

# ダイワ・ライフ・バランス50

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

※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)

2018年2月27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「ダイワ・ライフ・バランス50」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2017年8月29日に関東財務局長に提出しており、2017年8月30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

ダイワ・ライフ・バランス50

### (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也没有。

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

5,000億円を上限とします。

### (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合わせる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**

2017年8月30日から2018年8月29日まで（継続申込期間）  
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

**(8) 申込取扱場所**

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

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

**(9) 払込期日**

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

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

**(10) 払込取扱場所**

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

**(11) 振替機関に関する事項**

振替機関は下記のとおりです。  
株式会社 証券保管振替機構

**(12) その他**

- ① 受益権の取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。
- ② 委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。
- ③ 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。
- ④ 「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。）。

⑤ 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。

⑥ 取得申込金額に利息は付きません。

## 第二部 ファンド情報

### 第1 ファンドの状況

#### 1 ファンドの性格

##### (1) ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは、国内外の株式および債券に投資し、信託財産の中長期的な成長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
	補足分類	インデックス型
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)))
	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
	対象インデックス	その他の指数(合成インデックス)

※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
- ・「インデックス型」…目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす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
- ・「その他の指数」…日経225、TOPIXにあてはまらないすべてのもの

## 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）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式					
一般	年1回	グローバル (含む日本)			
大型株					
中小型株	年2回	日本			日経225
債券					
一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )	
公債		欧州			
社債	年6回 (隔月)	アジア			TOPIX
その他債券		オセアニア			
クレジット属性 ( )					
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米			
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 資産配分 (固定型(株式、債券)))	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (合成インデックス)
資産複合 ( )	その他 ( )	中近東 (中東)			
資産配分固定型		エマージング			
資産配分変更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

### <信託金の限度額>

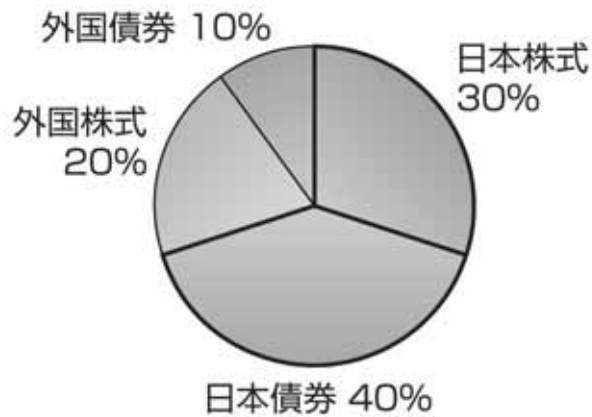
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

### <ファンドの特色>

# 1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行いません。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国内	海外	合計
株式	30%	20%	50%
債券	40%	10%	50%
合計	70%	30%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

## 2

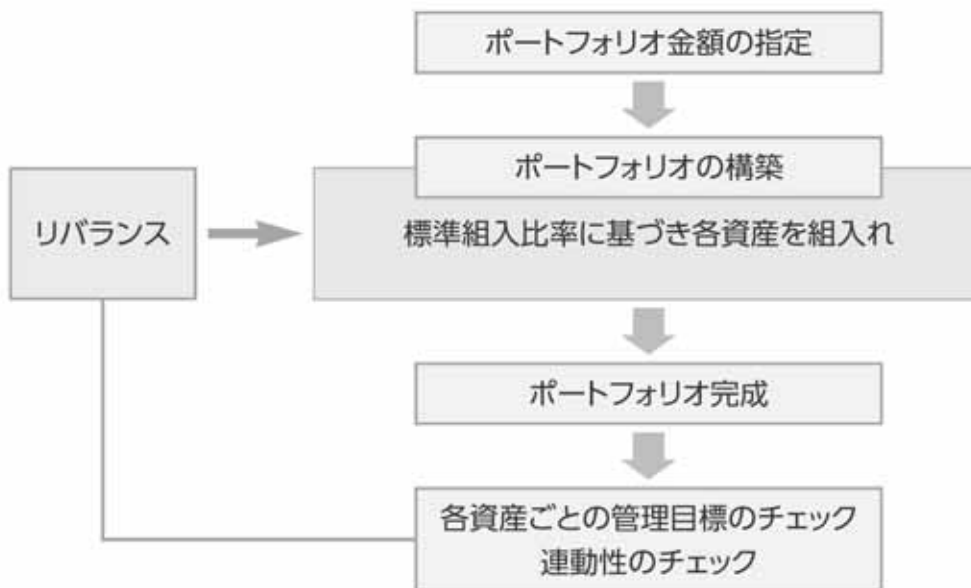
各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

- 合成ベンチマークとは、各資産ごとのベンチマークの騰落率を標準組入比率に準拠して指数化したものです。

### 各資産ごとのベンチマーク

日本株式	東証株価指数 (TOPIX)
日本債券	NOMURA-BPI総合指数
外国株式	MSCIコクサイ指数 (円ベース)
外国債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

### 運用プロセス



- 標準組入比率にしたがって、各資産へ投資し、ポートフォリオを構築します。
- 合成ベンチマークに連動する投資成果をめざすため、各資産ごとのウェイトが標準組入比率から乖離しないよう管理目標を設定し、各資産の比率をその範囲内に維持するように運用を行ないます。
- 各資産の価格変動により、各資産の組入比率が管理目標を超えた場合は、標準組入比率に近づける方向へリバランスを行ないます。



## ファンドの仕組み

### ●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



- ・市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。
- ・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行ないません。

- ・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

- ・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.および2.の運用が行なわれないことがあります。

### 3

毎年6月5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等とします。
- ②原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。  
ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

## 各マザーファンドの運用プロセス

### 1. 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）に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。TOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行ないます。

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

#### 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

## 2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

### NOMURA-BPI総合指数とは

NOMURA-BPIは、野村証券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表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。

## 3. 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) に連動する投資成果をあげることがをめぐり運用を行ないます。ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。MSCIコクサイ指数 (円ベース) への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行ないます。

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

### MSCIコクサイ指数とは

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

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

## 4. 外国債券インデックスマザーファンド

FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) に連動する投資成果をあげることがをめぐり運用を行ないます。ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、各通貨別にリスクモデル<sup>(注)</sup>を用いて、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とマザーファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようポートフォリオを構築します。また、リスクモデルを使用し債券価格変動要因の測定・管理を行ない、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とマザーファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行ないます。

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

### FTSE世界国債インデックスとは

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

## (2) ファンドの沿革

2005年6月6日

信託契約締結、当初設定、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、次の業務を行ないます。 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	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）、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。）、外国の株式（預託証券を含みます。）、外国の公社債 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（2017年12月末日現在）>

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日 設立登記

1960年 2月17日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

1960年 4月 1日 営業開始

1985年11月 8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。

1995年 5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。

1995年 9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。

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

（金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第 352 号）

・大株主の状況

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

## 2 投資方針

### (1) 投資方針

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

（東証株価指数）

2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）の受益証券

（NOMURA-B P I 総合指数）

3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

（M S C I コクサイ指数（円ベース））

4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

#### ② 投資態度

イ. 主として、各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。

ロ. 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行

なうことがあります。また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。

<標準組入比率>

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の 30%  
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）受益証券：信託財産の純資産総額の 40%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の 20%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の 10%

ハ. 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。

ニ. 保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。

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. 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として、信託財産総額の 75% 以下とします。

ト. 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。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、<ファンドの特色>をご参照下さい。

## (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(5)(7)、(8)および(9)に定めるものに限りません。）

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、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 4. 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 5. から 24. 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. 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
  3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
  4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
  5. 株券または新株引受権証書
  6. 国債証券
  7. 地方債証券
  8. 特別の法律により法人の発行する債券
  9. 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。）
  10. 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。）
  11. 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。）
  12. 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。）
  13. 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。）
  14. コマーシャル・ペーパー
  15. 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
  16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前5.から前15.までの証券または証書の性質を有するもの
  17. 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。）
  18. 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。）
  19. 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。）
  20. 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。）
  21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  22. 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。）
  23. 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
  24. 外国の者に対する権利で前23.の有価証券の性質を有するもの  
 なお、前5.の証券または証書、前16.ならびに前20.の証券または証書のうち前5.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6.から前10.までの証券および前16.ならびに前20.の証券または証書のうち前6.から前10.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前17.の証券および前18.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

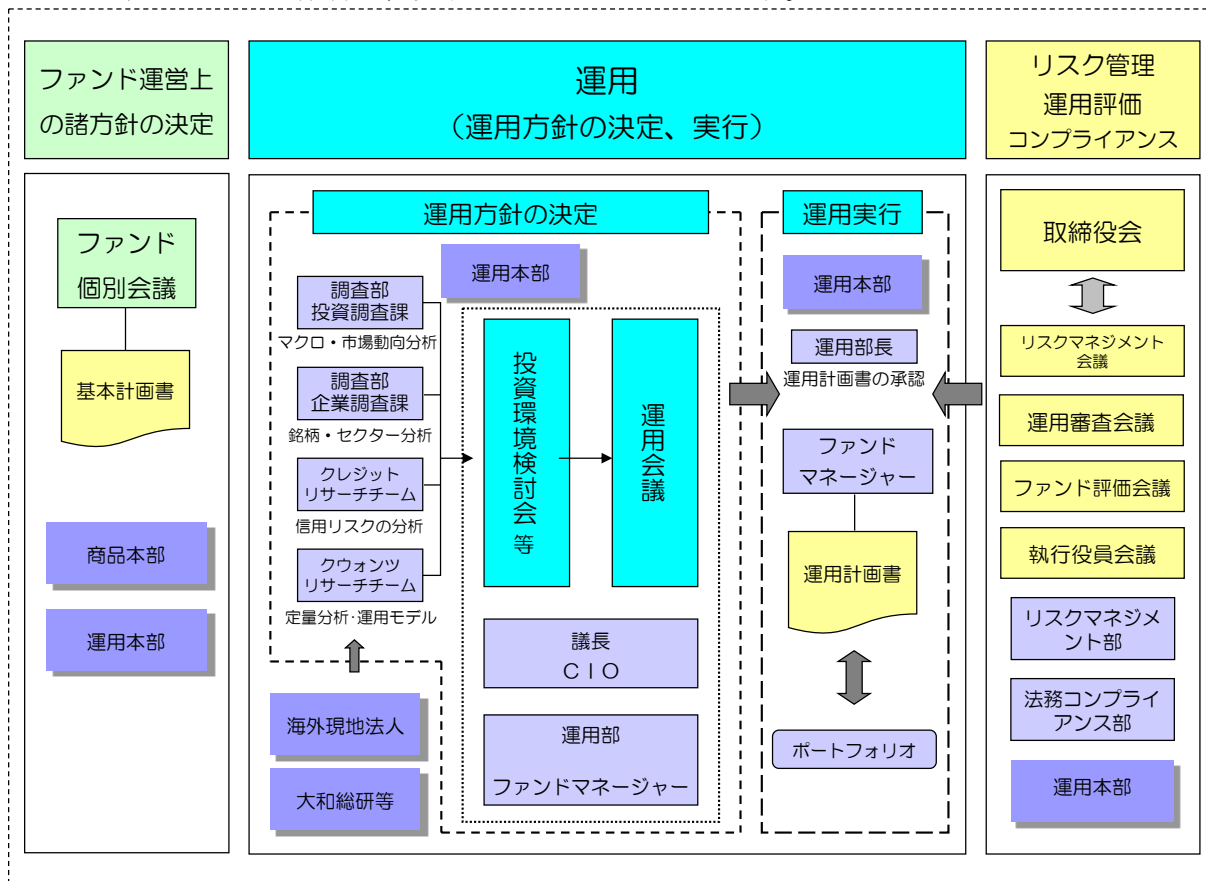
6. 外国の者に対する権利で前 5. の権利の性質を有するもの

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

### (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の的確な状況報告
- ・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2017年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

### (4) 分配方針

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

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

イ. 委託会社は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の70以上となる投資の指図をしません。

ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、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株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

### ② 新株引受権証券等（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、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新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

### ③ 投資信託証券（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所（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。）に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、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投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

### ④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

イ. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ. 前イ.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

### ⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、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当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑥ 信用取引（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができますものとし、かつ次の1.から6.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

ロ. 前イ. の信用取引の指図は、次の1.から6.までに掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から6.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（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。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑦ 先物取引等（信託約款）

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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

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

ロ. 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑧ スワップ取引（信託約款）

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とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）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．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．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。

ヘ．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。

⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財

産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）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の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計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. 前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品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の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ. 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とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）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の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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。

ヘ. 前ホ.においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産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の割合を乗じて得た額をいいます。

ト. 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。

チ. 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。

#### ⑩ デリバティブ取引等（信託約款）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### ⑪ 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、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当該転換社

債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑫ 有価証券の貸付け（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.および2.の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ. 前イ.の1.および2.に定める限度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契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ. 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

⑬ 外貨建資産（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産総額の100分の75を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の75を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、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。

