58,020,752円
ダイワライフスタイル75	15,597,005円
計	59,538,261,711円
2. 期末日における受益権の総数	59,538,261,711口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成28年9月8日 至 平成29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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29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	
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	
国債証券		328,963,326
合計		328,963,326

(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)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			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	283,351,963	—	282,178,920	△1,173,043
アメリカ・ドル	129,246,870	—	128,242,800	△1,004,070
イギリス・ポンド	19,706,128	—	19,797,770	91,642
オーストラリア・ドル	11,329,110	—	11,356,800	27,690
カナダ・ドル	10,873,981	—	11,050,880	176,899
ユーロ	103,779,674	—	103,240,670	△539,004
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

(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。
- ① 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。
 - ② 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	
1 口当たり純資産額	2.7563 円
(1 万口当たり純資産額)	(27,563 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	3.75% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,488,000.000	2,560,774.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	3,161,000.000	3,227,791.930	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,096,000.000	3,191,635.440	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,621,000.000	2,737,896.600	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,198,206.600	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	4,280,000.000	4,513,217.200	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,245,241.650	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,953,205.040	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,671,008.370	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,364,784.600	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,696,279.450	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,587,036.620	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20180831	3,444,000.000	3,452,472.240	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180930	2,835,000.000	2,838,316.950	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	1,320,000.000	1,327,365.600	
2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,188,136.960	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,165,000.000	2,167,857.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,861,000.000	1,863,605.400	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,426,000.000	1,425,486.640	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,274,616.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190228	1,843,000.000	1,845,801.360	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190331	300,000.000	301,041.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190430	559,000.000	558,670.190	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,469,549.110	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,378,560.500	
1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,360,941.120	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,784,000.000	1,770,049.120	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,536,032.180	
1% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,872,000.000	1,861,030.080	
1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,201,399.900	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	882,753.560	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,152,381.760	
1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,343,529.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,884,889.860	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,366,901.560	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,403,331.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,962,843.840	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,153,109.600	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,673,287.500	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,441,873.210	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,460,409.360	

1. 875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2, 131, 000. 000	2, 159, 534. 090	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2, 827, 000. 000	2, 874, 465. 330	
2. 5% United States Treasury Note/Bond 20230815	2, 768, 000. 000	2, 875, 675. 200	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1, 993, 000. 000	2, 033, 477. 830	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1, 885, 000. 000	1, 916, 366. 400	
1. 25% United States Treasury Note/Bond 20181031	3, 611, 000. 000	3, 610, 422. 240	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2, 345, 000. 000	2, 366, 433. 300	
2. 75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5, 021, 000. 000	5, 288, 870. 350	
1. 25% United States Treasury Note/Bond 20181130	2, 638, 000. 000	2, 637, 577. 920	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2, 501, 000. 000	2, 542, 616. 640	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20181231	2, 026, 000. 000	2, 032, 159. 040	
2. 375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2, 006, 000. 000	2, 063, 812. 920	
2. 75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5, 229, 000. 000	5, 503, 522. 500	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20190131	2, 185, 000. 000	2, 191, 817. 200	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1, 647, 000. 000	1, 681, 339. 950	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20190228	2, 373, 000. 000	2, 380, 593. 600	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1, 734, 000. 000	1, 762, 576. 320	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20190331	2, 383, 000. 000	2, 396, 011. 180	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2, 821, 000. 000	2, 892, 822. 660	
2. 5% United States Treasury Note/Bond 20240515	5, 412, 000. 000	5, 613, 651. 120	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20190430	2, 975, 000. 000	2, 991, 719. 500	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2, 407, 000. 000	2, 467, 728. 610	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2, 241, 000. 000	2, 249, 045. 190	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2, 732, 000. 000	2, 776, 176. 440	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2, 885, 000. 000	2, 901, 877. 250	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3, 485, 000. 000	3, 559, 857. 800	
8. 875% United States Treasury Note/Bond 20190215	904, 000. 000	1, 003, 331. 520	
8. 125% United States Treasury Note/Bond 20190815	724, 000. 000	818, 568. 880	
8. 75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642, 000. 000	777, 089. 640	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2, 106, 000. 000	2, 654, 697. 240	

6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	818,265.180	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,120,981.950	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	865,607.400	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	970,996.770	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	929,572.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	965,163.780	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	620,812.500	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,395,949.120	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,241,000.000	1,696,968.220	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,926,000.000	2,539,007.280	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	766,182.900	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	713,896.040	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	687,104.100	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	849,000.000	982,980.690	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,437,940.330	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	760,000.000	1,007,532.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,579,134.700	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,307,952.800	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,931,553.860	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,940,765.440	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,890,749.900	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,416,538.420	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,790,920.950	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,640,400.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,575,164.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,762,594.230	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,853,000.000	1,968,367.780	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,756,826.520	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	3,030,000.000	3,070,935.300	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,026,000.000	2,192,820.840	

2. 875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,998,000.000	4,136,050.940	
3. 625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,314,000.000	3,900,909.400	
3. 75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,305,866.020	
3. 625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,264,949.380	
3. 375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,138,407.480	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,345,989.260	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,905,728.540	
2. 375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,162,000.000	5,314,795.200	
3. 125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	4,037,798.490	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20190831	2,989,000.000	3,007,322.570	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,321,425.700	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,433,785.000	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,699,747.500	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,202,185.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,197,132.140	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20241115	3,921,000.000	3,999,106.320	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,913,694.400	
1. 875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,918,121.180	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,341,045.750	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,234,091.260	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,218,017.440	
1. 25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,953,845.470	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,412,583.620	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,749,719.310	
2. 5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,605,706.600	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,789,087.320	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,817,194.770	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,792,865.520	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,902,274.900	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,839,050.160	

3% United States Treasury Note/Bond 20450515	4,035,000.000	4,265,721.300	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,606,895.720	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,621,168.120	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,851,829.640	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	3,021,797.960	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	3,019,636.210	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,877,420.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,154,217.550	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,209,963.590	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	6,143,000.000	6,132,434.040	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,685,763.880	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,464,853.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,863,956.120	
1% United States Treasury Note/Bond 20180915	2,179,000.000	2,173,465.340	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,476,227.120	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,870,593.120	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20181015	2,057,000.000	2,048,401.740	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,933,498.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,107,960.720	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,919,077.760	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,576,571.080	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,138,000.000	2,138,235.180	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,110,984.640	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	2,687,000.000	2,722,253.440	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181215	2,151,000.000	2,150,397.720	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,068,895.930	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	2,492,000.000	2,540,070.680	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190115	2,146,000.000	2,142,394.720	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,113,277.180	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,186,560.960	

0.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	2,065,000.000	2,049,739.650	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,559,386.570	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,275,076.920	
1% United States Treasury Note/Bond 20190315	2,100,000.000	2,091,054.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,266,578.620	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,262,000.000	2,229,653.400	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,973,841.240	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,091,155.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190415	1,905,000.000	1,892,560.350	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,029,000.000	5,815,573.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,436,206.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,050,914.600	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,267,869.640	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190515	2,507,000.000	2,489,852.120	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,682,909.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,476,350.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190615	2,100,000.000	2,084,817.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,459,950.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,928,030.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190715	2,500,000.000	2,474,700.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,333,552.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,145,050.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,500,000.000	2,473,525.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180831	2,200,000.000	2,189,594.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,634,066.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,637,840.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,691,373.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,338,488.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190915	2,600,000.000	2,577,536.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180930	3,000,000.000	2,983,920.000	

1. 375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,439,043.350	
1. 125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,985,662.160	
1% United States Treasury Note/Bond 20191015	2,147,000.000	2,132,980.090	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	2,326,000.000	2,312,439.420	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,454,405.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,957,100.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,468,925.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,650,000.000	3,760,631.500	
1% United States Treasury Note/Bond 20191115	1,400,000.000	1,390,088.000	
1% United States Treasury Note/Bond 20181130	1,000,000.000	996,750.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,531,035.200	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,412,936.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20191215	1,440,000.000	1,441,180.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	2,030,780.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,400,000.000	1,399,496.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,557,600.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200115	1,500,000.000	1,501,110.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,700,000.000	1,696,736.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	4,040,000.000	4,088,884.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,039,859.200	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,535,800.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,875,000.000	4,093,240.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,130,000.000	2,131,065.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,300,000.000	2,295,400.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,040,100.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,333,235.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315	1,900,000.000	1,912,464.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190331	1,850,000.000	1,849,204.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	5,000,000.000	5,071,050.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	900,000.000	908,577.000	

	1.5% United States Treasury Note/Bond 20200415	850,000.000	852,822.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,828,649.000	
	3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,700,000.000	2,853,765.000	
	1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,026,940.000	
	2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,018,030.000	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	4,000,000.000	4,012,480.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,010,290.000	
	1.25% United States Treasury Note/Bond 20190531	4,000,000.000	3,997,640.000	
	2% United States Treasury Note/Bond 20240531	2,000,000.000	2,011,080.000	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615	2,700,000.000	2,708,316.000	
	1.25% United States Treasury Note/Bond 20190630	4,000,000.000	3,996,400.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,008,670.000	
	2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,412,168.000	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715	2,000,000.000	2,005,220.000	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,000,000.000	1,001,360.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	2,200,000.000	2,228,512.000	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815	1,300,000.000	1,303,198.000	
	1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,924,447.000	
	2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,038,190.000	
	2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	900,000.000	904,914.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 639,125,895.090 (69,786,156,485)	
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	2,398,605.600	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	2,121,000.000	2,322,410.160	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,582,718.360	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,182,000.000	1,583,407.200	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,175,000.000	1,234,079.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	310,000.000	311,333.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	460,000.000	441,600.000	

1.75% United Kingdom Gilt 20370907	200,000.000	203,360.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20570722	600,000.000	635,940.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	510,000.000	519,052.500	
0.75% United Kingdom Gilt 20230722	500,000.000	505,375.000	
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,423,144.840	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,445,801.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,490,000.000	2,059,031.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,934,355.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,908,604.800	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,276,999.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,923,432.320	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	3,031,870.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,319,034.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,620,203.200	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,666,000.000	2,633,279.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,590,000.000	2,265,750.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,515,843.700	
4.5% United Kingdom Gilt 20190307	1,573,000.000	1,675,701.170	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,841,961.800	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,610,803.920	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,870,000.000	2,711,687.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,428,000.000	1,531,615.680	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,244,000.000	2,202,875.200	
3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,987,675.300	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,362,030.600	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	1,633,000.000	1,861,913.940	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,352,000.000	2,129,129.600	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,391,720.760	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,156,000.000	2,860,580.800	
2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,138,452.720	

	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,770,289.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20190722	2,251,000.000	2,317,629.600	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,842,000.000	2,105,682.300	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	2,956,183.200	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 79,551,164.570 (11,335,245,440)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	2,455,000.000	2,585,213.200	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,420,000.000	2,738,423.600	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,409,000.000	2,567,921.730	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,517,476.040	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,421,586.640	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,072,340.410	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,532,352.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,314,000.000	1,387,176.660	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,532,311.980	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,408,000.000	1,690,754.560	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20181021	1,197,000.000	1,217,875.680	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,230,144.640	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	2,011,000.000	2,049,148.670	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	863,000.000	943,811.320	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	534,597.460	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,179,217.950	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	712,000.000	715,830.560	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,142,000.000	2,170,938.420	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,978,000.000	1,906,495.300	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	682,000.000	629,806.540	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	700,000.000	696,934.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,200,000.000	1,209,600.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 41,529,957.360	