⑭ 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。

⑮ 外国為替予約取引（信託約款）

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

⑯ 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 主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

##### ② 基本的な投資態度

わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行いません。

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

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

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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ができます。

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ができます。

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、異なった受取り金利または異なった受取り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。）を行なうことができます。

(注) 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

## 2. 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、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券

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

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 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ② 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。

#### (注) NOMURA-BPI総合指数とは

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

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

### 3. 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. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
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 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注) M S C I コクサイ指数とは

M S C I コクサイ指数は、M S C I I n c . 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、M S C I コクサイ指数（円ベース）は、M S C I コクサイ指数（米ドルベース）をもとに、M S C I I n c . 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、M S C I I n c . に帰属します。また、M S C I I n c . は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

#### 4. 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 FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

ロ. 保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

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

(2) 投資対象

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（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外国通貨表示の株券または新株引受権証書

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

- ③ 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 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注) FTSE 世界国債インデックスとは

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

### 3 投資リスク

#### (1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債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。

#### ② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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。

#### ③ 外国証券への投資に伴うリスク

##### イ. 為替リスク

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。組入実質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。

なお、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行ないません。このため、当ファンドの基準価額は、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。

④ 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) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者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

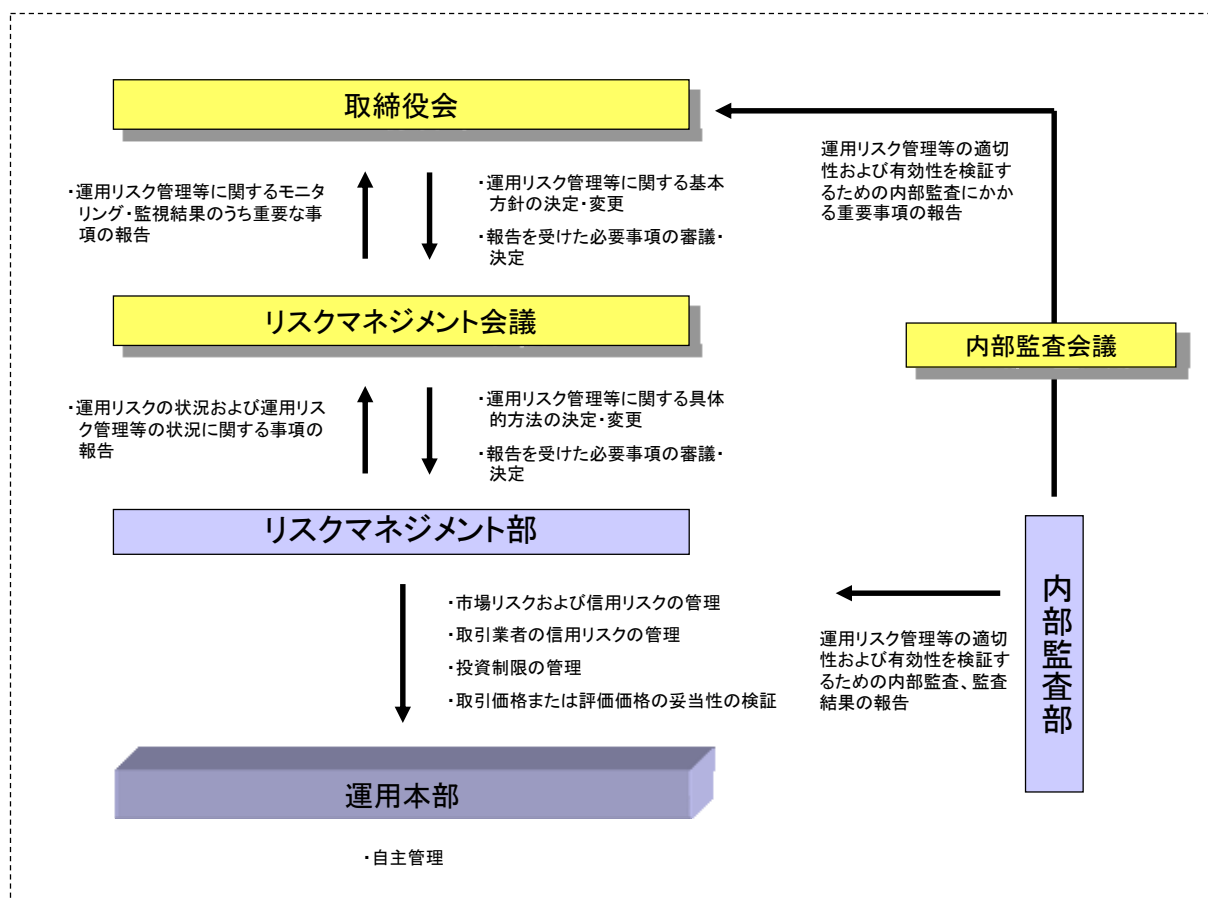
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第 37 条の 6 の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドは、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないません。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが合成ベンチマークと完全に一致するものではありません。

- ・各資産の価格変動により、各資産の組入比率が標準組入比率と一致するとは限らないこと
- ・各資産の騰落率が各資産ごとのベンチマークの騰落率と一致するものではないこと
- ・信託報酬、売買委託手数料等の費用負担

#### (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。



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

### ※資産クラスについて

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

### ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみならず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 0.216%（税抜 0.2%）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、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率 0.08% (税抜)	年率 0.09% (税抜)	年率 0.03% (税抜)

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

- 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ならびに信託財産にかかる監査報酬および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。

<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（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%および地方税 5%）となります。

#### ロ. 解約金および償還金に対する課税

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

#### ハ. 損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたNISAをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税

となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません）。

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

#### ※「つみたてNISA」をご利用の場合

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

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

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

#### 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<sup>\*</sup>され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

#### 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、2017年12月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- (※) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 運用状況

### (1) 投資状況（平成 29 年 12 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	8,663,907,048	99.60
内 日本	8,663,907,048	99.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	34,852,161	0.40
純資産総額	8,698,759,209	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 12 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	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	2,714,421,673	1.2665 3,437,904,448	1.2694 3,445,686,871	39.61
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	2,308,260,130	0.9905 2,286,352,181	1.1300 2,608,333,946	29.99
3	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	708,206,124	2.1929 1,553,065,387	2.4637 1,744,807,427	20.06
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	304,326,604	2.6980 821,081,159	2.8426 865,078,804	9.94

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

##### ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.60%
合計	99.60%

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

##### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 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)
第3計算期間末 (平成20年6月5日)	1,195,229	1,195,229	1.1952	1.1952
第4計算期間末 (平成21年6月5日)	23,530,171	23,530,171	0.9718	0.9718
第5計算期間末 (平成22年6月7日)	201,138,572	201,138,572	0.9766	0.9766
第6計算期間末 (平成23年6月6日)	675,031,030	675,031,030	1.0009	1.0009
第7計算期間末 (平成24年6月5日)	2,513,582,182	2,513,582,182	0.9579	0.9579
第8計算期間末 (平成25年6月5日)	3,768,631,160	3,768,631,160	1.2662	1.2662
第9計算期間末 (平成26年6月5日)	4,783,424,672	4,783,424,672	1.4020	1.4020
第10計算期間末 (平成27年6月5日)	6,170,909,855	6,170,909,855	1.6552	1.6552
第11計算期間末 (平成28年6月6日)	6,343,341,340	6,343,341,340	1.5313	1.5313
平成28年12月末日	7,110,901,462	—	1.6387	—
平成29年1月末日	7,068,509,773	—	1.6310	—
2月末日	7,116,324,905	—	1.6431	—
3月末日	7,222,610,269	—	1.6421	—
4月末日	7,325,370,650	—	1.6549	—
5月末日	7,504,067,166	—	1.6729	—
第12計算期間末 (平成29年6月5日)	7,577,368,811	7,577,368,811	1.6888	1.6888
6月末日	7,657,598,919	—	1.6935	—
7月末日	7,718,034,825	—	1.6981	—
8月末日	7,843,120,531	—	1.7025	—
9月末日	8,056,012,791	—	1.7395	—
10月末日	8,341,361,483	—	1.7757	—
11月末日	8,513,610,811	—	1.7879	—
12月末日	8,698,759,209	—	1.8096	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第3計算期間	0.0000



	1口当たり分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
平成29年6月6日～ 平成29年12月5日	—

### ③ 収益率の推移

	収益率(%)
第3計算期間	△8.3
第4計算期間	△18.7
第5計算期間	0.5
第6計算期間	2.5
第7計算期間	△4.3
第8計算期間	32.2
第9計算期間	10.7
第10計算期間	18.1
第11計算期間	△7.5
第12計算期間	10.3
平成29年6月6日～ 平成29年12月5日	6.0

### (4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第3計算期間	0	0
第4計算期間	27,550,110	4,337,659
第5計算期間	191,357,494	9,608,596
第6計算期間	504,180,591	35,734,472
第7計算期間	2,048,718,597	99,116,492
第8計算期間	630,210,873	277,971,974
第9計算期間	766,679,623	331,047,078
第10計算期間	648,385,457	332,037,184
第11計算期間	781,918,053	367,727,208
第12計算期間	742,279,216	397,980,945
平成29年6月6日～ 平成29年12月5日	511,364,142	237,697,277

(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 12 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	143,609,968,500	98.84
内 日本	143,609,968,500	98.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,691,750,280	1.16
純資産総額	145,301,718,780	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)	1,635,300,000	1.13
内 日本	1,635,300,000	1.13

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

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

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

(2) 投資資産 (平成 29 年 12 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	673,500	6,731.62 4,533,750,749	7,213.00 4,857,955,500	3.34
2	三菱 UFJ フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	3,861,600	709.22 2,738,726,881	826.40 3,191,226,240	2.20
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	246,200	8,909.81 2,193,596,385	8,920.00 2,196,104,000	1.51
4	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	389,800	5,136.58 2,002,241,047	5,301.00 2,066,329,800	1.42
5	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	413,300	4,288.88 1,772,596,890	4,868.00 2,011,944,400	1.38
6	本田技研	日本	株式	輸送用機器	498,200	3,297.04 1,642,589,214	3,862.00 1,924,048,400	1.32
7	ソニー	日本	株式	電気機器	369,800	4,296.64 1,588,898,329	5,083.00 1,879,693,400	1.29
8	キーエンス	日本	株式	電気機器	27,200	60,230.35 1,638,265,568	63,120.00 1,716,864,000	1.18

	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	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,416,000	195.86 1,452,564,843	204.60 1,517,313,600	1.04
10	ファナック	日本	株式	電気機器	52,600	22,763.99 1,197,385,985	27,060.00 1,423,356,000	0.98
11	任天堂	日本	株式	その他製 品	34,100	40,961.59 1,396,790,344	41,190.00 1,404,579,000	0.97
12	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	489,400	2,981.77 1,459,279,594	2,804.50 1,372,522,300	0.94
13	武田薬品	日本	株式	医薬品	203,400	6,191.00 1,259,249,400	6,401.00 1,301,963,400	0.90
14	キヤノン	日本	株式	電気機器	297,900	3,841.84 1,144,485,737	4,200.00 1,251,180,000	0.86
15	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	343,800	3,720.41 1,279,077,936	3,631.00 1,248,337,800	0.86
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	382,900	2,621.31 1,003,701,099	3,113.00 1,191,967,700	0.82
17	日立	日本	株式	電気機器	1,328,000	793.62 1,053,928,256	877.90 1,165,851,200	0.80
18	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	409,500	2,481.56 1,016,200,646	2,800.00 1,146,600,000	0.79
19	信越化学	日本	株式	化学	96,600	10,162.98 981,744,545	11,450.00 1,106,070,000	0.76
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	99,700	10,197.28 1,016,669,809	10,995.00 1,096,201,500	0.75
21	小松製作所	日本	株式	機械	267,400	3,170.54 847,803,372	4,078.00 1,090,457,200	0.75
22	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	228,900	4,408.40 1,009,083,135	4,683.00 1,071,938,700	0.74
23	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信 業	402,300	2,585.22 1,040,036,317	2,661.00 1,070,520,300	0.74
24	東京海上HD	日本	株式	保険業	205,700	4,526.42 931,085,567	5,141.00 1,057,503,700	0.73
25	日本電産	日本	株式	電気機器	66,700	13,744.64 916,767,893	15,810.00 1,054,527,000	0.73
26	パナソニック	日本	株式	電気機器	632,800	1,651.37 1,044,989,926	1,649.50 1,043,803,600	0.72
27	花王	日本	株式	化学	136,400	6,848.82 934,180,230	7,619.00 1,039,231,600	0.72
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	554,000	1,755.22 972,394,031	1,871.50 1,036,811,000	0.71
29	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	196,000	5,027.11 985,313,708	5,238.00 1,026,648,000	0.71
30	ダイキン工業	日本	株式	機械	75,800	11,328.79 858,722,956	13,335.00 1,010,793,000	0.70