			(3, 633, 871, 270)
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル
	2. 75% Canada Government International Bond 20641201	325, 000. 000	367, 919. 500
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386, 000. 000	592, 760. 900
	5. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983, 000. 000	1, 358, 732. 090
	5. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1, 127, 000. 000	1, 660, 285. 130
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1, 192, 000. 000	1, 704, 083. 200
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1, 524, 000. 000	1, 584, 319. 920
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1, 363, 000. 000	1, 770, 523. 370
	3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1, 876, 000. 000	1, 976, 422. 280
	3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956, 000. 000	1, 015, 004. 320
	2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1, 751, 000. 000	1, 841, 596. 740
	3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1, 561, 000. 000	1, 927, 491. 580
	1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1, 253, 000. 000	1, 239, 029. 050
	1. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180901	1, 021, 000. 000	1, 019, 876. 900
	2. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1, 405, 000. 000	1, 468, 618. 400
	1. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190301	853, 000. 000	857, 631. 790
	1. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1, 627, 000. 000	1, 636, 827. 080
	2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1, 047, 000. 000	1, 142, 381. 700
	2. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1, 156, 000. 000	1, 189, 616. 480
	1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1, 719, 000. 000	1, 720, 667. 430
	0. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1, 831, 000. 000	1, 790, 772. 930
	1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1, 129, 000. 000	1, 092, 488. 140
	0. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1, 237, 000. 000	1, 204, 306. 090
	0. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1, 480, 000. 000	1, 434, 105. 200
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1, 240, 000. 000	1, 136, 274. 000
	0. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20181101	1, 470, 000. 000	1, 455, 476. 400
	0. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840, 000. 000	799, 822. 800
	0. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190201	1, 620, 000. 000	1, 600, 236. 000
	0. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190501	900, 000. 000	890, 352. 000
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	700, 000. 000	678, 090. 000

	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190801	460,000.000	454,112.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20191101	500,000.000	497,875.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	300,000.000	299,646.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 39,407,344.420 (3,515,923,269)	
シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	491,000.000	504,502.500	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	734,488.800	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	872,468.080	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	470,324.400	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	599,000.000	611,914.440	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	503,000.000	542,737.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	388,258.500	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	509,107.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	435,600.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	520,361.800	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	238,000.000	273,864.220	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	135,087.500	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	415,000.000	418,112.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	124,000.000	128,526.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	228,211.200	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	318,000.000	348,661.560	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	254,300.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	190,000.000	188,765.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	202,264.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	150,000.000	150,286.500	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 7,917,841.500 (640,949,270)	
スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	404,000.000	505,202.000	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	497,000.000	714,064.750	

	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	517,000.000	550,455.070	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	407,000.000	442,209.570	
	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	362,000.000	398,047.960	
スイス・フラン	小計		スイス・フラン 2,609,979.350 (298,059,641)	
スウェーデン・ク ローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,095,000.000	10,680,258.500	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	8,385,000.000	9,013,707.300	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,671,533.450	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,895,161.750	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,591,215.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,909,333.850	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	5,888,910.400	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,950,000.000	2,947,905.500	
スウェーデン・クローナ	小計		スウェーデン・クローナ 57,598,025.750 (789,668,933)	
デンマーク・ク ローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	19,588,243.600	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	9,476,237.760	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	8,050,000.000	9,204,531.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,329,291.580	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	8,363,000.000	9,429,115.240	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20181115	3,164,000.000	3,198,297.760	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	2,600,000.000	2,605,720.000	
デンマーク・クローネ	小計		デンマーク・クローネ 58,831,436.940 (1,029,550,147)	
ノルウェー・ク ローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	7,075,000.000	7,546,407.250	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,741,397.540	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,224,000.000	5,489,013.520	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,563,181.350	

	1. 75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,508,664.600	
	1. 5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,376,472.800	
	1. 75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	2,450,000.000	2,508,138.500	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 34,733,275.560 (486,265,858)	
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	2,659,968.000	
	5. 5% Poland Government Bond 20191025	1,912,000.000	2,060,944.800	
	1. 5% Poland Government Bond 20200425	2,478,000.000	2,457,432.600	
	2. 5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,230,607.050	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,115,301.500	
	Poland Government Bond 20181025	2,758,000.000	2,713,182.500	
	1. 75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	2,997,912.600	
	2. 5% Poland Government Bond 20270725	1,820,000.000	1,716,078.000	
	2. 25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,302,136.000	
	Poland Government Bond 20190425	400,000.000	391,540.000	
	5. 75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,042,665.060	
	5. 25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,476,636.800	
	5. 75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,231,749.200	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,389,538.750	
	3. 25% Poland Government Bond 20190725	1,840,000.000	1,895,384.000	
	3. 25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,643,208.650	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 34,324,285.510 (1,052,039,351)	
マレーシア・リングgit		マレーシア・リングgit	マレーシア・リングgit	
	5. 734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	647,000.000	675,856.200	
	3. 502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	547,512.960	
	5. 248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	801,527.040	
	4. 378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,638,586.600	
	4. 498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,199,074.420	
	4. 16% MALAYSIAN GOVERNMENT	1,916,000.000	1,958,995.040	

20210715			
4. 392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1, 514, 000. 000	1, 560, 313. 260	
4. 232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	650, 000. 000	645, 450. 000	
3. 58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	895, 000. 000	899, 922. 500	
3. 418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875, 000. 000	864, 316. 250	
3. 892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731, 000. 000	722, 293. 790	
4. 127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618, 000. 000	602, 006. 160	
3. 492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1, 044, 000. 000	1, 046, 787. 480	
3. 48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1, 001, 000. 000	985, 484. 500	
3. 844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	477, 000. 000	452, 701. 620	
3. 733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586, 000. 000	568, 420. 000	
3. 889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656, 000. 000	664, 659. 200	
4. 935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600, 000. 000	612, 612. 000	
4. 181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1, 057, 000. 000	1, 076, 427. 660	
4. 048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857, 000. 000	873, 094. 460	
3. 654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	648, 000. 000	652, 471. 200	
3. 955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737, 000. 000	740, 095. 400	
3. 659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700, 000. 000	704, 676. 000	
3. 795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1, 161, 000. 000	1, 165, 760. 100	
4. 254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820, 000. 000	802, 222. 400	
3. 759% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190315	768, 000. 000	775, 142. 400	
3. 8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702, 000. 000	701, 298. 000	
4. 736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	630, 000. 000	630, 579. 600	
3. 9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650, 000. 000	652, 047. 500	
3. 62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352, 000. 000	352, 704. 000	
3. 882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500, 000. 000	506, 440. 000	
4. 059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	600, 000. 000	608, 232. 000	
3. 899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	350, 000. 000	350, 829. 500	
4. 762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	500, 000. 000	516, 915. 000	
マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 27, 555, 454. 240	

			(712, 584, 047)
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, 692, 923. 480
	5. 75% Mexican Bonos 20260305	11, 290, 000. 000	10, 506, 812. 700
	8% Mexican Bonos 20471107	3, 500, 000. 000	3, 822, 770. 000
	8% Mexican Bonos 20231207	10, 633, 000. 000	11, 289, 694. 080
	10% Mexican Bonos 20241205	22, 119, 000. 000	26, 171, 421. 990
	7. 5% Mexican Bonos 20270603	10, 668, 000. 000	11, 151, 473. 760
	10% Mexican Bonos 20361120	6, 874, 000. 000	8, 895, 368. 440
	8. 5% Mexican Bonos 20290531	8, 844, 000. 000	9, 942, 601. 680
	8. 5% Mexican Bonos 20181213	22, 092, 000. 000	22, 509, 759. 720
	8. 5% Mexican Bonos 20381118	9, 694, 000. 000	11, 078, 400. 140
	8% Mexican Bonos 20200611	18, 928, 000. 000	19, 581, 962. 400
	6. 5% Mexican Bonos 20210610	27, 826, 000. 000	27, 581, 965. 980
	7. 75% Mexican Bonos 20310529	13, 015, 000. 000	13, 808, 264. 250
	6. 5% Mexican Bonos 20220609	13, 099, 000. 000	12, 953, 994. 070
	7. 75% Mexican Bonos 20421113	15, 654, 000. 000	16, 645, 211. 280
	7. 75% Mexican Bonos 20341123	6, 944, 000. 000	7, 375, 291. 840
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 234, 007, 915. 810 (1, 439, 148, 682)
ユーロ		ユーロ	ユーロ
	0. 375% Finland Government Bond 20200915	432, 000. 000	443, 910. 240
	0. 75% Finland Government Bond 20310415	414, 000. 000	410, 899. 140
	0. 875% Finland Government Bond 20250915	279, 000. 000	293, 005. 800
	0. 5% Finland Government Bond 20260415	411, 000. 000	416, 774. 550
	Finland Government Bond 20230915	200, 000. 000	200, 682. 000
	Finland Government Bond 20220415	270, 000. 000	273, 936. 600
	0. 25% Austria Government Bond 20191018	527, 000. 000	536, 770. 580
	1. 2% Austria Government Bond 20251020	873, 000. 000	938, 553. 570
	0. 75% Austria Government Bond 20261020	576, 000. 000	591, 448. 320
	1. 5% Austria Government Bond 20470220	734, 000. 000	741, 494. 140
	1. 5% Austria Government Bond 20861102	150, 000. 000	135, 145. 500
	Austria Government Bond 20230715	300, 000. 000	301, 467. 000
	0. 5% Austria Government Bond 20270420	380, 000. 000	378, 924. 600
	0. 8% Belgium Government Bond 20250622	1, 399, 000. 000	1, 450, 189. 410
	1% Belgium Government Bond 20310622	924, 000. 000	918, 095. 640
	1. 9% Belgium Government Bond 20380622	558, 000. 000	606, 947. 760
	1% Belgium Government Bond 20260622	1, 283, 000. 000	1, 339, 849. 730
	1. 6% Belgium Government Bond 20470622	1, 044, 000. 000	1, 015, 603. 200

2. 15% Belgium Government Bond 20660622	290,000.000	308,241.000	
0. 2% Belgium Government Bond 20231022	150,000.000	152,031.000	
0. 8% Belgium Government Bond 20270622	600,000.000	608,046.000	
0. 5% Belgium Government Bond 20241022	250,000.000	255,180.000	
2. 25% Belgium Government Bond 20570622	260,000.000	287,445.600	
1. 45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	303,453.000	
6. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,174,000.000	1,655,633.500	
6. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,567,000.000	2,518,764.460	
5. 625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,100,067.800	
4. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,392,130.000	
6. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,609,729.170	
5. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,370,057.440	
4. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,907,095.000	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,245,174.160	
4. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,037,089.250	
4. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,500,418.710	
3. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	2,844,261.000	
3. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,676,031.410	
3. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,269,738.750	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,132,078.800	
3. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	2,197,350.760	
2. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,572,877.000	
2. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,579,808.070	
3. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,922,421.600	
2. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,575,843.050	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	3,115,320.880	
1. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,458,398.580	
2. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,728,000.000	2,299,121.280	
1. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,801,643.160	
1. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,551,352.500	

1. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1, 817, 000. 000	2, 003, 660. 410	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1, 599, 000. 000	1, 814, 801. 040	
1. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1, 561, 000. 000	1, 758, 076. 250	
2. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1, 959, 000. 000	2, 631, 367. 980	
1. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1, 594, 000. 000	1, 771, 842. 580	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1, 542, 000. 000	1, 662, 877. 380	
0. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2, 394, 000. 000	2, 492, 728. 560	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2, 134, 000. 000	2, 300, 003. 860	
0. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2, 168, 000. 000	2, 240, 693. 040	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2, 850, 000. 000	2, 804, 229. 000	
0. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1, 000, 000. 000	998, 300. 000	
0. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	700, 000. 000	711, 158. 000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20180914	700, 000. 000	705, 446. 000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20181214	950, 000. 000	959, 224. 500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20190315	1, 000, 000. 000	1, 011, 910. 000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20190614	400, 000. 000	405, 540. 000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20181012	1, 209, 000. 000	1, 232, 623. 860	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190222	1, 438, 000. 000	1, 475, 862. 540	
0. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190412	1, 113, 000. 000	1, 135, 749. 720	
0. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1, 151, 000. 000	1, 175, 355. 160	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1, 731, 000. 000	1, 763, 283. 150	
0. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1, 448, 000. 000	1, 489, 528. 640	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1, 578, 000. 000	1, 612, 353. 060	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1, 700, 000. 000	1, 737, 230. 000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	360, 000. 000	367, 639. 200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	400, 000. 000	407, 424. 000	
8. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653, 000. 000	780, 648. 440	
8. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985, 000. 000	1, 466, 832. 450	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2, 225, 000. 000	3, 251, 170. 000	
5. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2, 623, 000. 000	3, 989, 084. 630	

5. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,007,000.000	4,972,916.460	
4. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,709,000.000	4,223,683.170	
4. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,075,000.000	3,320,415.750	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,564,000.000	2,509,047.000	
3. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,729,261.100	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,824,000.000	4,179,943.600	
4. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,697,000.000	4,673,636.490	
4. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	2,567,000.000	2,708,544.380	
4. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,734,000.000	4,376,204.440	
3. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	3,263,000.000	3,568,938.880	
3. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,380,000.000	3,741,896.600	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,017,000.000	1,668,958.020	
3. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,969,905.940	
2. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,409,295.340	
3. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,550,000.000	4,085,695.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	4,186,515.300	
2. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,099,000.000	3,724,378.200	
2. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	3,032,743.560	
3. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,238,000.000	3,034,190.880	
1. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,698,635.820	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181125	1,920,000.000	1,957,286.400	
2. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,535,475.900	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190525	2,264,000.000	2,326,554.320	
2. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,300,699.840	
1. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,799,000.000	3,113,523.630	
0. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2,322,000.000	2,378,192.400	
0. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2,792,000.000	2,836,588.240	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3,070,000.000	3,114,146.600	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,101,000.000	2,207,016.460	
0. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,244,447.780	

1. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	2, 720, 000. 000	2, 876, 400. 000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20190225	1, 592, 000. 000	1, 606, 471. 280	
0. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2, 737, 000. 000	2, 740, 722. 320	
1. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1, 079, 000. 000	1, 058, 067. 400	
1. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	587, 000. 000	564, 024. 820	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2, 170, 000. 000	2, 202, 571. 700	
0. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2, 400, 000. 000	2, 331, 144. 000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	2, 000, 000. 000	2, 022, 380. 000	
1. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	620, 000. 000	653, 046. 000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200225	700, 000. 000	709, 751. 000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2, 500, 000. 000	2, 580, 825. 000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	800, 000. 000	847, 800. 000	
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548, 000. 000	777, 485. 960	
5. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1, 239, 000. 000	1, 875, 759. 270	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1, 355, 000. 000	2, 104, 735. 050	
3. 75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791, 000. 000	962, 330. 600	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1, 347, 000. 000	1, 465, 576. 410	
3. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1, 146, 000. 000	1, 282, 683. 420	
3. 75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1, 349, 000. 000	2, 134, 239. 410	
3. 25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1, 463, 000. 000	1, 676, 861. 340	
2. 25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1, 438, 000. 000	1, 619, 849. 480	
2. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1, 168, 000. 000	1, 459, 988. 320	
1. 75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1, 385, 000. 000	1, 541, 131. 050	
1. 25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115	924, 000. 000	949, 021. 920	
2. 75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1, 084, 000. 000	1, 510, 781. 640	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1, 514, 000. 000	1, 720, 888. 100	
0. 25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1, 374, 000. 000	1, 404, 365. 400	
0. 25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1, 291, 000. 000	1, 298, 862. 190	
0. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1, 338, 000. 000	1, 358, 417. 880	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1, 200, 000. 000	1, 220, 700. 000	

0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	900,000.000	923,256.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,617,314.860	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,614,705.900	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,366,931.360	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,933,651.440	
1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,480,416.950	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,456,050.970	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,676,892.600	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,671,327.770	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,602,831.800	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,535,568.860	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,591,000.000	1,622,294.970	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,549,781.760	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20181015	1,171,000.000	1,179,091.610	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	785,075.940	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,310,745.600	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,355,650.220	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,262,967.740	
0.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190415	812,000.000	816,027.520	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,679,340.060	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	860,013.000	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,484,394.240	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	678,363.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,350,245.820	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	448,000.000	382,820.480	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191015	858,000.000	860,436.720	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	900,000.000	884,799.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,060,000.000	1,077,776.200	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	300,000.000	308,793.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	350,000.000	357,934.500	

0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	120,000.000	120,776.400	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	600,000.000	622,668.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,000,000.000	997,950.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	702,254.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,654,000.000	3,489,585.360	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,037,944.680	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,455,000.000	2,049,367.500	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190201	2,074,000.000	2,203,770.180	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,127,488.290	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,098,000.000	2,765,394.780	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,298,561.200	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	3,084,116.040	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,734,000.000	2,303,341.560	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,722,832.110	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190301	2,708,000.000	2,896,910.080	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	2,531,000.000	2,750,184.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,629,729.980	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,691,182.610	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,828,416.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,468,034.360	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,514,863.700	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,401,537.280	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,666,899.580	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,397,660.160	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	2,037,364.350	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,353,502.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,810,000.000	2,263,567.900	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,252,477.380	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,363,000.000	1,753,976.550	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,625,647.560	

3. 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20181201	2, 111, 000. 000	2, 209, 309. 270	
3. 75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1, 729, 000. 000	1, 942, 773. 560	
2. 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190501	1, 100, 000. 000	1, 149, 049. 000	
3. 75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2, 201, 000. 000	2, 534, 825. 670	
3. 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1, 938, 000. 000	2, 180, 133. 720	
2. 15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1, 593, 000. 000	1, 699, 476. 120	
1. 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	1, 246, 000. 000	1, 285, 012. 260	
5. 5% Belgium Government Bond 20280328	1, 706, 000. 000	2, 555, 536. 820	
5% Belgium Government Bond 20350328	1, 704, 000. 000	2, 741, 616. 720	
4% Belgium Government Bond 20220328	1, 377, 000. 000	1, 652, 262. 300	
4% Belgium Government Bond 20190328	1, 121, 000. 000	1, 201, 532. 640	
3. 75% Belgium Government Bond 20200928	1, 736, 000. 000	1, 965, 308. 240	
4. 25% Belgium Government Bond 20410328	1, 674, 000. 000	2, 598, 818. 040	
4. 25% Belgium Government Bond 20210928	1, 446, 000. 000	1, 723, 010. 220	
4. 5% Belgium Government Bond 20260328	1, 001, 000. 000	1, 349, 828. 480	
4. 25% Belgium Government Bond 20220928	1, 316, 000. 000	1, 618, 627. 360	
4% Belgium Government Bond 20320328	680, 000. 000	955, 196. 000	
3% Belgium Government Bond 20190928	1, 123, 000. 000	1, 206, 169. 380	
2. 25% Belgium Government Bond 20230622	1, 338, 000. 000	1, 521, 560. 220	
3. 75% Belgium Government Bond 20450622	753, 000. 000	1, 109, 726. 220	
2. 6% Belgium Government Bond 20240622	1, 505, 000. 000	1, 758, 818. 250	
3% Belgium Government Bond 20340622	597, 000. 000	763, 533. 150	
4. 5% IRISH TREASURY 20181018	759, 000. 000	801, 207. 990	
4. 4% IRISH TREASURY 20190618	684, 000. 000	744, 588. 720	
5. 9% IRISH TREASURY 20191018	570, 000. 000	647, 554. 200	
5. 4% IRISH TREASURY 20250313	1, 131, 000. 000	1, 545, 206. 130	
5% IRISH TREASURY 20201018	765, 000. 000	895, 723. 200	
3. 9% IRISH TREASURY 20230320	504, 000. 000	612, 153. 360	
3. 4% IRISH TREASURY 20240318	607, 000. 000	732, 218. 030	
2. 4% IRISH TREASURY 20300515	761, 000. 000	874, 191. 140	
0. 8% IRISH TREASURY 20220315	516, 000. 000	539, 292. 240	
2% IRISH TREASURY 20450218	681, 000. 000	710, 800. 560	
1% IRISH TREASURY 20260515	673, 000. 000	692, 187. 230	
1. 7% IRISH TREASURY 20370515	350, 000. 000	356, 275. 500	
4. 5% IRISH TREASURY 20200418	1, 035, 000. 000	1, 170, 460. 800	

6. 25% Austria Government Bond 20270715	985,000.000	1,540,727.150	
3. 9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,407,881.280	
3. 5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,550,438.680	
4. 15% Austria Government Bond 20370315	1,073,000.000	1,645,477.690	
4. 35% Austria Government Bond 20190315	989,000.000	1,064,440.920	
4. 85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,214,290.000	
3. 65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	945,050.720	
3. 4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	1,038,770.000	
3. 8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	539,801.820	
1. 95% Austria Government Bond 20190618	738,000.000	772,117.740	
3. 15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	874,679.540	
1. 75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,066,503.900	
2. 4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	752,844.510	
1. 15% Austria Government Bond 20181019	426,000.000	434,507.220	
1. 65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,034,221.760	
4. 375% Finland Government Bond 20190704	416,000.000	454,529.920	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	864,858.880	
3. 375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	697,810.160	
3. 5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	525,155.670	
2. 75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	478,154.910	
1. 625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	669,870.720	
1. 5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	487,353.120	
2. 625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	542,604.260	
1. 125% Finland Government Bond 20180915	425,000.000	433,024.000	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	597,807.030	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,952,000.000	2,834,050.240	
1. 6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,820,645.750	
1. 95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,552,000.000	1,567,675.200	
2. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,929,195.520	
1. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,250,000.000	1,297,562.500	

1. 95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1, 733, 000. 000	1, 831, 139. 790	
0. 25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190131	1, 672, 000. 000	1, 686, 011. 360	
0. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1, 747, 000. 000	1, 795, 933. 470	
2. 9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1, 252, 000. 000	1, 278, 241. 920	
3. 45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	400, 000. 000	429, 836. 000	
1. 3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1, 730, 000. 000	1, 726, 349. 700	
0. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	580, 000. 000	584, 669. 000	
1. 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1, 800, 000. 000	1, 808, 334. 000	
2. 35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	550, 000. 000	562, 820. 500	
1. 45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1, 300, 000. 000	1, 287, 195. 000	
0. 05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	300, 000. 000	300, 942. 000	
5. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1, 979, 000. 000	2, 936, 974. 530	
4. 2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1, 654, 000. 000	2, 132, 651. 060	
4. 9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1, 428, 000. 000	2, 015, 107. 920	
4. 8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1, 682, 000. 000	2, 116, 460. 600	
4. 6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2, 382, 000. 000	2, 605, 026. 660	
4. 3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1, 775, 000. 000	1, 950, 174. 750	
4. 7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1, 373, 000. 000	1, 898, 886. 460	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2, 101, 000. 000	2, 334, 000. 900	
4. 65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1, 789, 000. 000	2, 273, 318. 080	
4. 85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1, 681, 000. 000	1, 943, 219. 190	
5. 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2, 515, 000. 000	3, 019, 156. 900	
5. 9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1, 965, 000. 000	2, 726, 358. 900	
5. 85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1, 978, 000. 000	2, 472, 401. 100	
5. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2, 608, 000. 000	3, 301, 467. 200	
4. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1, 601, 000. 000	1, 966, 348. 200	
5. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1, 270, 000. 000	1, 724, 431. 400	
3. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20181031	1, 754, 000. 000	1, 838, 156. 920	
5. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1, 049, 000. 000	1, 539, 585. 830	
2. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190430	1, 836, 000. 000	1, 929, 856. 320	