(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	98.84%
合計	98.84%

(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	3.27%
食料品	4.40%
繊維製品	0.70%
パルプ・紙	0.27%
化学	7.18%
医薬品	4.36%
石油・石炭製品	0.72%
ゴム製品	0.97%
ガラス・土石製品	1.04%
鉄鋼	1.19%
非鉄金属	0.99%
金属製品	0.70%
機械	5.59%
電気機器	13.55%
輸送用機器	8.81%
精密機器	1.57%
その他製品	2.01%
電気・ガス業	1.49%
陸運業	3.88%
海運業	0.23%
空運業	0.63%
倉庫・運輸関連業	0.20%
情報・通信業	7.17%
卸売業	4.62%
小売業	4.62%
銀行業	7.43%
証券、商品先物取引業	0.98%
保険業	2.25%
その他金融業	1.19%
不動産業	2.23%
サービス業	4.18%
合計	98.84%

(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 2018 年 3 月	買建	90	1,619,653,600	1,635,300,000	1.13%

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

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

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 12 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	12,140,682,980	78.73
内 日本	12,140,682,980	78.73
地方債証券	1,128,883,800	7.32
内 日本	1,128,883,800	7.32
特殊債券	919,819,600	5.96
内 日本	919,819,600	5.96
社債券	1,123,594,700	7.29
内 日本	1,123,594,700	7.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	107,347,111	0.70
純資産総額	15,420,328,191	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 12 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	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	104.38 167,017,600	104.25 166,809,600	0.800000 2022/09/20	1.08
2	126 5年国債	日本	国債証券	164,000,000	100.71 165,164,720	100.63 165,044,680	0.100000 2020/12/20	1.07
3	334 10年国債	日本	国債証券	156,000,000	104.43 162,921,720	104.34 162,776,640	0.600000 2024/06/20	1.06
4	338 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	103.40 157,177,120	103.25 156,943,040	0.400000 2025/03/20	1.02
5	343 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	100.98 153,494,160	100.88 153,349,760	0.100000 2026/06/20	0.99
6	345 10年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.85 151,287,000	100.80 151,207,500	0.100000 2026/12/20	0.98
7	348 10年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.67 151,007,000	100.62 150,942,000	0.100000 2027/09/20	0.98
8	125 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.68 151,030,500	100.58 150,874,500	0.100000 2020/09/20	0.98
9	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	104.95 146,939,800	104.78 146,701,800	1.100000 2021/12/20	0.95

	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 (%)
10	322 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	104.42 146,189,400	104.24 145,938,800	0.900000 2022/03/20	0.95
11	335 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	103.92 145,496,400	103.80 145,327,000	0.500000 2024/09/20	0.94
12	346 10年国債	日本	国債証券	143,000,000	100.78 144,126,840	100.73 144,049,620	0.100000 2027/03/20	0.93
13	128 5年国債	日本	国債証券	137,000,000	100.82 138,129,360	100.72 137,997,360	0.100000 2021/06/20	0.89
14	340 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	103.43 134,461,700	103.32 134,317,300	0.400000 2025/09/20	0.87
15	133 5年国債	日本	国債証券	130,000,000	101.05 131,369,600	100.99 131,290,900	0.100000 2022/09/20	0.85
16	347 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.76 130,989,300	100.70 130,919,100	0.100000 2027/06/20	0.85
17	130 5年国債	日本	国債証券	127,000,000	100.93 128,186,180	100.81 128,033,780	0.100000 2021/12/20	0.83
18	373 2年国債	日本	国債証券	125,000,000	100.31 125,397,500	100.27 125,340,000	0.100000 2019/02/15	0.81
19	32東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	113.27 113,278,800	113.00 113,001,100	2.260000 2024/03/19	0.73
20	129 5年国債	日本	国債証券	110,000,000	100.87 110,964,700	100.76 110,838,200	0.100000 2021/09/20	0.72
21	309 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	103.15 106,244,500	103.00 106,093,090	1.100000 2020/06/20	0.69
22	33 中日本高速道	日本	社債券	100,000,000	103.73 103,730,200	103.69 103,690,800	1.084000 2021/09/17	0.67
23	116 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	103.73 103,739,100	103.63 103,635,600	0.800000 2022/11/25	0.67
24	36 地方公共団体	日本	特殊債券	100,000,000	103.74 103,740,800	103.62 103,621,500	0.892000 2022/05/27	0.67
25	25-6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	103.65 103,656,700	103.59 103,595,000	0.694000 2023/11/22	0.67
26	24-16 愛知県公債	日本	地方債証券	100,000,000	103.63 103,633,300	103.54 103,547,700	0.757000 2023/01/31	0.67
27	308 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	103.66 103,661,000	103.49 103,496,000	1.300000 2020/06/20	0.67
28	117 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	103.39 103,391,700	103.28 103,287,800	0.720000 2022/12/22	0.67
29	190 政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	103.19 103,191,000	103.18 103,189,100	0.605000 2023/05/31	0.67
30	3 兵庫県公債12年	日本	地方債証券	100,000,000	103.30 103,304,200	103.13 103,137,500	0.560000 2025/04/16	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	78.73%
地方債証券	7.32%
特殊債券	5.96%
社債券	7.29%
合計	99.30%

(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。



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 12 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	93,896,631,142	95.54
内 中国	12,246,174	0.01
内 香港	1,324,377,327	1.35
内 シンガポール	481,351,376	0.49
内 イスラエル	182,315,280	0.19
内 ノルウェー	259,541,198	0.26
内 スウェーデン	1,065,695,293	1.08
内 デンマーク	721,097,042	0.73
内 イギリス	6,895,917,714	7.02
内 アイルランド	189,072,526	0.19
内 オランダ	1,420,081,871	1.44
内 ベルギー	434,461,812	0.44
内 フランス	4,107,877,554	4.18
内 ドイツ	3,906,734,205	3.98
内 スイス	3,199,917,445	3.26
内 ポルトガル	56,753,840	0.06
内 スペイン	1,275,688,687	1.30
内 イタリア	933,754,515	0.95
内 フィンランド	368,216,054	0.37
内 オーストリア	101,832,437	0.10
内 カナダ	3,778,964,499	3.85
内 アメリカ	60,684,750,926	61.75
内 オーストラリア	2,427,063,207	2.47
内 ニュージーランド	68,920,160	0.07
投資証券	2,524,469,579	2.57
内 香港	74,010,184	0.08
内 シンガポール	44,000,027	0.04
内 イギリス	85,921,243	0.09
内 フランス	136,078,421	0.14
内 カナダ	18,585,109	0.02
内 アメリカ	1,843,061,369	1.88
内 オーストラリア	322,813,226	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)	1,861,221,333	1.89
純資産総額	98,282,322,054	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)	1,957,508,888	1.99
内 アメリカ	1,957,508,888	1.99
為替予約取引(買建)	598,317,000	0.61
内 日本	598,317,000	0.61

(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 12 月 29 日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の詳細

	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	118,900	19,151.24 2,277,082,436	19,332.04 2,298,579,556	2.34
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	167,550	9,417.42 1,577,888,721	9,686.36 1,622,949,618	1.65
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	9,300	131,223.51 1,220,378,643	134,029.30 1,246,472,490	1.27
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	54,150	19,789.69 1,071,611,714	20,104.96 1,088,683,584	1.11
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	81,320	11,721.49 953,191,567	12,180.27 990,499,556	1.01
6	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	61,400	15,798.53 970,029,742	15,883.28 975,233,392	0.99
7	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	97,105	9,296.51 902,737,604	9,494.26 921,940,117	0.94
8	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,147	115,447.58 825,103,854	118,439.82 846,489,394	0.86
9	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,810	117,223.94 798,295,031	119,322.35 812,585,204	0.83
10	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	228,001	3,195.64 728,609,116	3,367.40 767,770,567	0.78
11	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	108,472	6,404.84 694,745,804	6,926.90 751,374,697	0.76

	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 (%)
12	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	72,550	9,808.32 711,594,124	9,687.09 702,798,670	0.72
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	29,050	21,459.15 623,390,208	22,550.28 655,085,634	0.67
14	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信 サービス	140,291	4,122.24 578,313,172	4,427.34 621,115,956	0.63
15	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	43,218	13,241.34 572,264,232	14,190.54 613,286,758	0.62
16	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	58,617	10,099.94 592,028,183	10,403.91 609,845,992	0.62
17	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	27,350	20,029.25 547,799,988	21,445.14 586,524,579	0.60
18	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信 サービス	93,404	5,638.70 526,677,135	6,037.59 563,935,056	0.57
19	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,900	4,966.35 535,869,165	5,222.86 563,546,594	0.57
20	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	136,363	4,091.73 557,960,578	4,109.81 560,426,021	0.57
21	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	22,076	25,185.44 555,993,773	25,173.01 555,719,369	0.57
22	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	42,300	12,414.18 525,119,814	12,921.55 546,581,565	0.56
23	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	469,500	1,129.29 530,202,782	1,158.46 543,900,163	0.55
24	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	62,823	8,479.52 532,708,885	8,484.04 532,992,845	0.54
25	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	114,100	4,235.24 483,240,884	4,360.67 497,552,447	0.51
26	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	51,750	9,664.00 500,112,104	9,548.54 494,137,049	0.50
27	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	108,440	4,202.47 455,715,847	4,552.77 493,702,379	0.50
28	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	92,950	5,141.50 477,902,425	5,166.36 480,213,162	0.49
29	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	16,480	28,610.98 471,509,082	28,564.80 470,747,970	0.48
30	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	32,600	13,202.92 430,415,192	13,486.55 439,661,530	0.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.54%
投資証券	2.57%

投資有価証券の種類	投資比率
合計	98.11%

(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	6.68%
素材	4.98%
資本財・サービス	10.41%
一般消費財・サービス	11.33%
生活必需品	8.96%
ヘルスケア	11.92%
金融	18.27%
情報技術	16.79%
電気通信サービス	2.52%
公益事業	2.99%
不動産	0.56%
その他	0.11%
合計	95.54%

(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 2018年3月	買建	129	1,942,053,369	1,957,508,888	1.99%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年1 月	買建	5,300,000	599,399,650	598,317,000	0.61%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## 外国債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資状況（平成 29 年 12 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	166,362,386,297	98.34
内 ユーロ	68,672,477,759	40.60
内 シンガポール	642,941,159	0.38
内 マレーシア	768,001,917	0.45
内 ノルウェー	485,618,084	0.29
内 スウェーデン	786,416,944	0.46
内 デンマーク	1,027,728,388	0.61
内 イギリス	11,822,541,157	6.99
内 スイス	298,334,109	0.18
内 ポーランド	1,082,536,041	0.64
内 カナダ	3,632,174,736	2.15
内 アメリカ	71,229,041,395	42.11
内 メキシコ	1,300,640,763	0.77
内 南アフリカ	981,120,679	0.58
内 オーストラリア	3,632,813,166	2.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,799,747,708	1.66
純資産総額	169,162,134,005	100.00

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,409,715,910	0.83
内 日本	1,409,715,910	0.83

(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 12 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	5,900,000	98.80 658,726,268	98.41 656,126,138	2.250000 2027/08/15	0.39
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	99.47 656,462,019	98.97 653,162,419	2.250000 2025/11/15	0.39
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	98.87 646,686,005	98.32 643,056,060	2.125000 2025/05/15	0.38
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	99.92 643,642,689	99.56 641,278,842	2.375000 2027/05/15	0.38
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,029,000	94.47 643,643,258	94.03 640,611,575	1.625000 2026/05/15	0.38
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	98.14 636,888,362	97.61 633,494,307	2.000000 2025/02/15	0.37
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	97.81 634,759,777	97.32 631,566,898	2.000000 2025/08/15	0.37
8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,807,000	165.97 628,655,489	164.86 624,470,008	5.750000 2032/10/25	0.37
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,697,000	125.56 626,385,164	124.73 622,249,506	4.250000 2023/10/25	0.37
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,412,000	101.54 621,010,655	100.99 617,622,635	2.500000 2024/05/15	0.37
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	103.05 608,922,383	102.46 605,459,844	2.750000 2024/02/15	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	97.03 603,097,385	96.63 600,567,880	2.000000 2026/11/15	0.36
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,734,000	161.91 597,361,225	160.57 592,417,617	4.500000 2041/04/25	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	93.28 590,282,168	92.85 587,561,128	1.500000 2026/08/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,162,000	100.73 587,587,466	100.17 584,350,117	2.375000 2024/08/15	0.35
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	103.16 585,324,681	102.61 582,221,151	2.750000 2023/11/15	0.34
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	94.68 574,142,199	94.26 571,583,368	1.625000 2026/02/15	0.34
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,709,000	157.05 574,118,416	156.02 570,364,192	4.750000 2035/04/25	0.34
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,499,000	120.81 570,448,300	120.05 566,831,592	2.750000 2027/10/25	0.34

	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	149.31 568,995,506	148.32 565,219,097	4.000000 2038/10/25	0.33
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,630,000	114.53 561,034,208	113.88 557,830,706	3.000000 2022/04/25	0.33
22	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	2,849,000	144.60 555,921,488	141.91 545,599,165	6.000000 2031/05/01	0.32
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,550,000	114.21 547,127,319	113.56 544,013,578	3.250000 2021/10/25	0.32
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	152.28 539,002,054	151.28 535,466,117	5.500000 2029/04/25	0.32
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	126.42 536,717,958	125.78 533,962,815	3.500000 2026/04/25	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	102.19 520,680,517	101.75 518,469,213	2.625000 2020/11/15	0.31
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	97.96 518,605,138	97.43 515,836,349	1.750000 2023/05/15	0.30
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,399,000	111.21 510,098,582	110.82 508,306,533	1.750000 2024/11/25	0.30
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,280,000	103.99 502,966,254	103.57 500,925,293	3.625000 2020/02/15	0.30
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,380,000	109.84 500,995,408	109.25 498,286,191	3.500000 2020/04/25	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.34%
合計	98.34%

(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 2018年2月	買建	77,000	6,775,476	6,773,690	0.00%
		豪ドル買/円売 2018年1月	買建	205,000	17,552,571	18,064,600	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2018年2月	買建	76,000	6,827,064	6,824,800	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2018年1月	買建	290,000	25,455,258	26,076,800	0.02%
		デンマーク・クローネ買/円売 2018年1月	買建	498,000	8,889,300	9,023,760	0.01%
		米ドル買/円売 2018年1月	買建	4,560,000	513,824,297	515,006,400	0.30%
		ユーロ買/円売 2018年1月	買建	3,951,000	528,182,152	533,108,430	0.32%
		英ポンド買/円売 2018年2月	買建	86,000	13,050,844	13,054,800	0.01%
		英ポンド買/円売 2018年1月	買建	772,000	116,342,605	117,282,240	0.07%
		シンガポール・ドル買/円売 2018年1月	買建	100,000	8,304,000	8,445,000	0.00%
		米ドル買/円売 2018年2月	買建	713,000	80,389,324	80,376,490	0.05%
		ユーロ買/円売 2018年2月	買建	561,000	75,695,954	75,678,900	0.04%

(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

●ダイワ・ライフ・バランス 50

2017年12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	18,096円
純資産総額	86億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.2%
3カ月間	4.0%
6カ月間	6.9%
1年間	10.4%
3年間	16.1%
5年間	65.6%
設定来	81.0%



※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	直近1年間分配金合計額: 0円						設定来分配金合計額: 0円					
	第1期 06年6月	第2期 07年6月	第3期 08年6月	第4期 09年6月	第5期 10年6月	第6期 11年6月	第7期 12年6月	第8期 13年6月	第9期 14年6月	第10期 15年6月	第11期 16年6月	第12期 17年6月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
国内債券	278	39.3%	日本円	70.0%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.0%
国内株式・先物	1,498	30.0%	米ドル	17.4%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.7%
外国株式・先物	1,257	19.6%	ユーロ	6.7%	修正デュレーション	APPLE INC	アメリカ	0.5%
外国債券	765	9.8%	英ポンド	2.1%	残存年数	ソフトバンクグループ	日本	0.5%
外国リート	65	0.5%	カナダ・ドル	1.0%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.4%
外国投資証券	6	0.0%	豪ドル	0.8%	AAA	三井住友フィナンシャルG	日本	0.4%
			スイス・フラン	0.7%	AA	S&P500 E-MINI FUTURE 201803	アメリカ	0.4%
			香港ドル	0.3%	A	本田技研	日本	0.4%
			スウェーデン・クローネ	0.3%	BBB	ソニー	日本	0.4%
コール・ローン、その他	1.6%		その他	0.7%	BB以下・無格付	キーエンス	日本	0.4%
合計	3,869	-	合計	100.0%	合計	合計		5.0%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.7%保有しております。

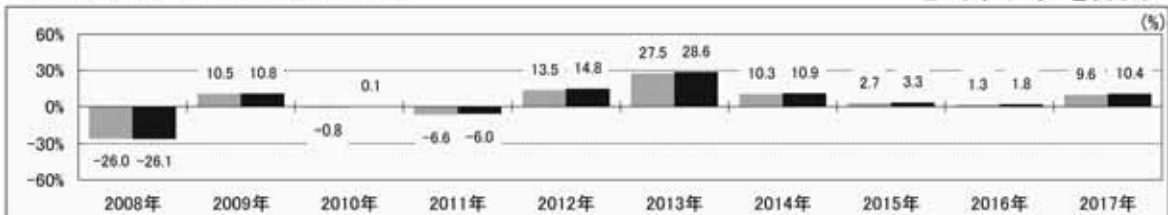
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。

■ベンチマーク ■ファンド



※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。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

※2017年は12月29日までの騰落率を表しています。

※当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

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。

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。

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。

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

### 2 換金（解約）手続等

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

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。

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、委託会社または販売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があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

### 3 資産管理等の概要

#### (1) 資産の評価

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場または最終買気配相場場で評価します。
- ・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6月6日から翌年6月5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、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、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3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 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。
8. 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 4. に該当する場合を除き、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。

9. 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

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ができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前 1. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

3. 前 2. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前 3. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の 2 分の 1 を超えるときは、前 1. の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

6. 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 5. までの規定にしたがいます。

## ③ 反対者の買取請求権

前①の 1. から 6. までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の 3. または前②の 3. の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

## 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られた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の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

### 4 受益者の権利等

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 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、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

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

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12期計算期間（平成28年6月7日から平成29年6月5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 6 月 30 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

貞廣篤典 

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士

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」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス 50 の平成 28 年 6 月 7 日から平成 29 年 6 月 5 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、ダイワ・ライフ・バランス 50 の平成 29 年 6 月 5 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

## ダイワ・ライフ・バランス50

### (1) 貸借対照表

	第11期	第12期
	平成28年6月6日現在	平成29年6月5日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,040,614	41,705,005
親投資信託受益証券	6,317,645,185	7,547,597,126
未収入金	3,817,000	—
流動資産合計	6,360,502,799	7,589,302,131
資産合計	6,360,502,799	7,589,302,131
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,227,367	3,928,808
未払受託者報酬	1,002,085	1,157,256
未払委託者報酬	5,678,685	6,558,002
その他未払費用	253,322	289,254
流動負債合計	17,161,459	11,933,320
負債合計	17,161,459	11,933,320
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	4,142,420,135	4,486,718,406
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,200,921,205	3,090,650,405
(分配準備積立金)	1,699,559,843	1,791,573,292
元本等合計	6,343,341,340	7,577,368,811
純資産合計	6,343,341,340	7,577,368,811
負債純資産合計	6,360,502,799	7,589,302,131

## (2) 損益及び剰余金計算書

	第11期	第12期
	自平成27年6月6日 至平成28年6月6日	自平成28年6月7日 至平成29年6月5日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	13,284	—
有価証券売買等損益	△472,113,326	702,750,941
営業収益合計	△472,100,042	702,750,941
営業費用		
支払利息	2,267	17,028
受託者報酬	2,016,470	2,206,558
委託者報酬	11,427,121	12,504,296
その他費用	504,022	551,632
営業費用合計	13,949,880	15,279,514
営業利益又は営業損失(△)	△486,049,922	687,471,427
経常利益又は経常損失(△)	△486,049,922	687,471,427
当期純利益又は当期純損失(△)	△486,049,922	687,471,427
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)	△26,041,796	26,092,413
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,442,680,565	2,200,921,205
剰余金増加額又は欠損金減少額	457,693,404	440,540,455
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	457,693,404	440,540,455
剰余金減少額又は欠損金増加額	239,444,638	212,190,269
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	239,444,638	212,190,269
分配金 ※1	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,200,921,205	3,090,650,405

### (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 12 期	
	自 平成 28 年 6 月 7 日 至 平成 29 年 6 月 5 日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  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。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  平成 28 年 6 月 5 日が休日のため、前計算期間末日を平成 28 年 6 月 6 日としております。このため、当計算期間は 364 日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 11 期	第 12 期
	平成 28 年 6 月 6 日現在	平成 29 年 6 月 5 日現在
1. ※1 期首元本額	3,728,229,290 円	4,142,420,135 円
期中追加設定元本額	781,918,053 円	742,279,216 円
期中一部解約元本額	367,727,208 円	397,980,945 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,142,420,135 口	4,486,718,406 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 11 期	第 12 期
	自 平成 27 年 6 月 6 日 至 平成 28 年 6 月 6 日	自 平成 28 年 6 月 7 日 至 平成 29 年 6 月 5 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 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (2,080,553,891 円) 及び分配準備積立金 (1,699,559,843 円) より分配可能額は 3,780,113,734 円 (1 万口当たり 9,125.38 円) であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。	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 (241,976,744 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (2,544,702,107 円) 及び分配準備積立金 (1,549,596,548 円) より分配可能額は 4,336,275,399 円 (1 万口当たり 9,664.69 円) であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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 12 期	
	自 平成 28 年 6 月 7 日 至 平成 29 年 6 月 5 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 12 期	
	平成 29 年 6 月 5 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 11 期	第 12 期
	平成 28 年 6 月 6 日現在	平成 29 年 6 月 5 日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	△472, 950, 960	668, 541, 418
合計	△472, 950, 960	668, 541, 418

(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11期 平成28年6月6日現在	第12期 平成29年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第12期 自 平成28年6月7日 至 平成29年6月5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11期 平成28年6月6日現在	第12期 平成29年6月5日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,5313円 (15,313円)	1,6888円 (16,888円)

#### (4) 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	2,324,772,826	2,302,687,484	
	外国株式インデックスマザーファンド	686,960,408	1,504,580,685	
	外国債券インデックスマザーファンド	277,971,494	747,187,375	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	2,363,317,475	2,993,141,582	
親投資信託受益証券 合計			7,547,597,126	
合計			7,547,597,126	

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、「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、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券及び「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成28年6月6日現在	平成29年6月5日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,275,882,043	8,416,676,237
株式 ※3※4	113,662,117,360	131,873,348,770
派生商品評価勘定	—	53,862,334
未収入金	—	10,258,800
未収配当金	888,778,137	973,060,815
未収利息	—	689,950
前払金	11,531,000	—
その他未収収益 ※5	2,741,980	22,332,415
流動資産合計	115,841,050,520	141,350,229,321
資産合計	115,841,050,520	141,350,229,321
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	22,489,239	—
前受金	—	66,305,000
未払解約金	51,454,000	342,344,300
受入担保金	327,229,560	7,602,222,757
その他未払費用	3,736	2,322
流動負債合計	401,176,535	8,010,874,379
負債合計	401,176,535	8,010,874,379
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	143,870,262,666	134,619,084,916
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△28,430,388,681	△1,279,729,974
元本等合計	115,439,873,985	133,339,354,942
純資産合計	115,439,873,985	133,339,354,942
負債純資産合計	115,841,050,520	141,350,229,321

## 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 6 月 7 日 至 平成 29 年 6 月 5 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 28 年 6 月 6 日現在	平成 29 年 6 月 5 日現在
1. ※1 期首	平成 27 年 6 月 6 日	平成 28 年 6 月 7 日
期首元本額	143,418,350,571 円	143,870,262,666 円
期中追加設定元本額	15,856,838,467 円	14,732,212,133 円
期中一部解約元本額	15,404,926,372 円	23,983,389,883 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
適格機関投資家専用投信 1 号	1,613,720,226 円	— 円
トピックス・インデックスファンド	5,950,811,989 円	5,087,008,720 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	15,262,442,446 円	12,567,913,623 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	125,919,106 円	65,644,036 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	190,009,530 円	106,796,703 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	2,865,603,875 円	1,760,452,309 円

ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	120,733,955円	84,133,629円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	4,009,949,748円	2,675,946,800円
D-I's TOPIXインデックス	33,312,637円	33,138,653円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	9,585,543円	27,516,418円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	594,958円	573,610円
iFree TOPIXインデックス	－円	202,458,201円
iFree 8資産バランス	－円	410,146,543円
DCダイワ日本株式インデックス	63,562,276,762円	61,110,462,469円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,396,243,890円	2,305,049,728円
ダイワ・ライフ・バランス50	2,352,182,249円	2,324,772,826円
ダイワ・ライフ・バランス70	2,132,632,548円	2,160,437,804円
年金ダイワ日本株式インデックス	3,672,846,622円	3,908,692,738円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	26,271,324円	22,190,544円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	59,140,945円	59,891,584円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	11,234,939円	13,708,818円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	448,097円	404,752円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	440,730円	400,556円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	941,908円	839,912円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	67,963,626円	15,412,680円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	372,696,872円	99,381,351円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)	203,905,819円	36,767,319円
ダイワ世界バランスファンド40VA	1,638,796,748円	979,143,278円
ダイワ世界バランスファンド60VA	250,770,230円	205,260,076円
ダイワ・バランスファンド35VA	15,409,790,802円	12,662,320,671円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	434,819,547円	336,302,594円



	ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	739,075,396円	551,027,747円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA (適格機関投資家専用)	1,352,388,910円	1,070,919,753円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA (適格機関投資家専 用)	212,438,595円	158,236,001円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA (適格機関投資家専 用)	327,038,769円	266,976,479円
	ダイワ・ノーロード TOP I Xファンド	12,537,164円	48,243,934円
	ダイワファンドラップ TO PIXインデックス	—円	4,924,969,486円
	ダイワTOPIXインデック ス (ダイワSMA専用)	—円	4,269,331円
	ダイワファンドラップオンラ イン TOPIXインデック ス	—円	459,715,813円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	914,667,841円	1,154,270,123円
	ダイワライフスタイル25	219,053,445円	191,737,610円
	ダイワライフスタイル50	674,123,162円	639,422,268円
	ダイワライフスタイル75	515,102,713円	509,344,691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)	16,127,749,000円	15,376,782,735円
	計	143,870,262,666円	134,619,084,916円
2.	期末日における受益権の総数	143,870,262,666口	134,619,084,916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 28,430,388,681円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額は 1,279,729,974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 311,603,600円	株券貸借取引契約により、以下の とおり有価証券の貸付を行って おります。 株式 7,360,814,850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 566,700,000円	先物取引に係る差入委託証拠金 代用有価証券として以下のとお り差入を行っております。 株式 596,800,000円
6.	※5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当 額の未入金分 2,350,611円が含 まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当 額の未入金分 20,718,941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 6 月 7 日 至 平成 29 年 6 月 5 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 6 月 5 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 28 年 6 月 6 日 現在	平成 29 年 6 月 5 日 現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△8,159,172,874	23,760,812,174
合計	△8,159,172,874	23,760,812,174

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成 27 年 9 月 25 日から平成 28 年 6 月 6 日まで、及び平成 28 年 9 月 21 日から平成 29 年 6 月 5 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 28 年 6 月 6 日 現在				平成 29 年 6 月 5 日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,807,031,000	—	1,784,850,000	△22,181,000	1,216,415,000	—	1,270,320,000	53,905,000
合計	1,807,031,000	—	1,784,850,000	△22,181,000	1,216,415,000	—	1,270,320,000	53,905,000

(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 28 年 6 月 6 日 現在	平成 29 年 6 月 5 日 現在
1口当たり純資産額	0.8024円	0.9905円
(1万口当たり純資産額)	(8,024円)	(9,905円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,200	3,065.00	9,808,000	貸付株式数 800株
日本水産	85,200	588.00	50,097,600	
マルハニチロ	12,000	3,185.00	38,220,000	
カネコ種苗	3,100	1,474.00	4,569,400	
サカタのタネ	9,200	3,560.00	32,752,000	
ホクト	6,600	2,047.00	13,510,200	
ショーボンドHD	6,300	5,510.00	34,713,000	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
ミライト・ホールディングス	19,200	1,160.00	22,272,000	
タマホーム	13,300	648.00	8,618,400	
日鉄鉱業	1,800	5,870.00	10,566,000	
三井松島	6,700	1,360.00	9,112,000	
国際石油開発帝石	333,900	1,028.00	343,249,200	
日本海洋掘削	2,400	2,283.00	5,479,200	貸付株式数 700株 (700株)
石油資源開発	9,500	2,216.00	21,052,000	貸付株式数 2,600株
K&Oエナジーグループ	4,000	1,807.00	7,228,000	貸付株式数 1,200株
安藤・間	45,600	804.00	36,662,400	貸付株式数 12,800株
東急建設	22,700	990.00	22,473,000	
コムシスホールディングス	24,300	2,382.00	57,882,600	
ミサワホーム	11,100	995.00	11,044,500	
高松コンストラクションGP	4,600	2,877.00	13,234,200	
東建コーポレーション	2,400	10,280.00	24,672,000	
大成建設	321,000	975.00	312,975,000	
大林組	188,600	1,249.00	235,561,400	
清水建設	193,000	1,140.00	220,020,000	
飛島建設	70,300	175.00	12,302,500	
長谷工コーポレーション	73,900	1,459.00	107,820,100	貸付株式数 20,500株
松井建設	8,200	894.00	7,330,800	
鹿島建設	277,000	868.00	240,436,000	
不動産テトラ	56,600	187.00	10,584,200	
鉄建建設	41,000	350.00	14,350,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
西松建設	73,000	610.00	44,530,000	貸付株式数 20,000株
三井住友建設	243,900	125.00	30,487,500	
大豊建設	24,000	556.00	13,344,000	
前田建設	41,000	1,216.00	49,856,000	貸付株式数 11,000株
奥村組	47,000	752.00	35,344,000	
東鉄工業	7,700	3,530.00	27,181,000	
浅沼組	23,000	324.00	7,452,000	
戸田建設	74,000	716.00	52,984,000	
熊谷組	101,000	345.00	34,845,000	
北野建設	18,000	322.00	5,796,000	

三井ホーム	12,000	743.00	8,916,000	
矢作建設	9,700	908.00	8,807,600	
ピーエス三菱	16,000	503.00	8,048,000	
日本ハウスHLDGS	17,400	546.00	9,500,400	貸付株式数 3,100株
大東建託	23,100	17,705.00	408,985,500	
新日本建設	7,900	1,025.00	8,097,500	
NIPPO	13,000	2,281.00	29,653,000	貸付株式数 3,000株
東亜道路	21,000	474.00	9,954,000	
前田道路	18,000	2,284.00	41,112,000	
日本道路	18,000	577.00	10,386,000	
東亜建設	6,700	2,136.00	14,311,200	
若築建設	57,000	169.00	9,633,000	
東洋建設	20,700	423.00	8,756,100	
五洋建設	69,600	638.00	44,404,800	
大林道路	8,000	939.00	7,512,000	
世紀東急	16,800	584.00	9,811,200	
福田組	10,000	1,049.00	10,490,000	
住友林業	42,800	1,847.00	79,051,600	
日本基礎技術	11,900	368.00	4,379,200	
日成ビルド工業	21,000	669.00	14,049,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
パナホーム	24,000	1,219.00	29,256,000	
大和ハウス	185,300	3,703.00	686,165,900	
ライト工業	12,300	1,244.00	15,301,200	
積水ハウス	193,300	1,954.00	377,708,200	
ユアテック	8,000	769.00	6,152,000	
西部電気工業	3,200	2,283.00	7,305,600	
中電工	5,400	2,875.00	15,525,000	
関電工	25,000	1,139.00	28,475,000	貸付株式数 7,000株
きんでん	41,200	1,736.00	71,523,200	
東京エネシス	6,700	979.00	6,559,300	
トーエネック	8,000	686.00	5,488,000	
住友電設	4,800	1,542.00	7,401,600	
日本電設工業	10,000	2,339.00	23,390,000	貸付株式数 1,500株
協和エクシオ	24,300	1,858.00	45,149,400	
日本工営	3,800	3,175.00	12,065,000	貸付株式数 1,000株
九電工	12,400	3,965.00	49,166,000	貸付株式数 3,400株
三機工業	13,400	1,208.00	16,187,200	
日揮	59,100	1,740.00	102,834,000	
中外炉工業	29,000	217.00	6,293,000	
太平電業	9,000	1,320.00	11,880,000	
高砂熱学	16,600	1,835.00	30,461,000	
NECネットエスアイ	6,000	2,544.00	15,264,000	
明星工業	13,400	659.00	8,830,600	
大気社	7,200	3,085.00	22,212,000	貸付株式数 800株
ダイダン	9,000	1,202.00	10,818,000	
日比谷総合設備	4,400	1,811.00	7,968,400	
東芝プラントシステム	10,500	1,669.00	17,524,500	
日本製粉	17,100	1,814.00	31,019,400	
日清製粉G本社	67,700	1,897.00	128,426,900	

昭和産業	24,000	617.00	14,808,000	
中部飼料	8,500	1,406.00	11,951,000	
フィード・ワン	47,000	227.00	10,669,000	
日本甜菜糖	2,400	2,300.00	5,520,000	
三井製糖	4,500	3,300.00	14,850,000	
塩水港精糖	22,600	241.00	5,446,600	
日新製糖	800	1,874.00	1,499,200	
L i f u l l	16,400	717.00	11,758,800	貸付株式数 5,200株 (5,200株)
ジェイエイシーリクルートメント	4,300	1,669.00	7,176,700	
日本M&Aセンター	17,200	4,525.00	77,830,000	
タケエイ	7,400	1,144.00	8,465,600	貸付株式数 1,900株
トラスト・テック	3,300	2,236.00	7,378,800	
パソナグループ	6,100	963.00	5,874,300	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
CDS	8,000	1,401.00	11,208,000	
リンクアンドモチベーション	18,300	849.00	15,536,700	貸付株式数 4,500株 (4,400株)
GCA	7,500	923.00	6,922,500	貸付株式数 1,800株
エス・エム・エス	8,600	3,250.00	27,950,000	
テンプホールディングス	46,000	2,203.00	101,338,000	
リニカル	4,000	1,698.00	6,792,000	貸付株式数 1,100株
クックパッド	14,700	925.00	13,597,500	貸付株式数 3,800株
森永製菓	12,500	6,830.00	85,375,000	
中村屋	2,100	5,060.00	10,626,000	
江崎グリコ	15,800	6,480.00	102,384,000	貸付株式数 4,400株
不二家	39,000	264.00	10,296,000	
山崎製パン	46,100	2,395.00	110,409,500	貸付株式数 5,300株
モロゾフ	19,000	632.00	12,008,000	
亀田製菓	3,700	5,770.00	21,349,000	
寿スピリッツ	6,000	3,930.00	23,580,000	
カルビー	25,700	4,480.00	115,136,000	貸付株式数 7,200株 (600株)
森永乳業	60,000	944.00	56,640,000	
六甲バター	3,200	2,765.00	8,848,000	
ヤクルト	34,100	8,110.00	276,551,000	貸付株式数 8,400株
明治ホールディングス	37,500	9,410.00	352,875,000	
雪印メグミルク	13,700	3,405.00	46,648,500	
プリマハム	41,000	645.00	26,445,000	
日本ハム	44,000	3,505.00	154,220,000	
丸大食品	30,000	526.00	15,780,000	
S F o o d s	3,600	3,885.00	13,986,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
伊藤ハム米久HLDGS	36,800	1,042.00	38,345,600	貸付株式数 500株
スタジオアリス	2,900	2,384.00	6,913,600	
シミックホールディングス	3,900	1,416.00	5,522,400	
システナ	5,200	2,315.00	12,038,000	
デジタルアーツ	3,000	4,025.00	12,075,000	貸付株式数 500株
新日鉄住金SOL	9,400	2,675.00	25,145,000	

総合警備保障	21,300	5,330.00	113,529,000	貸付株式数	5,900株
いちご	58,700	326.00	19,136,200		
日本駐車場開発	71,100	158.00	11,233,800	貸付株式数	21,800株 (21,700株)
カカクコム	43,300	1,618.00	70,059,400	貸付株式数	12,300株 (12,300株)
ルネサンス	4,700	2,039.00	9,583,300		
ディップ	8,000	2,591.00	20,728,000	貸付株式数	2,100株
SBSホールディングス	6,400	815.00	5,216,000		
オプトホールディング	8,600	1,463.00	12,581,800	貸付株式数	1,900株 (1,900株)
新日本科学	12,400	625.00	7,750,000		
ツクイ	21,500	685.00	14,727,500	貸付株式数	5,000株
エムスリー	51,500	3,330.00	171,495,000	貸付株式数	14,200株
アウトソーシング	4,300	5,130.00	22,059,000	貸付株式数	900株 (100株)
ウェルネット	6,900	1,544.00	10,653,600	貸付株式数	1,600株
ディー・エヌ・エー	28,000	2,440.00	68,320,000		
博報堂DYHLDGS	81,000	1,513.00	122,553,000		
ぐるなび	8,800	2,011.00	17,696,800		
エスアールジータカミヤ	10,100	562.00	5,676,200		
ジャパンベストレスキューS	31,200	265.00	8,268,000		
ファンコミュニケーションズ	17,900	1,012.00	18,114,800	貸付株式数	4,300株 (1,200株)
ティア	9,900	782.00	7,741,800		
インフォマート	28,700	871.00	24,997,700		
サッポロホールディングス	21,100	3,290.00	69,419,000		
アサヒグループホールディン	119,100	4,500.00	535,950,000		
キリンHD	272,700	2,445.00	666,751,500		
宝ホールディングス	45,200	1,200.00	54,240,000		
オエノンホールディングス	31,000	274.00	8,494,000		
コカ・コーラボトラーズJ	39,600	3,650.00	144,540,000		
サントリー食品インター	43,200	5,510.00	238,032,000		
ダイドーグループHD	2,700	5,870.00	15,849,000	貸付株式数	700株
伊藤園	18,700	4,460.00	83,402,000		
キーコーヒー	6,200	2,222.00	13,776,400		
日清オイリオグループ	35,000	677.00	23,695,000		
不二製油グループ	16,800	2,745.00	46,116,000		
J-オイルミルズ	2,400	4,135.00	9,924,000		
ローソン	18,400	7,650.00	140,760,000		
サンエー	4,200	5,200.00	21,840,000		
カワチ薬品	4,600	2,770.00	12,742,000		
エービーシー・マート	10,200	6,660.00	67,932,000	貸付株式数	1,700株
ハードオフコーポレーション	4,400	1,110.00	4,884,000		
アスクル	6,100	3,350.00	20,435,000	貸付株式数	1,700株 (100株)
ゲオホールディングス	9,100	1,175.00	10,692,500	貸付株式数	2,700株
アダストリア	9,100	2,903.00	26,417,300		
くらコーポレーション	3,700	4,770.00	17,649,000		
キャンドウ	4,300	1,721.00	7,400,300	貸付株式数	1,300株