	3. 8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,356,514.000	
	2. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,364,954.660	
	1. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,974,119.000	
ユーロ 小計			ユーロ 512,362,943.570 (66,699,407,994)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20181221	2,978,000.000	3,019,245.300	
	7. 25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,790,783.600	
	10. 5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	15,434,000.000	17,474,374.800	
	6. 25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	5,506,216.320	
	6. 75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,544,581.500	
	6. 5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,348,552.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,558,530.070	
	7. 75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	5,539,000.000	5,548,693.250	
	8. 75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	13,452,000.000	12,232,576.200	
	8. 5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	10,021,000.000	9,078,424.740	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	8,862,000.000	8,212,858.500	
	8. 75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	7,944,000.000	7,209,497.760	
	8. 25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	8,243,000.000	7,610,349.750	
	8. 875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	4,166,000.000	3,954,283.880	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	2,179,000.000	2,039,979.800	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 106,128,947.470 (906,341,211)	
国債証券 合計			162,325,211,598 [162,325,211,598]	
合計			162,325,211,598 [162,325,211,598]	

- (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 241 銘柄	100%	43.0%
イギリス・ポンド	国債証券 41 銘柄	100%	7.0%

オーストラリア・ドル	国債証券	22 銘柄	100%	2.2%
カナダ・ドル	国債証券	32 銘柄	100%	2.2%
シンガポール・ドル	国債証券	20 銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券	5 銘柄	100%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8 銘柄	100%	0.5%
デンマーク・クローネ	国債証券	7 銘柄	100%	0.6%
ノルウェー・クローネ	国債証券	7 銘柄	100%	0.3%
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%	0.4%
メキシコ・ペソ	国債証券	16 銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	296 銘柄	100%	41.1%
南アフリカ・ランド	国債証券	15 銘柄	100%	0.6%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「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	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		34,244,925
コール・ローン		107,945,438
国債証券		6,315,666,071
派生商品評価勘定		809,390
未収入金		178,879
未収利息		83,411,736
前払費用		14,004,347
流動資産合計		6,556,260,786
資産合計		6,556,260,786
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		311,933
未払金		27,939,820
未払解約金		9,969,725
流動負債合計		38,221,478
負債合計		38,221,478
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(△)		1,848,747,907
元本等合計		6,518,039,308
純資産合計		6,518,039,308
負債純資産合計		6,556,260,786

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 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。 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。 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。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成 29 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	平成 28 年 9 月 8 日
期首元本額	2,931,373,375 円
期中追加設定元本額	2,312,923,214 円
期中一部解約元本額	575,005,188 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	114,332,817 円
債券インデックス エマージ	
ングプラス (為替ヘッジなし)	
ダイワファンドラップオンラ	148,072,122 円

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)	
D-I's 新興国債券インデ ックス	38,217,127 円
iFree 新興国債券イン デックス	628,484,771 円
iFree 8資産バランス	393,425,900 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
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国債券	180,636,804 円
ダイワ・ノーロード 新興国債 券ファンド	24,627,638 円
計	4,669,291,401 円
2. 期末日における受益権の総数	4,669,291,401 口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成 29 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	
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	
国債証券		54,647,085
合計		54,647,085

(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)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			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	103,316,843	—	103,814,300	497,457
チェコ・コルナ	16,547,229	—	16,467,000	△80,229
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
ポーランド・ ズロチ	24,117,858	—	24,201,600	83,742
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
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
----	-------------	---	-------------	---------

(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。
- ① 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。
 - ② 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
1 口当たり純資産額	1.3959 円
(1 万口当たり純資産額)	(13,959 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	18.2% REPUBLIC OF ARGENTINA 20211003	3,100,000,000	3,178,678,000	
		16% REPUBLIC OF ARGENTINA 20231017	1,400,000,000	1,391,362,000	
		15.5% REPUBLIC OF ARGENTINA 20261017	5,000,000,000	5,250,750,000	
	アルゼンチン・ペソ 小計			アルゼンチン・ペソ 9,820,790,000 (62,263,809)	
	インドネシア・ルピア		8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	5,750,000,000,000	6,401,992,500,000
8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515			4,000,000,000,000	4,618,360,000,000	
11% Indonesia Treasury Bond 20201115			2,400,000,000,000	2,733,264,000,000	
12.8% Indonesia Treasury Bond 20210615			600,000,000,000	731,958,000,000	
11% Indonesia Treasury Bond			1,000,000,000,000	1,268,510,000,000	

	20250915			
	10. 5% Indonesia Treasury Bond 20300815	2, 180, 000, 000. 000	2, 799, 686, 800. 000	
	8. 25% Indonesia Treasury Bond 20210715	5, 710, 000, 000. 000	6, 119, 007, 300. 000	
	9. 5% Indonesia Treasury Bond 20310715	1, 270, 000, 000. 000	1, 535, 493, 500. 000	
	8. 375% Indonesia Treasury Bond 20260915	6, 324, 000, 000. 000	7, 056, 129, 480. 000	
	8. 25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4, 750, 000, 000. 000	5, 235, 830, 000. 000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20270515	4, 230, 000, 000. 000	4, 366, 375, 200. 000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20220515	4, 460, 000, 000. 000	4, 613, 201, 000. 000	
	5. 625% Indonesia Treasury Bond 20230515	1, 410, 000, 000. 000	1, 358, 140, 200. 000	
	6. 125% Indonesia Treasury Bond 20280515	1, 200, 000, 000. 000	1, 133, 484, 000. 000	
	6. 625% Indonesia Treasury Bond 20330515	1, 975, 000, 000. 000	1, 873, 386, 250. 000	
	8. 375% Indonesia Treasury Bond 20340315	4, 720, 000, 000. 000	5, 245, 572, 000. 000	
	8. 375% Indonesia Treasury Bond 20240315	6, 350, 000, 000. 000	6, 987, 730, 500. 000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	4, 920, 000, 000. 000	5, 750, 938, 800. 000	
	7. 875% Indonesia Treasury Bond 20190415	3, 900, 000, 000. 000	4, 015, 479, 000. 000	
	インドネシア・ルピア 小計		インドネシア・ルピア 73, 844, 538, 530. 000 (605, 525, 216)	
ウルグアイ・ペソ	9. 875% Uruguay Government International Bond 20220620	ウルグアイ・ペソ 2, 300, 000. 000	ウルグアイ・ペソ 2, 461, 000. 000	
	ウルグアイ・ペソ 小計		ウルグアイ・ペソ 2, 461, 000. 000 (9, 327, 190)	
コロンビア・ペソ	9. 85% Colombia Government International Bond 20270628	コロンビア・ペソ 90, 000, 000. 000	コロンビア・ペソ 113, 369, 400. 000	
	7. 75% Colombia Government International Bond 20210414	95, 000, 000. 000	102, 010, 050. 000	
	4. 375% Colombia Government International Bond 20230321	45, 000, 000. 000	42, 438, 600. 000	
	5% Colombian TES 20181121	520, 000, 000. 000	519, 422, 800. 000	
	7% Colombian TES 20190911	735, 000, 000. 000	758, 468, 550. 000	
	11% Colombian TES 20200724	1, 465, 000, 000. 000	1, 671, 799, 400. 000	
	7% Colombian TES 20220504	1, 825, 000, 000. 000	1, 902, 015, 000. 000	
	10% Colombian TES 20240724	1, 900, 000, 000. 000	2, 284, 560, 000. 000	
	6% Colombian TES 20280428	940, 000, 000. 000	881, 776, 400. 000	
	7. 5% Colombian TES 20260826	1, 910, 000, 000. 000	2, 016, 998, 200. 000	
	7. 75% Colombian TES 20300918	1, 240, 000, 000. 000	1, 333, 694, 400. 000	
	7% Colombian TES 20320630	680, 000, 000. 000	675, 233, 200. 000	
	コロンビア・ペソ 小計		コロンビア・ペソ 12, 301, 786, 000. 000 (461, 316, 974)	
タイ・バーツ	3. 875% Thailand Government Bond 20190613	タイ・バーツ 18, 300, 000. 000	タイ・バーツ 19, 071, 894. 000	

	4. 875% Thailand Government Bond 20290622	19,050,000.000	23,639,335.500	
	3. 625% Thailand Government Bond 20230616	11,500,000.000	12,624,240.000	
	3. 85% Thailand Government Bond 20251212	13,110,000.000	14,773,396.800	
	3. 65% Thailand Government Bond 20211217	19,600,000.000	21,184,856.000	
	3. 45% Thailand Government Bond 20190308	2,800,000.000	2,883,860.000	
	3. 65% Thailand Government Bond 20310620	8,200,000.000	9,124,222.000	
	2. 55% Thailand Government Bond 20200626	12,000,000.000	12,334,680.000	
	1. 875% Thailand Government Bond 20220617	13,500,000.000	13,567,230.000	
	3. 4% Thailand Government Bond 20360617	8,100,000.000	8,733,744.000	
	2. 125% Thailand Government Bond 20261217	7,400,000.000	7,308,388.000	
タイ・バーツ 小計			タイ・バーツ 145,245,846.300 (477,858,835)	
チェコ・コルナ	3. 75% Czech Republic Government Bond 20200912	チェコ・コルナ 3,500,000.000	チェコ・コルナ 3,913,000.000	
	3. 85% Czech Republic Government Bond 20210929	3,300,000.000	3,818,925.000	
	2. 5% Czech Republic Government Bond 20280825	5,100,000.000	5,896,620.000	
	5. 7% Czech Republic Government Bond 20240525	5,600,000.000	7,647,304.000	
	1. 5% Czech Republic Government Bond 20191029	6,000,000.000	6,234,000.000	
	4. 7% Czech Republic Government Bond 20220912	3,000,000.000	3,705,000.000	
	2. 4% Czech Republic Government Bond 20250917	3,100,000.000	3,549,345.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	3,200,000.000	3,280,000.000	
	0. 95% Czech Republic Government Bond 20300515	3,100,000.000	3,018,439.000	
	Czech Republic Government Bond 20200210	1,900,000.000	1,921,945.000	
	0. 45% Czech Republic Government Bond 20231025	2,900,000.000	2,945,675.000	
チェコ・コルナ 小計			チェコ・コルナ 45,930,253.000 (229,191,962)	
チリ・ペソ	4. 5% BONOS TESORERIA PESOS 20210301	チリ・ペソ 170,000,000.000	チリ・ペソ 175,751,100.000	
	4. 5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	250,000,000.000	254,732,500.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	200,000,000.000	203,492,000.000	
	5. 5% Chile Government International Bond 20200805	50,000,000.000	53,237,500.000	
チリ・ペソ 小計			チリ・ペソ 687,213,100.000	

			(121, 293, 112)
トルコ・リラ		トルコ・リラ	トルコ・リラ
	10. 5% Turkey Government Bond 20200115	680, 000. 000	673, 404. 000
	9. 5% Turkey Government Bond 20220112	510, 000. 000	490, 875. 000
	8. 5% Turkey Government Bond 20220914	790, 000. 000	729, 960. 000
	7. 1% Turkey Government Bond 20230308	780, 000. 000	672, 360. 000
	8. 8% Turkey Government Bond 20230927	790, 000. 000	732, 330. 000
	8. 8% Turkey Government Bond 20181114	630, 000. 000	613, 305. 000
	10. 4% Turkey Government Bond 20190327	470, 000. 000	466, 240. 000
	10. 4% Turkey Government Bond 20240320	680, 000. 000	682, 720. 000
	8. 5% Turkey Government Bond 20190710	1, 160, 000. 000	1, 111, 860. 000
	9% Turkey Government Bond 20240724	630, 000. 000	588, 105. 000
	7. 4% Turkey Government Bond 20200205	570, 000. 000	528, 247. 500
	8% Turkey Government Bond 20250312	1, 490, 000. 000	1, 308, 220. 000
	9. 4% Turkey Government Bond 20200708	1, 180, 000. 000	1, 141, 060. 000
	10. 7% Turkey Government Bond 20210217	910, 000. 000	909, 545. 000
	10. 6% Turkey Government Bond 20260211	1, 570, 000. 000	1, 588, 055. 000
	9. 2% Turkey Government Bond 20210922	1, 010, 000. 000	962, 530. 000
	11% Turkey Government Bond 20220302	980, 000. 000	992, 495. 000
	11% Turkey Government Bond 20270224	940, 000. 000	974, 780. 000
トルコ・リラ 小計			トルコ・リラ 15, 166, 091. 500 (483, 343, 336)
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	71, 856, 603. 000
	3% Hungary Government Bond 20240626	55, 500, 000. 000	58, 565, 820. 000
	3% Hungary Government Bond 20271027	58, 000, 000. 000	58, 610, 160. 000
	2% Hungary Government Bond 20191030	23, 000, 000. 000	23, 968, 300. 000
	2. 5% Hungary Government Bond 20211027	39, 000, 000. 000	41, 158, 260. 000
	1% Hungary Government Bond 20200923	14, 000, 000. 000	14, 183, 540. 000
	1. 75% Hungary Government Bond 20221026	20, 000, 000. 000	20, 174, 200. 000
	7. 5% Hungary Government Bond 20201112	44, 500, 000. 000	53, 967, 375. 000
	6% Hungary Government Bond	61, 800, 000. 000	76, 539, 300. 000

	20231124			
	6. 5% Hungary Government Bond 20190624	58,800,000.000	65,638,440.000	
	7% Hungary Government Bond 20220624	63,000,000.000	79,326,450.000	
	5. 5% Hungary Government Bond 20181220	24,000,000.000	25,698,000.000	
	5. 5% Hungary Government Bond 20250624	62,500,000.000	75,775,625.000	
ハンガリー・フォロント 小計			ハンガリー・フォロント 665,462,073.000 (282,688,289)	
フィリピン・ペソ	4. 95% Philippine Government International Bond 20210115	10,000,000.000	フィリピン・ペソ 10,255,000.000	
フィリピン・ペソ 小計			フィリピン・ペソ 10,255,000.000 (21,945,700)	
ブラジル・レアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20210101	1,880,000.000	ブラジル・レアル 1,941,494.800	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101	2,830,000.000	2,906,127.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20190101	280,000.000	288,192.800	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	1,690,000.000	1,727,264.500	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	1,380,000.000	1,399,264.800	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20190101	2,370,000.000	2,154,187.800	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20190701	1,510,000.000	1,316,916.300	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20200101	1,790,000.000	1,488,223.900	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20200701	3,540,000.000	2,804,812.800	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20190401	1,720,000.000	1,532,348.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20210701	1,330,000.000	953,211.000	
ブラジル・レアル 小計			ブラジル・レアル 18,512,043.700 (651,809,058)	
ペルー・ソル	5. 7% Peru Government Bond 20240812	580,000.000	ペルー・ソル 611,151.800	
	6. 35% Peru Government Bond 20280812	770,000.000	826,302.400	
	6. 15% Peru Government Bond 20320812	950,000.000	993,947.000	
	8. 2% Peru Government Bond 20260812	715,000.000	871,499.200	
	7. 84% Peru Government Bond 20200812	310,000.000	344,186.800	
	6. 9% Peru Government Bond 20370812	465,000.000	512,918.250	
	6. 95% Peru Government Bond 20310812	770,000.000	867,197.100	
ペルー・ソル 小計			ペルー・ソル	

			5,027,202.550 (169,567,542)	
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	1,210,000.000	1,393,920.000	
	5.5% Poland Government Bond 20191025	880,000.000	948,552.000	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	1,210,000.000	1,199,957.000	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	1,740,000.000	1,664,571.000	
	2% Poland Government Bond 20210425	1,560,000.000	1,551,420.000	
	Poland Government Bond 20181025	1,270,000.000	1,249,362.500	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	1,430,000.000	1,405,118.000	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,140,000.000	1,074,906.000	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	1,650,000.000	1,637,295.000	
	Poland Government Bond 20190425	830,000.000	812,445.500	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	620,000.000	680,636.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	570,000.000	647,691.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	1,530,000.000	1,643,143.500	
	3.25% Poland Government Bond 20190725	810,000.000	834,381.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	1,540,000.000	1,571,031.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 18,314,429.500 (561,337,265)	
マレーシア・リングgit		マレーシア・リングgit	マレーシア・リングgit	
	4.39% Malaysia Government Investment Issue 20230707	600,000.000	613,362.000	
	4.07% Malaysia Government Investment Issue 20260930	870,000.000	866,615.700	
	3.226% Malaysia Government Investment Issue 20200415	530,000.000	526,555.000	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	970,000.000	991,534.000	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	920,000.000	940,644.800	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	670,000.000	665,310.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	740,000.000	730,964.600	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	910,000.000	912,429.700	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	860,000.000	846,670.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	740,000.000	753,601.200	
	4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	650,000.000	662,207.000	
	3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT	910,000.000	916,279.000	

	20191031			
	3. 955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	920,000.000	923,864.000	
	3. 659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	590,000.000	593,941.200	
	4. 254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	570,000.000	557,642.400	
	3. 759% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190315	380,000.000	383,534.000	
	3. 8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	500,000.000	499,500.000	
	3. 9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	800,000.000	802,520.000	
	3. 62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	600,000.000	601,200.000	
	4. 059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	920,000.000	932,622.400	
	3. 899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	430,000.000	431,019.100	
	マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 15,152,016.100 (391,831,137)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5% Mexican Bonos 20191211	9,800,000.000	9,455,432.000	
	5. 75% Mexican Bonos 20260305	5,900,000.000	5,490,717.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	1,700,000.000	1,856,774.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	4,250,000.000	4,512,480.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	11,350,000.000	13,429,433.500	
	7. 5% Mexican Bonos 20270603	4,030,000.000	4,212,639.600	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,390,000.000	3,092,803.400	
	8. 5% Mexican Bonos 20290531	4,230,000.000	4,755,450.600	
	8. 5% Mexican Bonos 20181213	6,900,000.000	7,030,479.000	
	8. 5% Mexican Bonos 20381118	3,300,000.000	3,771,273.000	
	8% Mexican Bonos 20200611	8,990,000.000	9,300,604.500	
	6. 5% Mexican Bonos 20210610	11,950,000.000	11,845,198.500	
	7. 75% Mexican Bonos 20310529	4,950,000.000	5,251,702.500	
	6. 5% Mexican Bonos 20220609	5,450,000.000	5,389,668.500	
	7. 75% Mexican Bonos 20421113	7,820,000.000	8,315,162.400	
	7. 75% Mexican Bonos 20341123	4,130,000.000	4,386,514.300	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 102,096,332.800 (627,892,446)	
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	430,000.000	491,464.200	
	4. 75% Romania Government Bond 20190624	360,000.000	381,610.800	
	5. 6% Romania Government Bond 20181128	420,000.000	444,339.000	
	5. 95% Romania Government Bond 20210611	440,000.000	497,195.600	
	5. 75% Romania Government Bond 20200429	770,000.000	849,764.300	
	4. 75% Romania Government Bond 20250224	580,000.000	623,059.200	
	2. 5% Romania Government Bond 20190429	360,000.000	367,351.200	
	3. 25% Romania Government Bond 20210322	630,000.000	650,790.000	

	5.8% Romania Government Bond 20270726	700,000.000	806,953.000	
	2.25% Romania Government Bond 20200226	700,000.000	710,668.000	
	3.5% Romania Government Bond 20221219	480,000.000	493,041.600	
ルーマニア・レイ	小計		ルーマニア・レイ 6,316,236.900 (178,938,991)	
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	14,957,227.200	
	7.5% Russian Federal Bond - OFZ 20190227	7,130,000.000	7,146,470.300	
	8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203	18,760,000.000	19,787,672.800	
	7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20220720	11,910,000.000	12,041,010.000	
	6.8% Russian Federal Bond - OFZ 20191211	10,800,000.000	10,647,720.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	8,400,000.000	8,239,476.000	
	7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	16,660,000.000	16,276,653.400	
	6.4% Russian Federal Bond - OFZ 20200527	14,100,000.000	13,749,897.000	
	6.7% Russian Federal Bond - OFZ 20190515	15,700,000.000	15,589,158.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	24,300,000.000	23,908,770.000	
	7.5% Russian Federal Bond - OFZ 20210818	18,300,000.000	18,373,383.000	
	8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	16,300,000.000	17,734,563.000	
	7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	19,800,000.000	20,266,686.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	14,500,000.000	14,466,360.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	16,000,000.000	15,980,480.000	
	7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	7,600,000.000	7,427,252.000	
ロシア・ルーブル	小計		ロシア・ルーブル 236,592,778.700 (451,892,207)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20181221	1,120,000.000	1,135,512.000	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	2,590,000.000	2,600,230.500	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	10,450,000.000	11,831,490.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	3,220,000.000	2,329,219.200	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	2,560,000.000	2,517,120.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	4,280,000.000	3,051,640.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,240,000.000	3,561,303.200	

	20310228			
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	2,980,000.000	2,985,215.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	7,320,000.000	6,656,442.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	8,350,000.000	7,564,599.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	5,700,000.000	5,282,475.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	4,900,000.000	4,446,946.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	5,300,000.000	4,893,225.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	2,100,000.000	1,993,278.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	1,000,000.000	936,200.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 61,784,894.900 (527,643,002)	
国債証券	合計		6,315,666.071 [6,315,666,071]	
合計			6,315,666.071 [6,315,666,071]	

- (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%	1.0%
インドネシア・ルピア	国債証券 19 銘柄	100%	9.6%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 1 銘柄	100%	0.1%
コロンビア・ペソ	国債証券 12 銘柄	100%	7.3%
タイ・バーツ	国債証券 11 銘柄	100%	7.6%
チェコ・コルナ	国債証券 11 銘柄	100%	3.6%
チリ・ペソ	国債証券 4 銘柄	100%	1.9%
トルコ・リラ	国債証券 18 銘柄	100%	7.7%
ハンガリー・フォリント	国債証券 13 銘柄	100%	4.5%
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%	10.3%
ペルー・ソル	国債証券 7 銘柄	100%	2.7%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15 銘柄	100%	8.9%
マレーシア・リングgit	国債証券 21 銘柄	100%	6.2%
メキシコ・ペソ	国債証券 16 銘柄	100%	9.9%
ルーマニア・レイ	国債証券 11 銘柄	100%	2.8%
ロシア・ルーブル	国債証券 16 銘柄	100%	7.2%
南アフリカ・ランド	国債証券 15 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J-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	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		763,878,325
投資証券 ※2		241,351,534,100
派生商品評価勘定		3,668,256
未収入金		702,544,074
未収配当金		3,002,690,815
前払金		27,533,600
流動資産合計		245,851,849,170
資産合計		245,851,849,170
負債の部		
流動負債		
未払解約金		720,570,100
流動負債合計		720,570,100
負債合計		720,570,100
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

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 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。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。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
1. ※1 期首	平成 28 年 9 月 8 日
期首元本額	99,217,975,833 円
期中追加設定元本額	21,445,242,962 円
期中一部解約元本額	16,564,687,490 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
ダイワ J-REIT オープン (毎月分配型)	87,120,449,908 円
ダイワ J-REIT オープン (年 1 回決算型)	390,876,376 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2050	22,838 円
iFree J-REIT イ ンデックス	70,311,939 円
iFree 8資産バランス	232,758,606 円
DC・ダイワ J-REIT オ ープン	3,507,061,550 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2020	3,679,735 円
DCダイワ・ターゲットイヤ	5,975,042 円