エレマテック	2,600	1,801.00	4,682,600	
パルグループHLDGS	3,100	2,807.00	8,701,700	
エディオン	20,800	1,071.00	22,276,800	貸付株式数 8,800株
あらた	2,900	3,625.00	10,512,500	貸付株式数 700株 (600株)
サーラコーポレーション	7,800	672.00	5,241,600	
ワッツ	6,900	1,288.00	8,887,200	
ハローズ	2,100	2,383.00	5,004,300	
J Pホールディングス	27,400	301.00	8,247,400	貸付株式数 6,100株 (2,000株)
あみやき亭	1,500	4,130.00	6,195,000	
ひらまつ	10,700	664.00	7,104,800	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
フィールズ	4,400	1,197.00	5,266,800	貸付株式数 1,200株
双日	317,700	268.00	85,143,600	
ゲンキー	2,600	3,025.00	7,865,000	貸付株式数 600株 (200株)
アルフレッサホールディングス	65,400	2,194.00	143,487,600	
大黒天物産	1,500	5,600.00	8,400,000	貸付株式数 400株 (400株)
ハニーズホールディングス	6,000	1,170.00	7,020,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
キッコーマン	43,200	3,620.00	156,384,000	貸付株式数 12,300株
味の素	130,400	2,412.00	314,524,800	
キューピー	32,500	2,964.00	96,330,000	
ハウス食品G本社	22,900	2,895.00	66,295,500	
カゴメ	23,000	3,635.00	83,605,000	
アリアケジャパン	5,200	8,200.00	42,640,000	
ニチレイ	31,200	3,185.00	99,372,000	
横浜冷凍	14,300	1,095.00	15,658,500	貸付株式数 4,000株 (3,900株)
東洋水産	30,700	4,430.00	136,001,000	
日清食品HD	24,600	7,270.00	178,842,000	貸付株式数 200株
永谷園ホールディングス	8,000	1,421.00	11,368,000	
フジッコ	6,400	2,698.00	17,267,200	
ロックフィールド	7,500	2,070.00	15,525,000	貸付株式数 1,800株
日本たばこ産業	349,000	4,183.00	1,459,867,000	
ケンコーマヨネーズ	3,700	3,165.00	11,710,500	
わらべや日洋HD	4,000	3,140.00	12,560,000	
ユーグレナ	20,400	1,209.00	24,663,600	貸付株式数 5,900株 (5,800株)
片倉工業	7,900	1,398.00	11,044,200	
グンゼ	44,000	390.00	17,160,000	
ヒューリック	115,700	1,066.00	123,336,200	貸付株式数 32,500株
山下医科器械	3,300	1,734.00	5,722,200	
アルペン	4,300	1,973.00	8,483,900	
クオール	6,600	1,749.00	11,543,400	
アルコニックス	5,100	1,966.00	10,026,600	
神戸物産	3,200	4,535.00	14,512,000	



ジズズ	3,900	6,580.00	25,662,000	貸付株式数	1,000株
ビックカメラ	31,300	1,201.00	37,591,300	貸付株式数	8,900株 (8,900株)
DCMホールディングス	32,700	988.00	32,307,600	貸付株式数	9,100株 (9,100株)
MonotaRO	20,400	3,925.00	80,070,000	貸付株式数	5,700株
あいホールディングス	8,600	2,986.00	25,679,600	貸付株式数	2,900株
ディービーエックス	5,600	1,289.00	7,218,400	貸付株式数	1,000株
アークランドサービスHD	2,600	3,685.00	9,581,000	貸付株式数	600株
J. フロント リテイリング	69,800	1,649.00	115,100,200	貸付株式数	19,500株
ドトール・日レスHD	9,500	2,406.00	22,857,000		
マツモトキヨシHLDGS	10,400	6,810.00	70,824,000		
broncoビリー	3,300	2,692.00	8,883,600	貸付株式数	900株 (900株)
スタートトゥデイ	51,200	2,966.00	151,859,200		
物語コーポレーション	2,000	5,460.00	10,920,000		
ココカラファイン	5,900	5,830.00	34,397,000		
三越伊勢丹HD	110,100	1,148.00	126,394,800	貸付株式数	30,900株
東洋紡	238,000	193.00	45,934,000		
ユニチカ	219,000	80.00	17,520,000		
富士紡ホールディングス	3,600	3,365.00	12,114,000		
日清紡ホールディングス	28,300	1,075.00	30,422,500		
倉敷紡績	59,000	267.00	15,753,000		
ダイワボウHD	68,000	417.00	28,356,000		
シキボウ	63,000	138.00	8,694,000		
日東紡績	48,000	539.00	25,872,000		
トヨタ紡織	19,600	2,230.00	43,708,000		
マクニカ・富士エレHLDGS	10,500	1,636.00	17,178,000		
ウエルシアHD	14,400	4,230.00	60,912,000		
クリエイトSDH	7,800	2,688.00	20,966,400	貸付株式数	2,100株
バイタルKSKHD	9,400	971.00	9,127,400		
UKCホールディングス	3,500	1,975.00	6,912,500		
丸善CHI HD	13,000	350.00	4,550,000		
TOKAIホールディングス	24,800	842.00	20,881,600	貸付株式数	6,900株
三洋貿易	4,900	2,252.00	11,034,800		
チムニー	2,000	2,772.00	5,544,000	貸付株式数	500株
ウイン・パートナーズ	5,500	1,229.00	6,759,500		
ジョイフル本田	8,700	3,805.00	33,103,500	貸付株式数	1,400株
鳥貴族	3,000	2,783.00	8,349,000	貸付株式数	500株 (500株)
すかいらく	23,600	1,772.00	41,819,200	貸付株式数	600株
綿半ホールディングス	3,300	2,007.00	6,623,100		
日本毛織	12,600	880.00	11,088,000		
ダイドーリミテッド	24,300	433.00	10,521,900		
ユナイテッド・スーパーマーケ	17,700	1,130.00	20,001,000		
野村不動産HLDGS	40,000	2,393.00	95,720,000	貸付株式数	10,200株
三重交通グループHD	11,900	395.00	4,700,500		

サムティ	5,600	1,193.00	6,680,800	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本商業開発	3,900	1,617.00	6,306,300	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
プレサンスコーポレーション	9,300	1,517.00	14,108,100		
ユニゾホールディングス	5,300	2,863.00	15,173,900		
日本管理センター	4,600	1,333.00	6,131,800	貸付株式数	1,300株 (1,200株)
フージャースHD	13,000	888.00	11,544,000		
オープンハウス	8,300	3,540.00	29,382,000		
東急不動産HD	130,600	677.00	88,416,200		
飯田GHD	46,100	1,848.00	85,192,800		
帝国繊維	6,400	1,904.00	12,185,600	貸付株式数	900株
ブックオフコーポレーション	10,200	779.00	7,945,800	貸付株式数	2,400株
日本コークス工業	78,600	97.00	7,624,200		
あさひ	5,100	1,397.00	7,124,700		
日本調剤	2,100	3,815.00	8,011,500	貸付株式数	500株 (100株)
コスモス薬品	2,800	24,080.00	67,424,000		
シップヘルスケアHD	10,600	3,195.00	33,867,000		
一六堂	22,100	388.00	8,574,800		
ソフトクリエイトHD	5,700	1,429.00	8,145,300		
セブン&アイ・HLDGS	231,900	4,815.00	1,116,598,500		
薬王堂	3,400	3,455.00	11,747,000	貸付株式数	800株
クリエイト・レストランツ・ホール	14,500	1,017.00	14,746,500		
ツルハホールディングス	11,400	12,940.00	147,516,000	貸付株式数	3,100株
サンマルクホールディングス	3,600	3,455.00	12,438,000	貸付株式数	1,000株
トリドールホールディングス	7,100	2,883.00	20,469,300	貸付株式数	1,900株
帝人	47,700	2,077.00	99,072,900		
東レ	425,200	929.50	395,223,400	貸付株式数	87,000株
クラレ	97,500	2,038.00	198,705,000		
旭化成	367,000	1,093.50	401,314,500		
サカイオーベックス	3,300	1,732.00	5,715,600		
稲葉製作所	800	1,408.00	1,126,400		
宮地エンジニアリングG	31,000	253.00	7,843,000		
トーカロ	4,200	3,660.00	15,372,000	貸付株式数	1,000株
SUMCO	63,100	1,915.00	120,836,500	貸付株式数	17,400株
川田テクノロジーズ	1,400	6,930.00	9,702,000	貸付株式数	300株 (300株)
住江織物	21,000	249.00	5,229,000		
アツギ	74,000	125.00	9,250,000		
コメダホールディングス	10,200	1,964.00	20,032,800		
ダイユー・リックHLDGS	9,500	781.00	7,419,500		
クスリのアオキHLDGS	4,800	5,590.00	26,832,000	貸付株式数	900株
共和レザー	4,300	931.00	4,003,300		
セーレン	14,900	1,723.00	25,672,700	貸付株式数	4,100株
ソトー	6,100	1,164.00	7,100,400		
東海染工	53,000	134.00	7,102,000		
小松精練	11,900	758.00	9,020,200		

ワコールホールディングス	31,000	1,495.00	46,345,000	
ホギメディカル	3,700	7,730.00	28,601,000	
T S I ホールディングス	23,000	765.00	17,595,000	
T I S	18,500	3,270.00	60,495,000	
電算システム	3,000	1,740.00	5,220,000	
グリー	39,800	943.00	37,531,400	貸付株式数 10,200 株
コーエーテクモHD	12,500	2,387.00	29,837,500	
三菱総合研究所	2,500	3,140.00	7,850,000	
ファインデックス	6,200	938.00	5,815,600	貸付株式数 1,300 株
K L a b	12,200	1,540.00	18,788,000	貸付株式数 3,300 株 (3,300 株)
ポールトゥウィン・ピットクル	6,200	1,556.00	9,647,200	
ネクソン	60,900	2,198.00	133,858,200	
アイスタイル	13,200	1,010.00	13,332,000	貸付株式数 2,600 株 (2,600 株)
エイチーム	4,800	3,180.00	15,264,000	貸付株式数 1,000 株
テクノスジャパン	4,900	1,154.00	5,654,600	貸付株式数 1,300 株 (100 株)
コロプラ	20,100	1,207.00	24,260,700	貸付株式数 5,300 株 (4,500 株)
ブロードリーフ	18,300	740.00	13,542,000	
ハーツユナイテッドグループ	4,800	1,668.00	8,006,400	貸付株式数 1,100 株
特種東海製紙	3,000	4,205.00	12,615,000	
ティーガイア	5,600	2,070.00	11,592,000	貸付株式数 1,600 株 (1,600 株)
豆蔵ホールディングス	7,700	1,064.00	8,192,800	
テクマトリックス	5,200	1,856.00	9,651,200	貸付株式数 1,200 株
ガンホー・オンライン・エンター	122,700	284.00	34,846,800	貸付株式数 33,200 株
GMOペイメントゲートウェイ	4,700	6,650.00	31,255,000	貸付株式数 1,300 株
インターネットイニシアティブ	10,300	2,186.00	22,515,800	
さくらインターネット	6,200	930.00	5,766,000	貸付株式数 1,400 株
S R Aホールディングス	3,000	3,050.00	9,150,000	
朝日ネット	16,300	492.00	8,019,600	
コムチュア	1,500	4,845.00	7,267,500	貸付株式数 400 株
王子ホールディングス	216,000	562.00	121,392,000	
日本製紙	25,500	2,140.00	54,570,000	
三菱製紙	11,400	766.00	8,732,400	
北越紀州製紙	31,900	874.00	27,880,600	
中越パルプ	27,000	243.00	6,561,000	貸付株式数 10,000 株 (10,000 株)
巴川製紙	30,000	248.00	7,440,000	
大王製紙	24,100	1,403.00	33,812,300	貸付株式数 6,400 株 (6,200 株)
g u m i	7,900	1,347.00	10,641,300	貸付株式数 1,700 株
L I N E	12,700	4,070.00	51,689,000	貸付株式数 2,900 株
レンゴー	58,600	633.00	37,093,800	
トーモク	24,000	382.00	9,168,000	