ー2030 DCダイワ・ターゲットイヤ ー2040 ダイワ・ノーロード J-RE ITファンド ダイワファンドラップ J- REITインデックス ダイワJ-REITインデッ クス (ダイワSMA専用) ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス ダイワ・インデックスセレクト J-REIT		1,072,495 円 62,753,535 円 625,477,168 円 1,418,981 円 173,023,652 円 1,483,566,564 円
計		104,098,531,305 円
2. 期末日における受益権の総数		104,098,531,305 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

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成 29 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	
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	
投資証券		△15,344,080,357
合計		△15,344,080,357

(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) 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				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		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
合計	3,594,977,600	—	3,598,880,000		3,902,400

(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
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	2.3548 円 (23,548 円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	10,659	4,796,550,000	
	MCUBS MidCity 投資法人	6,493	2,110,225,000	
	森ヒルズリート	34,460	4,789,940,000	
	産業ファンド	8,715	4,274,707,500	
	アドバンス・レジデンス	29,700	8,363,520,000	
	ケネディクスレジデンシャル	7,276	2,040,918,000	
	API 投資法人	13,864	6,710,176,000	
	GLP 投資法人	56,160	6,615,648,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	11,699	2,759,794,100	
	日本プロロジスリート	40,348	9,857,016,400	
	星野リゾート・リート	3,989	2,217,884,000	
	ONE リート投資法人	3,507	713,674,500	
	イオンリート投資	28,144	3,253,446,400	
	ヒューリックリート投資法	20,570	3,404,335,000	
	日本リート投資法人	8,619	2,680,509,000	
	インベスコ・オフィス・J リート	17,942	1,876,733,200	
	日本ヘルスケア投資法	1,555	253,620,500	
	積水ハウス・リート投資	20,122	2,658,116,200	
	トーセイ・リート投資法人	4,030	424,762,000	
	ケネディクス商業リート	11,664	2,791,195,200	
	ヘルスケア&メディカル投資	3,953	381,069,200	
	サムティ・レジデンシャル	5,571	468,521,100	
	ジャパン・シニアリビング	1,766	243,354,800	
	野村不動産マスターF	92,029	13,390,219,500	
	いちごホテルリート投資	5,070	539,955,000	
	ラサールロジポート投資	24,200	2,603,920,000	
	スターアジア不動産投	6,661	678,755,900	
	マリモ地方創生リート	1,791	172,831,500	
	三井不ロジパーク	5,187	1,659,840,000	
	大江戸温泉リート	4,080	359,040,000	
	さくら総合リート	7,712	672,486,400	
	投資法人みらい	4,082	691,899,000	
	森トラスト・ホテルリート投	6,947	1,001,062,700	
日本ビルファンド	31,064	17,923,928,000	※	
ジャパンリアルエステイト	30,321	17,131,365,000		

日本リートファンド	61,711	12,496,477,500	
オリックス不動産投資	61,889	9,797,028,700	
日本プライムリアルティ	20,253	7,918,923,000	
プレミア投資法人	28,974	3,161,063,400	
東急リアル・エステート	21,507	2,948,609,700	
グローバル・ワン不動産投資法人	5,150	1,967,300,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	70,749	11,723,109,300	
森トラスト総合リート	22,926	4,069,365,000	
インヴィンシブル投資法人	71,527	3,326,005,500	
フロンティア不動産投資	10,912	5,145,008,000	
平和不動産リート	19,976	1,801,835,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	20,379	4,515,986,400	
福岡リート投資法人	15,569	2,553,316,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	9,376	5,869,376,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	24,321	2,811,507,600	
いちごオフィスリート投資法人	24,839	1,830,634,300	
大和証券オフィス投資法人	6,918	3,756,474,000	
阪急リート投資法人	13,145	1,807,437,500	
スターツプロシード投資法人	5,054	760,627,000	
大和ハウスリート投資法人	32,992	9,043,107,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	92,585	6,795,739,000	
日本賃貸住宅投資法人	36,081	2,929,777,200	
ジャパンエクセレント投資法人	28,725	3,811,807,500	
投資証券 合計		241,351,534,100	
合計		241,351,534,100	

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) ※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	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		116,489,268
コール・ローン		59,623,330
投資信託受益証券		27,620,703
投資証券		11,593,941,852
未収入金		294,973
未収配当金		7,202,288
流動資産合計		11,805,172,414
資産合計		11,805,172,414
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		19,141
未払金		80,877,803
未払解約金		1,373,000
流動負債合計		82,269,944
負債合計		82,269,944
純資産の部		
元本等		
元本	※1	5,412,642,039
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		6,310,260,431
元本等合計		11,722,902,470
純資産合計		11,722,902,470
負債純資産合計		11,805,172,414

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 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 年 9 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 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。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、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</p>

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
1. ※1 期首	平成 28 年 9 月 8 日
期首元本額	1, 553, 985, 694 円
期中追加設定元本額	4, 163, 085, 786 円
期中一部解約元本額	304, 429, 441 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
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
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
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
D-I's グローバル REIT インデックス	1, 193, 732 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	26, 742 円
iFree 外国 REIT インデックス	61, 050, 918 円
iFree 8資産バランス	252, 712, 338 円
DCダイワ・グローバル REIT インデックスファンド	1, 383, 753, 601 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	4, 102, 272 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6, 620, 322 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1, 028, 979 円
ダイワ・インデックスセレクト グローバル REIT	290, 216, 075 円
ダイワ・ノーロード グローバル REIT ファンド	21, 617, 058 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
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

計	5,412,642,039 円
2. 期末日における受益権の総数	5,412,642,039 口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成 28 年 9 月 8 日 至 平成 29 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。 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成 29 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
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	129,936

投資証券	284,382,540
合計	284,512,476

(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)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			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	40,416,291	—	40,397,150	△19,141
アメリカ・ドル	21,836,720	—	21,836,000	△720
カナダ・ドル	2,673,309	—	2,673,300	△9
シンガポール・ドル	10,128,600	—	10,113,000	△15,600
ニュージーランド・ドル	2,357,340	—	2,357,100	△240
香港・ドル	3,420,322	—	3,417,750	△2,572
合計	40,416,291	—	40,397,150	△19,141

(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。
 - ① 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。
 - ② 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
1口当たり純資産額	2.1658円
(1万口当たり純資産額)	(21,658円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REIT ETF	3,000,000	アメリカ・ドル 252,960,000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 252,960,000 (27,620,703)	
投資信託受益証券 合計				27,620,703 [27,620,703]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	6,300	211,239,000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	7,700	71,764,000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	9,682	246,600,540	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	9,600	189,600,000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,900	2,393,337,000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	29,147	4,626,503,310	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,300	1,729,299,000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	14,755	668,991,700	
		GGP INC	54,777	1,156,890,240	
		VORNADO REALTY TRUST	15,964	1,187,242,680	
		MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	15,000	179,550,000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2,100	42,126,000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,900	91,065,000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	1,600	37,440,000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	4,500	243,675,000	
		EQUITY RESIDENTIAL	34,300	2,305,646,000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	14,300	260,975,000	
		EPR PROPERTIES	6,000	422,640,000	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,700	17,340,000	
		CITY OFFICE REIT INC	2,100	26,922,000	
		GLOBAL NET LEASE INC	4,933	107,194,090	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	5,629	142,807,730	
		CHATHAM LODGING TRUST	3,200	65,056,000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	5,500	138,875,000	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2,200	104,742,000	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	4,700	275,937,000	
		FOREST CITY REALTY TRUST- A	20,300	495,320,000	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	10,100	204,525,000	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,600	42,544,000	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	2,213	20,912,850	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	69,600	1,251,408,000	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	21,708	474,971,040	
		GRAMERCY PROPERTY TRUST	14,095	427,219,450	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	7,300	474,281,000			
CORESITE REALTY CORP	3,200	373,728,000			
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	14,400	468,720,000			
RLJ LODGING TRUST	16,471	338,479,050			

FARMLAND PARTNERS INC	1,800	16,290.000
PHYSICIANS REALTY TRUST	16,400	307,828.000
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3,800	51,718.000
CYRUSONE INC	7,300	461,214.000
KIMCO REALTY CORP	39,600	799,524.000
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	18,050	566,228.500
WHITESTONE REIT	3,000	38,160.000
TIER REIT INC	4,500	81,720.000
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	237	2,519.310
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,800	20,790.000
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,300	698,511.000
PARKWAY INC	3,988	91,564.480
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	13,700	276,192.000
STARWOOD WAYPOINT HOMES	11,500	419,175.000
QUALITY CARE PROPERTIES	8,400	116,760.000
PARK HOTELS & RESORTS INC	13,200	350,460.000
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	51,811	676,133.550
INVITATION HOMES INC	7,200	162,720.000
JBG SMITH PROPERTIES	8,032	258,791.040
ALEXANDER & BALDWIN INC	4,300	189,157.000
WASHINGTON PRIME GROUP INC	16,760	140,616.400
CORECIVIC INC	10,824	290,083.200
STORE CAPITAL CORP	15,600	394,524.000
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,300	136,989.000
LIFE STORAGE INC	4,300	339,528.000
SELECT INCOME REIT	5,800	134,154.000
AMERICAN ASSETS TRUST INC	3,800	154,318.000
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,782	45,237.720
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	3,100	55,459.000
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	11,700	240,201.000
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	6,600	197,604.000
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	11,100	234,543.000
STAG INDUSTRIAL INC	8,300	232,649.000
VENTAS INC	33,179	2,267,784.650
CARETRUST REIT INC	6,703	129,300.870
GEO GROUP INC/THE	11,600	317,028.000
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,700	471,770.000
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	8,800	160,952.000
SABRA HEALTH CARE REIT INC	14,687	331,926.200
UMH PROPERTIES INC	2,300	36,938.000
IRON MOUNTAIN INC	23,100	906,444.000
TERRENO REALTY CORP	4,600	167,302.000
VEREIT INC	91,008	783,578.880
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	45,000	389,700.000
SUN COMMUNITIES INC	6,700	609,030.000
ACADIA REALTY TRUST	8,011	235,443.290
ALEXANDER' S INC	300	126,708.000
PROLOGIS INC	49,546	3,128,334.440
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,500	1,023,315.000
BRANDYWINE REALTY TRUST	16,500	280,500.000
SAUL CENTERS INC	1,000	61,800.000
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	15,945	131,865.150
MACK-CALI REALTY CORP	8,500	201,535.000
CAMDEN PROPERTY TRUST	8,200	754,236.000

COUSINS PROPERTIES INC	38,407	352,960.330
DDR CORP	28,856	281,634.560
DUKE REALTY CORP	33,500	986,240.000
EASTGROUP PROPERTIES INC	3,100	278,380.000
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,167	1,620,502.590
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	11,000	341,550.000
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,800	879,376.000
GETTY REALTY CORP	2,803	78,371.880
WELLTOWER INC	34,200	2,519,514.000
HCP INC	44,100	1,328,292.000
HIGHWOODS PROPERTIES INC	9,500	494,000.000
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	15,300	414,171.000
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11,400	383,268.000
EQUITY COMMONWEALTH	11,475	354,003.750
KILROY REALTY CORP	9,200	631,304.000
LASALLE HOTEL PROPERTIES	10,600	298,284.000
LIBERTY PROPERTY TRUST	13,900	595,059.000
LTC PROPERTIES INC	3,700	179,968.000
LEXINGTON REALTY TRUST	19,600	193,452.000
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,728	1,141,137.360
MACERICH CO/THE	11,100	603,618.000
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,600	686,432.000
NATL HEALTH INVESTORS INC	3,800	304,380.000
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	14,000	586,600.000
REALTY INCOME CORP	25,717	1,496,215.060
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	9,200	306,360.000
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,600	57,960.000
PUBLIC STORAGE	14,000	2,910,460.000
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,800	241,740.000
REGENCY CENTERS CORP	13,620	881,486.400
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	7,300	98,331.000
ISTAR INC	6,500	73,515.000
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	9,100	221,767.000
SL GREEN REALTY CORP	9,500	917,130.000
SENIOR HOUSING PROP TRUST	22,400	441,728.000
TAUBMAN CENTERS INC	5,600	296,240.000
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,500	52,050.000
UDR INC	25,200	984,312.000
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,100	81,873.000
WP CAREY INC	10,000	691,600.000
WASHINGTON REIT	7,000	230,930.000
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	11,100	364,080.000
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,200	38,688.000
AGREE REALTY CORP	2,600	130,338.000
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	18,550	599,907.000
CUBESMART	16,700	424,848.000
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	20,526	321,437.160
DIGITAL REALTY TRUST INC	15,000	1,795,350.000
CEDAR REALTY TRUST INC	6,900	34,914.000
EXTRA SPACE STORAGE INC	11,900	944,741.000
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	5,400	60,102.000
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,475	62,828.000
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	10,100	62,721.000
KITE REALTY GROUP TRUST	7,550	154,397.500

	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	6,300	100,863.000
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,100	26,444.000
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	12,500	602,375.000
	EDUCATION REALTY TRUST INC	6,800	266,356.000
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,500	53,600.000
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	18,842	201,232.560
	NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	4,449	54,722.700
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	34,300	456,190.000
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	9,700	96,030.000
	DOUGLAS EMMETT INC	14,600	565,458.000
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	8,500	497,420.000
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	21,700	295,120.000
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	58,300	54,510.500
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 75,993,289.710 (8,297,707,303)
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド
	ASSURA PLC	167,450	110,517.000
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	5,070	25,742.920
	CAPITAL & REGIONAL PLC	41,940	23,276.700
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	51,710	58,173.750
	REGIONAL REIT LTD	18,410	19,238.450
	NEWRIVER REIT PLC	28,270	100,217.150
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	13,450	15,064.000
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	12,580	12,925.950
	LXI REIT PLC	11,540	12,030.450
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	110,390	43,747.550
	LAND SECURITIES GROUP PLC	74,710	751,582.600
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	72,310	97,256.950
	SEGRO PLC	92,770	494,464.100
	HAMMERSON PLC	74,010	409,645.350
	UNITE GROUP PLC	21,760	148,947.200
	BRITISH LAND CO PLC	95,480	571,925.200
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	29,750	182,665.000
	INTU PROPERTIES PLC	82,870	202,948.630
	DERWENT LONDON PLC	10,340	288,692.800
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	49,860	59,832.000
	WORKSPACE GROUP PLC	11,180	98,943.000
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	18,220	75,831.640
	SHAFTESBURY PLC	25,930	257,484.900
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	7,320	17,128.800
	BIG YELLOW GROUP PLC	13,120	102,795.200
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	64,610	106,800.330
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	43,330	26,972.920
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	127,180	182,248.940
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 4,497,099.480 (640,791,705)
イスラエル・シェケル			イスラエル・シェケル
	REIT 1 LTD	9,340	128,705.200
イスラエル・シェケル 小計			イスラエル・シェケル 128,705.200 (3,957,686)

オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	16,890	47,292.000
	CROMWELL PROPERTY GROUP	119,720	114,931.200
	VIVA ENERGY REIT	39,300	84,888.000
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	13,990	59,317.600
	PROPERTYLINK GROUP	49,060	42,682.200
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	66,770	150,232.500
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	21,000	66,570.000
	NATIONAL STORAGE REIT	44,140	67,975.600
	INDUSTRIA REIT	11,760	28,812.000
	GDI PROPERTY GROUP	41,860	46,883.200
	SCENTRE GROUP	496,810	1,977,303.800
	ARENA REIT	19,650	44,605.500
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	10,000	31,000.000
	BWP TRUST	41,600	122,720.000
	DEXUS	94,170	897,440.100
	GPT GROUP	166,110	828,888.900
	INVESTA OFFICE FUND	57,600	255,744.000
	CHARTER HALL RETAIL REIT	29,420	116,209.000
	MIRVAC GROUP	342,900	798,957.000
	STOCKLAND	224,410	994,136.300
	WESTFIELD CORP	178,370	1,401,988.200
	ABACUS PROPERTY GROUP	26,010	95,196.600
	GOODMAN GROUP	148,600	1,215,548.000
	VICINITY CENTRES	302,370	813,375.300
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	4,310	31,204.400
	CHARTER HALL GROUP	43,420	247,494.000
	ALE PROPERTY GROUP	16,110	77,650.200
	ASPEN GROUP	3,000	3,315.000
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	16,330	41,314.900
360 CAPITAL GROUP LTD	9,000	8,775.000	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 10,712,450.500 (937,339,419)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	6,500	85,345.000
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	7,400	82,066.000
	SLATE RETAIL REIT - U	1,700	22,346.500
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,600	33,904.000
	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	700	7,861.000
	SLATE OFFICE REIT	2,800	22,092.000
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	3,600	39,492.000
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2,200	110,638.000
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2,500	22,675.000
	ONEREIT	1,000	4,210.000
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,500	27,720.000
	CHOICE PROPERTIES REIT	4,300	55,943.000
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,800	89,838.000
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,700	25,925.000
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,900	40,252.000
	PLAZA RETAIL REIT	2,300	10,235.000
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	5,800	172,144.000
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6,300	214,200.000

	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	3,300	150,183.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	7,890	106,041.600	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	13,166	281,489.080	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2,300	32,430.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,900	352,981.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4,200	87,906.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,000	79,920.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	2,300	50,439.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3,700	49,358.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	4,200	161,238.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 2,418,872.180 (215,811,776)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	74,028	94,755.840	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	40,000	53,400.000	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	163,100	184,303.000	
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	48,900	67,971.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	100,300	106,819.500	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	193,700	332,195.500	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	223,300	596,211.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	247,800	517,902.000	
	SUNTEC REIT	238,000	447,440.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	132,800	162,016.000	
	KEPPEL REIT	157,600	180,452.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	52,760	73,336.400	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	102,400	119,296.000	
	ESR-REIT	84,479	46,885.840	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	76,400	121,476.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	47,900	101,548.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	126,900	93,906.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	64,300	103,523.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	36,300	97,284.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	165,200	73,514.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	110,080	202,547.200	
	CACHE LOGISTICS TRUST	65,500	53,382.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	164,000	253,380.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	70,200	45,981.000	
	SPH REIT	70,500	70,147.500	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	64,900	46,403.500	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	78,100	37,097.500	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	64,200	53,286.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	96,673	73,954.840	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	42,050	29,645.250	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 4,440,060.370 (359,422,887)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	29,160	48,697.200	
	INVESTORE PROPERTY LTD	10,250	14,350.000	
	ARGOSY PROPERTY LTD	71,630	75,211.500	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	130,380	176,664.900	

	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	35,310	58,614.600
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	25,970	58,042.950
	GOODMAN PROPERTY TRUST	93,020	117,670.300
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	85,700	110,553.000
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 659,804.450 (51,946,404)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	9,140	ユーロ 111,416.600
	HAMBORNER REIT AG	6,790	61,205.060
	WERELDHAVE NV	3,640	147,966.000
	UNIBAIL-RODAMCO SE	9,380	1,969,800.000
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	4,420	158,854.800
	NSI NV	1,481	48,162.120
	VASTNED RETAIL NV	1,750	67,095.000
	ICADE	4,230	313,189.200
	ALTAREA	310	60,140.000
	GECINA SA	4,301	564,936.350
	KLEPIERRE	19,360	654,948.800
	FONCIERE DES REGIONS	5,020	415,907.000
	MERCIALYS	4,990	84,705.250
	AEDIFICA	1,658	132,424.460
	COFINIMMO	1,900	203,775.000
	BEFIMMO	2,070	108,778.500
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1,230	27,416.700
	RETAIL ESTATES	500	36,310.000
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,440	135,792.000
	WERELDHAVE BELGIUM NV	180	17,370.000
	XIOR STUDENT HOUSING NV	490	20,060.600
	MONTEA	480	22,552.800
	BENI STABILI SPA	94,420	66,471.680
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	30,400	25,536.000
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,180	67,812.200
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	9,800	148,960.000
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	5,720	92,435.200
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	43,830	503,387.550
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	33,100	45,016.000
	GREEN REIT PLC	61,020	90,309.600
	HIBERNIA REIT PLC	63,050	92,053.000
ユーロ 小計			ユーロ 6,494,787.470 (845,491,433)
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	87,000	香港・ドル 455,880.000
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	91,000	502,320.000
	FORTUNE REIT	128,000	1,173,760.000
	PROSPERITY REIT	92,000	305,440.000
	LINK REIT	206,500	13,319,250.000
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	74,000	255,300.000
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	69,000	168,360.000
	CHAMPION REIT	196,000	1,117,200.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 17,297,510.000 (241,473,239)

投資証券 合計		11,593,941,852 [11,593,941,852]	
合計		11,621,562,555 [11,621,562,555]	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 1 銘柄 受益証券 投資証券 158 銘柄	0.3%	99.7%	71.6%
イギリス・ポンド	投資証券 28 銘柄	-%	100%	5.5%
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 30 銘柄	-%	100%	8.1%
カナダ・ドル	投資証券 28 銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 30 銘柄	-%	100%	3.1%
ニュージーランド・ドル	投資証券 8 銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 31 銘柄	-%	100%	7.3%
香港・ドル	投資証券 8 銘柄	-%	100%	2.1%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

2 ファンドの現況

純資産額計算書

平成29年9月29日

I 資産総額	4,761,798,394 円
II 負債総額	8,605,988 円
III 純資産総額 (I - II)	4,753,192,406 円
IV 発行済数量	4,172,066,952 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	1.1393 円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成29年9月29日

I 資産総額	142,093,929,409 円
II 負債総額	4,542,677,721 円
III 純資産総額 (I - II)	137,551,251,688 円
IV 発行済数量	132,245,315,539 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	1.0401 円

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

平成29年9月29日

I 資産総額	236,780,101,937 円
II 負債総額	460,317,844 円
III 純資産総額 (I - II)	236,319,784,093 円
IV 発行済数量	101,454,554,454 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	2.3293 円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

純資産額計算書

平成29年9月29日

I 資産総額	15,106,179,310 円
II 負債総額	61,309,000 円
III 純資産総額 (I - II)	15,044,870,310 円
IV 発行済数量	11,890,377,473 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	1.2653 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

平成29年9月29日

I 資産総額	3,933,519,693 円
II 負債総額	46,330,569 円
III 純資産総額 (I - II)	3,887,189,124 円
IV 発行済数量	2,517,630,290 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	1.5440 円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成29年9月29日

I 資産総額	92,146,176,944 円
II 負債総額	163,105,000 円
III 純資産総額 (I - II)	91,983,071,944 円
IV 発行済数量	39,665,049,773 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	2.3190 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

平成29年9月29日

I 資産総額	12,343,100,775 円
II 負債総額	22,428,646 円
III 純資産総額 (I - II)	12,320,672,129 円
IV 発行済数量	5,554,561,943 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	2.2181 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

平成29年9月29日

I 資産総額	7,024,656,316 円
II 負債総額	122,286,344 円
III 純資産総額 (I - II)	6,902,369,972 円
IV 発行済数量	4,883,608,402 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	1.4134 円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成29年9月29日

I 資産総額	167,169,933,115 円
II 負債総額	169,259,373 円
III 純資産総額 (I - II)	167,000,673,742 円
IV 発行済数量	59,537,217,277 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	2.8050 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
 - ① 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。
 - ② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。
 - ③ 上記①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

平成29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

① 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。

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 事業の内容及び営業の概況

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

平成 29 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	78	206,158
追加型株式投資信託	707	14,407,986
株式投資信託 合計	785	14,614,143
単位型公社債投資信託	23	121,315
追加型公社債投資信託	14	2,035,351
公社債投資信託 合計	37	2,156,666
総合計	822	16,770,809