ザ・パック	3,900	3,580.00	13,962,000	
昭和電工	43,400	2,362.00	102,510,800	
住友化学	432,000	603.00	260,496,000	
住友精化	2,600	5,130.00	13,338,000	
日産化学	32,100	3,875.00	124,387,500	貸付株式数 8,900株 (7,400株)
ラサ工業	82,000	142.00	11,644,000	
クレハ	4,300	5,750.00	24,725,000	貸付株式数 1,200株
テイカ	11,000	1,050.00	11,550,000	
石原産業	12,600	1,088.00	13,708,800	
日東エフシー	1,700	893.00	1,518,100	
日本曹達	35,000	584.00	20,440,000	
東ソー	169,000	1,023.00	172,887,000	
トクヤマ	99,000	516.00	51,084,000	
セントラル硝子	59,000	463.00	27,317,000	
東亜合成	35,000	1,329.00	46,515,000	
大阪ソーダ	26,000	519.00	13,494,000	
関東電化	12,900	917.00	11,829,300	
デンカ	117,000	580.00	67,860,000	
イビデン	41,800	2,014.00	84,185,200	貸付株式数 11,400株
信越化学	105,500	10,240.00	1,080,320,000	
日本カーバイド	68,000	162.00	11,016,000	
堺化学	17,000	423.00	7,191,000	
エア・ウォーター	47,300	2,047.00	96,823,100	貸付株式数 13,200株
大陽日酸	45,000	1,164.00	52,380,000	
日本化学工業	26,000	216.00	5,616,000	
日本パーカライズニング	29,700	1,686.00	50,074,200	貸付株式数 8,200株
高压ガス	10,400	786.00	8,174,400	
四国化成	9,000	1,380.00	12,420,000	
戸田工業	16,000	274.00	4,384,000	貸付株式数 4,000株
ステラケミファ	3,600	3,035.00	10,926,000	貸付株式数 900株
保土谷化学	2,700	4,070.00	10,989,000	貸付株式数 600株
日本触媒	9,200	6,840.00	62,928,000	
大日精化	23,000	845.00	19,435,000	
カネカ	78,000	846.00	65,988,000	
協和発酵キリン	70,300	1,959.00	137,717,700	
三菱瓦斯化学	54,600	2,318.00	126,562,800	
三井化学	267,000	585.00	156,195,000	
JSR	58,900	1,906.00	112,263,400	
東京応化工業	11,200	3,980.00	44,576,000	貸付株式数 3,100株
大阪有機化学	6,200	1,321.00	8,190,200	
三菱ケミカルHLDGS	395,100	861.20	340,260,120	
ダイセル	80,900	1,327.00	107,354,300	
住友ベークライト	51,000	799.00	40,749,000	貸付株式数 14,000株
積水化学	133,000	2,010.00	267,330,000	
日本ゼオン	50,000	1,161.00	58,050,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
アイカ工業	17,700	3,380.00	59,826,000	
宇部興産	294,000	271.00	79,674,000	
積水樹脂	7,800	2,092.00	16,317,600	貸付株式数 500株

タキロンシーアイ	15,000	574.00	8,610,000	
旭有機材	33,000	244.00	8,052,000	
日立化成	32,100	3,145.00	100,954,500	
ニチバン	7,000	986.00	6,902,000	
リケンテクノス	13,500	559.00	7,546,500	貸付株式数 3,700株
大倉工業	22,000	612.00	13,464,000	
積水化成成品	7,400	860.00	6,364,000	
群栄化学	1,800	3,665.00	6,597,000	
タイガース ポリマー	5,900	763.00	4,501,700	
ダイキョーニシカワ	10,500	1,527.00	16,033,500	貸付株式数 2,800株 (2,500株)
日本化薬	38,000	1,577.00	59,926,000	
カーリットホールディングス	13,200	592.00	7,814,400	
E P Sホールディングス	7,600	1,710.00	12,996,000	
プレステージ・インター	12,000	1,154.00	13,848,000	
アミューズ	3,900	3,030.00	11,817,000	
野村総合研究所	41,200	4,350.00	179,220,000	
ドリームインキュベータ	3,100	2,125.00	6,587,500	貸付株式数 200株
クイック	4,400	1,480.00	6,512,000	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ケネディクス	76,600	560.00	42,896,000	
電通	65,700	5,730.00	376,461,000	貸付株式数 18,800株 (18,800株)
インテージホールディングス	3,700	2,198.00	8,132,600	
イオンファンタジー	1,900	3,285.00	6,241,500	貸付株式数 700株 (700株)
シーティーエス	9,800	1,222.00	11,975,600	
日本精化	7,600	1,004.00	7,630,400	
扶桑化学工業	4,400	3,835.00	16,874,000	貸付株式数 1,200株
ADEKA	23,500	1,683.00	39,550,500	
日油	45,000	1,459.00	65,655,000	
ミヨシ油脂	61,000	146.00	8,906,000	
花王	147,900	7,163.00	1,059,407,700	
第一工業製薬	19,000	471.00	8,949,000	
三洋化成	3,400	5,220.00	17,748,000	
武田薬品	221,000	5,806.00	1,283,126,000	
アステラス製薬	600,500	1,414.50	849,407,250	
大日本住友製薬	41,900	1,750.00	73,325,000	貸付株式数 11,700株
塩野義製薬	74,400	5,968.00	444,019,200	
田辺三菱製薬	68,300	2,558.00	174,711,400	
あすか製薬	7,000	1,754.00	12,278,000	
日本新薬	13,500	6,780.00	91,530,000	
中外製薬	58,900	4,365.00	257,098,500	貸付株式数 16,400株
科研製薬	10,900	6,320.00	68,888,000	
エーザイ	71,800	6,113.00	438,913,400	貸付株式数 20,200株
理研ビタミン	1,500	4,480.00	6,720,000	
ロート製薬	28,900	2,413.00	69,735,700	
小野薬品	135,800	2,344.50	318,383,100	貸付株式数 37,800株
久光製薬	16,600	5,820.00	96,612,000	貸付株式数 4,600株
持田製薬	4,000	8,060.00	32,240,000	

参天製薬	106,200	1,608.00	170,769,600	貸付株式数	29,700株
扶桑薬品	2,700	2,829.00	7,638,300		
日本ケミファ	1,200	5,300.00	6,360,000		
ツムラ	19,600	4,175.00	81,830,000		
日医工	14,500	1,651.00	23,939,500	貸付株式数	3,900株
テルモ	85,700	4,560.00	390,792,000		
みらかホールディングス	14,800	4,825.00	71,410,000		
キッセイ薬品工業	10,200	2,946.00	30,049,200		
生化学工業	10,800	1,842.00	19,893,600		
栄研化学	5,000	3,300.00	16,500,000		
日水製薬	3,800	1,404.00	5,335,200		
鳥居薬品	4,200	2,820.00	11,844,000		
JCRファーマ	5,300	2,794.00	14,808,200		
東和薬品	3,000	5,240.00	15,720,000	貸付株式数	700株
富士製薬工業	2,600	3,925.00	10,205,000		
沢井製薬	10,200	6,020.00	61,404,000		
ゼリア新薬工業	11,900	1,752.00	20,848,800		
第一三共	171,600	2,466.50	423,251,400		
キョーリン製薬HD	13,800	2,387.00	32,940,600		
大幸薬品	4,000	1,878.00	7,512,000		
ダイト	3,800	2,336.00	8,876,800		
大塚ホールディングス	127,300	5,058.00	643,883,400		
大正製薬HD	12,400	9,000.00	111,600,000		
ペプチドリーム	11,000	6,490.00	71,390,000	貸付株式数	3,000株
大日本塗料	37,000	276.00	10,212,000		
日本ペイントHOLD	45,100	4,420.00	199,342,000		
関西ペイント	61,700	2,425.00	149,622,500	貸付株式数	17,200株
中国塗料	16,300	821.00	13,382,300		
日本特殊塗料	4,300	1,662.00	7,146,600	貸付株式数	1,100株
藤倉化成	11,100	635.00	7,048,500		
太陽ホールディングス	4,700	5,000.00	23,500,000	貸付株式数	800株
DIC	23,000	3,995.00	91,885,000		
サカタインクス	11,700	1,744.00	20,404,800		
東洋インキSCホールディン	53,000	571.00	30,263,000		
T&K TOKA	6,300	1,180.00	7,434,000		
アルプス技研	2,600	3,850.00	10,010,000		
オリエンタルランド	63,400	7,532.00	477,528,800	貸付株式数	17,800株
ダスキン	14,500	2,892.00	41,934,000		
パーク24	28,700	2,933.00	84,177,100	貸付株式数	100株 (100株)
明光ネットワークジャパン	9,000	1,454.00	13,086,000		
ファルコホールディングス	6,400	1,508.00	9,651,200		
フジ・メディア・HD	57,500	1,527.00	87,802,500		
ラウンドワン	22,700	1,124.00	25,514,800		
リゾートトラスト	23,200	2,117.00	49,114,400	貸付株式数	6,400株
オービック	19,200	6,520.00	125,184,000	貸付株式数	5,300株
ジャストシステム	9,800	1,744.00	17,091,200		
TDCソフトウェアエンジニア	4,600	1,287.00	5,920,200		
ヤフー	408,100	498.00	203,233,800	貸付株式数	114,100株

ビー・エム・エル	7,700	2,274.00	17,509,800	
トレンドマイクロ	29,500	5,680.00	167,560,000	
りらいあコミュニケーション	10,500	1,230.00	12,915,000	
リソー教育	11,500	945.00	10,867,500	
日本オラクル	9,300	6,670.00	62,031,000	
フューチャー	10,200	884.00	9,016,800	
CAC HOLDINGS	5,800	1,068.00	6,194,400	
ソフトバンク・テクノ	4,000	2,177.00	8,708,000	貸付株式数 400株 (400株)
ユー・エス・エス	71,100	2,275.00	161,752,500	
オービックビジネスC	2,900	5,810.00	16,849,000	貸付株式数 100株
伊藤忠テクノソリューションズ	12,600	3,850.00	48,510,000	
アイティフォー	12,700	626.00	7,950,200	
サイバーエージェント	35,800	3,930.00	140,694,000	貸付株式数 8,700株
楽天	307,100	1,394.00	428,097,400	貸付株式数 85,100株
テー・オー・ダブリュー	5,300	843.00	4,467,900	
大塚商会	14,900	6,870.00	102,363,000	
総合メディカル	3,000	5,030.00	15,090,000	
サイボウズ	12,500	491.00	6,137,500	
ソフトブレイン	10,100	533.00	5,383,300	貸付株式数 2,400株
セントラルスポーツ	3,100	4,270.00	13,237,000	
パラカ	2,700	2,034.00	5,491,800	
電通国際情報S	3,800	2,668.00	10,138,400	
デジタルガレージ	11,300	2,039.00	23,040,700	貸付株式数 2,500株
ウェザーニューズ	1,900	3,920.00	7,448,000	
C I J	16,300	577.00	9,405,100	
WOWOW	3,000	3,335.00	10,005,000	貸付株式数 800株
フルキャストホールディングス	7,100	1,366.00	9,698,600	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
富士フイルムHLDGS	116,000	4,110.00	476,760,000	
コニカミノルタ	130,800	892.00	116,673,600	
資生堂	112,100	3,948.00	442,570,800	貸付株式数 31,300株
ライオン	73,700	2,460.00	181,302,000	貸付株式数 20,600株
高砂香料	4,100	4,185.00	17,158,500	
マンダム	6,000	6,150.00	36,900,000	
ミルボン	3,300	6,320.00	20,856,000	
ファンケル	12,900	2,219.00	28,625,100	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
コーセー	9,600	12,710.00	122,016,000	
シーズ・ホールディングス	7,900	3,755.00	29,664,500	
ポーラ・オルビスHD	24,700	3,230.00	79,781,000	
ノエビアホールディングス	3,400	5,430.00	18,462,000	
コニシ	9,800	1,576.00	15,444,800	
長谷川香料	7,500	2,276.00	17,070,000	貸付株式数 2,100株
星光PMC	5,800	1,293.00	7,499,400	貸付株式数 1,100株 (100株)
小林製薬	16,000	6,970.00	111,520,000	貸付株式数 4,300株
荒川化学工業	5,500	2,001.00	11,005,500	
メック	5,700	1,328.00	7,569,600	貸付株式数 1,500株 (1,500株)