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28年4月1日から平成29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。


独立監査人の監査報告書

平成 29 年 5 月 26 日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人


指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

高波博文 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

貞廣篤典 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

内田和男 

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の財務諸表、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29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

(1) 貸借対照表

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,715	31,260
有価証券	1,137	110
前払費用	159	190
未収委託者報酬	9,896	10,453
未収収益	87	72
繰延税金資産	468	439
その他	83	34
流動資産計	43,547	42,560
固定資産		
有形固定資産	※1	※1
建物	243	229
器具備品	18	15
器具備品	224	214
無形固定資産	2,706	2,650
ソフトウェア	2,385	2,323
ソフトウェア仮勘定	321	327
投資その他の資産	14,223	12,353
投資有価証券	7,872	5,920
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	123	185
長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	-	31
その他	47	37
固定資産計	17,173	15,234
資産合計	60,720	57,795

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	61	79
未払金	8,789	9,466
未払収益分配金	5	7
未払償還金	63	59
未払手数料	4,330	4,453
その他未払金	※2 4,390	※2 4,946
未払費用	4,215	4,077
未払法人税等	1,155	980
未払消費税等	538	223
賞与引当金	937	945
その他	22	3
流動負債計	15,720	15,776
固定負債		
退職給付引当金	2,209	2,318
役員退職慰労引当金	93	151
繰延税金負債	1,410	-
その他	-	7
固定負債計	3,714	2,477
負債合計	19,435	18,254
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,960	12,231
利益剰余金合計	14,334	12,606
株主資本合計	41,004	39,276
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	280	264
評価・換算差額等合計	280	264
純資産合計	41,284	39,540
負債・純資産合計	60,720	57,795

(2) 損益計算書

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	88,850	79,747
その他営業収益	799	727
営業収益計	89,650	80,474
営業費用		
支払手数料	46,165	40,110
広告宣伝費	646	549
調査費	10,116	9,436
調査費	925	904
委託調査費	9,191	8,531
委託計算費	761	793
営業雑経費	1,346	1,375
通信費	249	251
印刷費	515	501
協会費	53	50
諸会費	14	13
その他営業雑経費	513	557
営業費用計	59,036	52,265
一般管理費		
給料	5,797	5,833
役員報酬	354	416
給料・手当	3,850	3,940
賞与	654	531
賞与引当金繰入額	937	945
福利厚生費	837	807
交際費	70	60
旅費交通費	211	178
租税公課	325	531
不動産賃借料	1,258	1,273
退職給付費用	394	463
役員退職慰労引当金繰入額	37	60
固定資産減価償却費	1,110	1,045
諸経費	1,486	1,400
一般管理費計	11,531	11,655
営業利益	19,082	16,554

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	109	92
受取利息	25	12
投資有価証券売却益	115	224
有価証券償還益	0	94
外国税関連費用引当金戻入益	171	-
その他	72	56
営業外収益計	496	481
営業外費用		
投資有価証券売却損	14	24
その他	94	75
営業外費用計	108	100
経常利益	19,471	16,935
特別損失		
MMF等償還関連費用	-	305
特別損失計	-	305
税引前当期純利益	19,471	16,629
法人税、住民税及び事業税	6,215	6,501
法人税等調整額	△6	△1,405
法人税等合計	6,209	5,096
当期純利益	13,262	11,533

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成 27 年 4 月 1 日 至 平成 28 年 3 月 31 日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

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

当事業年度（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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた73百万円は、「有価証券償還益」0百万円、「その他」72百万円として組替えております。

(追加情報)

「繰延税金資産の回収可能性に関する摘要指針（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）」を当期から適用しております。

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	23百万円	26百万円
器具備品	232百万円	264百万円

※2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
未払金	4,320百万円	4,877百万円

3 保証債務

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（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。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

- ① 剰余金の配当の総額 13,262百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 5,084円
- ④ 基準日 平成28年3月31日
- ⑤ 効力発生日 平成28年6月24日

当事業年度（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。

- ① 剰余金の配当の総額 11,532百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 4,421円
- ④ 基準日 平成29年3月31日
- ⑤ 効力発生日 平成29年6月27日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(i) 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。

(ii) 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。

②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28年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	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(*)	3,409	3,409	—
負債計	12,809	12,809	—

(*) 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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,021	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	1,049	1,050

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28年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（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

(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28年3月31日）

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

当事業年度（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、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日）

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

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

当事業年度（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27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

当事業年度（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

4. 減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,072 百万円	2,209 百万円
勤務費用	222	202
退職給付の支払額	△120	△122
その他	35	29
退職給付債務の期末残高	2,209	2,318

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

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,209 百万円	2,318 百万円
貸借対照表に計上された負債 と資産の純額	2,209	2,318
退職給付引当金	2,209	2,318
貸借対照表に計上された負債 と資産の純額	2,209	2,318

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
勤務費用	222 百万円	202 百万円
その他	-	87
確定給付制度に係る退職給付費用	222	289

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度172百万円、当事業年度173百万円であります。

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	676	709
賞与引当金	225	224
未払事業税	224	169
連結法人間取引（譲渡損）	121	5
出資金評価損	98	98
投資有価証券評価損	95	65
その他	173	185
繰延税金資産小計	1,615	1,458
評価性引当額	△347	△201
繰延税金資産合計	1,268	1,257
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△2,086	△639
その他有価証券評価差額金	△124	△146
繰延税金負債合計	△2,210	△786
繰延税金資産の純額	△941	470

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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
法定実効税率 (調整)	33.06%	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。
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.77%	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.02%	
評価性引当額の増減額	△1.29%	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	△0.19%	
その他	△0.43%	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.89%	

(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27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（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。

[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 27 年 4 月 1 日 至 平成 28 年 3 月 31 日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度 (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。

(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 27 年 4 月 1 日 至 平成 28 年 3 月 31 日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度 (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。

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27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,826.85円	1株当たり純資産額	15,158.25円
1株当たり当期純利益	5,084.10円	1株当たり当期純利益	4,421.51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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,262	11,533
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。

- ① 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。）。
- ② 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。）。
- ③ 通常の見取の条件と異なる条件であつて見取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④⑤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。
- ④ 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。
- ⑤ 上記③④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つて、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。

追加型証券投資信託

(i F r e e 8 資産バランス)

約 款

大和証券投資信託委託株式会社

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 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、それぞれかつ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。

イ. 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）

ロ. 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））

ハ. 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））

ニ. 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）

ホ. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

（シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

ヘ. 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））

ト. 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））

チ. 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））

(2) 投資態度

① 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。

イ. 国内株式

ロ. 先進国株式

ハ. 新興国株式

ニ. 国内債券

ホ. 先進国債券

ヘ. 新興国債券

ト. 国内リート

チ. 海外リート

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

イ. 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

ロ. 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

ハ. 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

- ⑥ 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。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資制限
株式への直接投資は、行ないません。
- ② 外貨建資産への投資制限
外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

3. 収益分配方針

- 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。
- ③ 留保益は、上記「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

追加型証券投資信託
(i F r e e 8 資産バランス)
約 款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けません。

③ 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第17条第1項、同条第2項および第22条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行なうものとします。

(信託の目的および金額)

第 2 条 委託者は、金1,000万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第 3 条 委託者は、受託者と合意のうえ、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。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第40条第1項、第41条第1項、第42条第1項および第44条第2項の規定による信託終了日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第 5 条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

(当初の受益者)

第 6 条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により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。

(受益権の分割および再分割)

第 7 条 委託者は、第2条の規定による受益権については1,000万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところに従い、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。

③ 前項の規定により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者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、委託者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。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、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従って時価または一部償却原価法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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

③ 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。

- ④ 第20条に規定する予約為替の評価は、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。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者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 委託者は、第7条の規定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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

(受益権の設定にかかる受託者の通知)

第11条 受託者は、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ないます。

(受益権の申込単位および価額)

第12条 委託者は、第7条第1項の規定により分割される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口単位として委託者が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。）（以下総称して「指定販売会社」といいます。）は、第7条第1項の規定により分割される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口単位として指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める積立投資約款に従い積立投資契約を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応じることができるものとします。

- ③ 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、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。

- ④ 第1項および第2項の規定にかかわらず、委託者および指定販売会社は、別に定める取引所または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の受付を行ないません。

- ⑤ 第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益権の価額は、1口につき1円に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

- ⑥ 前項の規定にかかわらず、受益者が積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第30条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」といいます。）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、委託者が追加設定を制限する措置をとった場合には、指定販売会社は、取得申込の受付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を取消することができるものとします。

（受益権の譲渡にかかる記載または記録）

第13条 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。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。）に社振法の規定に従い、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。

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類）

第15条 この信託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

（有価証券および金融商品の指図範囲等）

第16条 委託者は、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第1号から第8号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、ならびに次の第9号から第12号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、前号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。）

② 委託者は、信託金を、前項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 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

（利害関係人等との取引等）

第17条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行なうものを含みます。）および受託者の利害関係人、第22条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条、第25条から第27条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行なうことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行なうことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行なう場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行なう他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条、第25条から第27条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行なうことができます。

④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行ないません。

（運用の基本方針）

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行ないません。

（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第19条 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。

（外国為替予約取引の指図）

第20条 委託者は、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のための投資制限）

第21条 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（信託業務の委託等）

第22条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること

4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
 1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第23条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第24条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、すみやかに登記または登録をすることとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（一部解約の請求および有価証券売却等の指図）

第25条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第26条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第27条 委託者は、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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

（損益の帰属）

第28条 委託者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、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金の立替え）

第29条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者

は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第30条 この信託の計算期間は、毎年9月8日から翌年9月7日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項の規定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。

(信託財産に関する報告等)

第31条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行なうことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行なわないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第32条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者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（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 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。

(信託報酬等の額および支弁の方法)

第33条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第30条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の22の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6カ月終了日（6カ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。
- ③ 第1項の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。

(収益の分配方式)

第34条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第35条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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計算期間の末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指定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します。）

に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、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指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 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。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、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指定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支払います。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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、社振法の規定に従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。
- ④ 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第36条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金および償還金の時効）

第37条 受益者が、収益分配金については第35条第1項に規定する支払開始日から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第35条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第38条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、最低単位を1口単位として委託者または指定販売会社が定める単位（積立投資契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。ただし、委託者は、別に定める取引所または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請求の受付を行ないません。なお、前項の一部解約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この信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、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、社振法の規定に従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 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約請求をするときは、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- ⑤ 委託者は、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、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった

当日の一部解約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請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第39条 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、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第40条 委託者は、信託期間中において、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この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、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。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等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この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 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託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者を除きます。以下本項において同じ。）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、この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 第2項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 第2項から前項までの規定は、委託者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、この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、第2項から前項までの手続を行なうことが困難な場合も同じとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第41条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第45条の規定に従います。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第42条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第45条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者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第43条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第44条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第45条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第45条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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け出ます。なお、この信託約款は本条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 委託者は、前項の事項（前項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、前項の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託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者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、この信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、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 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者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、この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 前各項の規定にかかわらず、この投資信託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投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

（反対受益者の受益権買取請求の不適用）

第46条 この信託は、受益者が第38条の規定による一部解約請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第40条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行なう場合において、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。

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第47条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第48条 委託者は、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の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

（公告）

第49条 委託者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 前項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。

（信託約款に関する疑義の取扱い）

第50条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

（付 則）

第 1条 この約款において「積立投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「積立投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとしま

す。この場合、「積立投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2条 第35条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

平成28年 9月 8日

委託者 大和証券投資信託委託株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社

I 別に定める取引所または銀行

約款第12条および第38条の「別に定める取引所または銀行」とは、次のものをいいます。

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
ロンドンの銀行