日本高純度化学	3,800	2,336.00	8,876,800	
タカラバイオ	16,000	1,529.00	24,464,000	貸付株式数 3,600株
JCU	4,200	4,100.00	17,220,000	
新田ゼラチン	8,900	724.00	6,443,600	
デクセリアルズ	15,600	984.00	15,350,400	
アース製薬	4,400	6,120.00	26,928,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
北興化学	15,000	478.00	7,170,000	
大成ラミック	3,500	2,936.00	10,276,000	貸付株式数 900株
クミアイ化学	26,100	661.00	17,252,100	貸付株式数 7,000株 (3,700株)
日本農薬	15,000	653.00	9,795,000	貸付株式数 100株 (100株)
昭和シェル石油	52,600	1,058.00	55,650,800	
ニチレキ	9,200	1,251.00	11,509,200	貸付株式数 300株
ユシロ化学	3,700	1,501.00	5,553,700	
富士石油	15,800	345.00	5,451,000	
MORESCO	3,800	2,023.00	7,687,400	
出光興産	28,000	3,260.00	91,280,000	貸付株式数 7,800株
JXTGホールディングス	899,400	487.50	438,457,500	
コスモエネルギーHLDGS	19,200	1,625.00	31,200,000	
横浜ゴム	35,200	2,277.00	80,150,400	
東洋ゴム	32,300	2,183.00	70,510,900	貸付株式数 8,800株 (8,700株)
ブリヂストン	198,400	4,843.00	960,851,200	
住友ゴム	54,200	1,972.00	106,882,400	
藤倉ゴム	12,700	651.00	8,267,700	
オカモト	18,000	1,351.00	24,318,000	
アキレス	4,800	1,916.00	9,196,800	
ニッタ	5,000	3,400.00	17,000,000	貸付株式数 100株
住友理工	10,500	1,179.00	12,379,500	
三ツ星ベルト	10,000	1,198.00	11,980,000	
バンドー化学	7,600	1,060.00	8,056,000	
旭硝子	292,000	921.00	268,932,000	
日本板硝子	32,000	855.00	27,360,000	
有沢製作所	12,200	839.00	10,235,800	
日本山村硝子	34,000	182.00	6,188,000	
日本電気硝子	119,000	796.00	94,724,000	
住友大阪セメント	111,000	488.00	54,168,000	
太平洋セメント	359,000	366.00	131,394,000	
日本ヒューム	8,700	673.00	5,855,100	
日本コンクリート	17,400	392.00	6,820,800	貸付株式数 4,900株 (4,900株)
アジアパイルHD	11,400	669.00	7,626,600	
東海カーボン	58,600	581.00	34,046,600	
日本カーボン	36,000	305.00	10,980,000	貸付株式数 1,000株
東洋炭素	3,700	1,948.00	7,207,600	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ノリタケ	3,400	3,660.00	12,444,000	
TOTO	42,900	4,375.00	187,687,500	



日本碍子	72,400	2,298.00	166,375,200	
日本特殊陶業	50,700	2,392.00	121,274,400	貸付株式数 14,200株
MARUWA	3,300	4,160.00	13,728,000	
品川リフラクトリーズ	24,000	282.00	6,768,000	
黒崎播磨	16,000	440.00	7,040,000	
フジインコーポレーテッド	5,100	2,231.00	11,378,100	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ニチアス	32,000	1,319.00	42,208,000	
新日鐵住金	266,100	2,435.50	648,086,550	貸付株式数 37,700株
神戸製鋼所	105,600	1,039.00	109,718,400	貸付株式数 28,900株
中山製鋼所	7,500	646.00	4,845,000	
合同製鐵	3,700	1,775.00	6,567,500	
JFEホールディングス	161,800	1,877.50	303,779,500	貸付株式数 45,300株
日新製鋼	18,900	1,218.00	23,020,200	
東京製鐵	30,200	897.00	27,089,400	
共英製鋼	6,400	1,701.00	10,886,400	
大和工業	11,300	2,680.00	30,284,000	
東京鐵鋼	16,000	423.00	6,768,000	
大阪製鐵	3,000	2,140.00	6,420,000	
淀川製鋼所	7,000	3,030.00	21,210,000	
東洋鋼鈑	14,800	398.00	5,890,400	
丸一鋼管	19,400	3,340.00	64,796,000	
大同特殊鋼	98,000	622.00	60,956,000	
日本高周波	87,000	81.00	7,047,000	
日本冶金工	62,400	227.00	14,164,800	
山陽特殊製鋼	35,000	597.00	20,895,000	
愛知製鋼	3,300	4,270.00	14,091,000	
日立金属	59,700	1,474.00	87,997,800	貸付株式数 16,800株
大平洋金属	36,000	290.00	10,440,000	貸付株式数 10,000株 (8,000株)
新日本電工	46,800	402.00	18,813,600	貸付株式数 10,200株
栗本鐵工所	2,900	1,960.00	5,684,000	
日本鑄鐵管	25,000	169.00	4,225,000	
日本製鋼所	20,500	1,668.00	34,194,000	
三菱製鋼	39,000	255.00	9,945,000	
大紀アルミニウム	14,000	612.00	8,568,000	
日本輕金属HD	128,600	263.00	33,821,800	
三井金属	174,000	435.00	75,690,000	
東邦亜鉛	36,000	423.00	15,228,000	
三菱マテリアル	37,100	3,125.00	115,937,500	
住友鋁山	155,000	1,321.00	204,755,000	貸付株式数 42,000株
DOWAホールディングス	66,000	872.00	57,552,000	
古河機金	88,000	194.00	17,072,000	貸付株式数 27,000株 (27,000株)
大阪チタニウム	7,600	1,677.00	12,745,200	貸付株式数 2,000株 (1,900株)
東邦チタニウム	10,500	759.00	7,969,500	貸付株式数 2,900株
UACJ	96,000	288.00	27,648,000	
古河電工	20,100	5,230.00	105,123,000	
住友電工	221,000	1,796.50	397,026,500	

フジクラ	75,700	982.00	74,337,400	
昭和電線HLDGS	122,000	84.00	10,248,000	
タツタ電線	15,700	568.00	8,917,600	
リョービ	36,000	461.00	16,596,000	
アーレステイ	9,300	1,089.00	10,127,700	
アサヒHD	8,800	1,884.00	16,579,200	
東洋製罐グループHD	39,700	1,845.00	73,246,500	
ホッカンホールディングス	20,000	450.00	9,000,000	
横河ブリッジHLDGS	10,900	1,644.00	17,919,600	
OSJB HD	27,200	292.00	7,942,400	貸付株式数 200株
駒井ハルテック	2,800	2,297.00	6,431,600	
三和ホールディングス	58,300	1,251.00	72,933,300	
文化シヤッター	17,000	889.00	15,113,000	貸付株式数 1,900株
三協立山	7,900	1,676.00	13,240,400	貸付株式数 2,200株
アルインコ	6,500	1,074.00	6,981,000	
LIXILグループ	82,800	2,733.00	226,292,400	
ノーリツ	11,300	2,210.00	24,973,000	
長府製作所	6,300	2,832.00	17,841,600	
リンナイ	10,000	10,300.00	103,000,000	貸付株式数 1,300株
ユニプレス	10,900	2,640.00	28,776,000	
岡部	12,900	1,013.00	13,067,700	貸付株式数 700株
ジーテクト	6,200	2,100.00	13,020,000	貸付株式数 1,700株
東プレ	11,100	3,135.00	34,798,500	貸付株式数 3,000株
高周波熱錬	11,700	1,029.00	12,039,300	
東京製綱	4,500	1,736.00	7,812,000	貸付株式数 1,300株
パイオラックス	9,100	2,860.00	26,026,000	貸付株式数 900株
日本発条	54,600	1,197.00	65,356,200	貸付株式数 15,300株
三浦工業	24,100	2,289.00	55,164,900	貸付株式数 6,600株
タクマ	19,100	1,056.00	20,169,600	
テクノプロ・ホールディング	9,800	4,655.00	45,619,000	
ジャパンマテリアル	4,600	2,103.00	9,673,800	貸付株式数 1,400株 (600株)
ベクトル	6,800	1,726.00	11,736,800	
アサンテ	3,600	1,861.00	6,699,600	
N・フィールド	5,600	1,461.00	8,181,600	貸付株式数 1,000株
リクルートホールディングス	128,500	6,000.00	771,000,000	
ツガミ	17,000	806.00	13,702,000	
オークマ	38,000	1,032.00	39,216,000	
東芝機械	35,000	509.00	17,815,000	
アマダホールディングス	75,200	1,325.00	99,640,000	
アイダエンジニア	17,000	1,028.00	17,476,000	
滝澤鉄工所	54,000	174.00	9,396,000	
富士機械製造	19,000	1,720.00	32,680,000	貸付株式数 5,600株
牧野フライス	29,000	939.00	27,231,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
オーエスジー	26,200	2,311.00	60,548,200	貸付株式数 7,600株 (7,600株)
旭ダイヤモンド	17,600	818.00	14,396,800	貸付株式数 4,800株
DMG森精機	34,400	1,816.00	62,470,400	貸付株式数 9,700株
ソディック	14,300	1,211.00	17,317,300	貸付株式数 3,700株

ディスコ	6,900	19,760.00	136,344,000	
日東工器	3,700	2,553.00	9,446,100	
日本郵政	146,500	1,364.00	199,826,000	
ベルシステム24HLDGS	11,300	1,064.00	12,023,200	貸付株式数 2,600株
豊田自動織機	49,900	5,910.00	294,909,000	貸付株式数 11,600株
OKK	61,000	128.00	7,808,000	
島精機製作所	8,100	5,290.00	42,849,000	
フリー	4,200	1,293.00	5,430,600	
日阪製作所	6,500	953.00	6,194,500	
やまびこ	11,600	1,276.00	14,801,600	
ペガサスミシン製造	8,600	727.00	6,252,200	
ナブテスコ	30,400	3,370.00	102,448,000	
三井海洋開発	7,000	2,530.00	17,710,000	
レオン自動機	6,600	972.00	6,415,200	
SMC	17,700	36,580.00	647,466,000	貸付株式数 3,500株
新川	7,100	678.00	4,813,800	貸付株式数 1,800株
ホソカワミクロン	2,600	4,865.00	12,649,000	
ユニオンツール	2,700	3,410.00	9,207,000	貸付株式数 800株 (800株)
オイレス工業	6,900	1,938.00	13,372,200	
サトーホールディングス	8,200	2,599.00	21,311,800	貸付株式数 2,100株
日精樹脂工業	6,200	1,099.00	6,813,800	
小松製作所	272,700	2,737.50	746,516,250	
住友重機械	169,000	727.00	122,863,000	
日立建機	26,200	2,649.00	69,403,800	
巴工業	4,900	1,828.00	8,957,200	
井関農機	62,000	231.00	14,322,000	
TOWA	5,600	1,676.00	9,385,600	貸付株式数 1,400株
丸山製作所	4,300	1,783.00	7,666,900	
北川鉄工所	3,500	2,329.00	8,151,500	
シンニッタン	5,300	697.00	3,694,100	
ローツェ	2,700	2,834.00	7,651,800	貸付株式数 600株
クボタ	279,100	1,856.00	518,009,600	貸付株式数 78,700株
東洋エンジニア	37,000	258.00	9,546,000	貸付株式数 10,000株
三菱化工機	21,000	249.00	5,229,000	
月島機械	9,700	1,253.00	12,154,100	
帝国電機製作所	6,700	1,165.00	7,805,500	
新東工業	14,300	1,162.00	16,616,600	
渋谷工業	5,400	3,505.00	18,927,000	
アイチ コーポレーション	9,200	784.00	7,212,800	
小森コーポレーション	13,400	1,475.00	19,765,000	
鶴見製作所	4,400	1,746.00	7,682,400	
住友精密	12,000	348.00	4,176,000	
荏原製作所	27,200	3,160.00	85,952,000	
西島製作所	7,500	1,088.00	8,160,000	
北越工業	10,000	928.00	9,280,000	
千代田化工建	46,000	644.00	29,624,000	貸付株式数 5,000株
ダイキン工業	76,800	11,040.00	847,872,000	
オルガノ	16,000	552.00	8,832,000	
トーヨーカネツ	32,000	308.00	9,856,000	

栗田工業	32,700	3,070.00	100,389,000	貸付株式数	6,500株
椿本チエイン	31,000	969.00	30,039,000		
日機装	20,000	1,081.00	21,620,000	貸付株式数	5,500株
新興プランテック	14,000	836.00	11,704,000		
アネスト岩田	11,100	1,029.00	11,421,900		
ダイフク	28,300	3,550.00	100,465,000		
加藤製作所	3,600	3,185.00	11,466,000		
油研工業	38,000	232.00	8,816,000		
タダノ	29,500	1,373.00	40,503,500	貸付株式数	8,100株
フジテック	15,800	1,298.00	20,508,400	貸付株式数	4,600株
CKD	17,300	1,740.00	30,102,000		
キトー	8,200	1,166.00	9,561,200		
平和	17,200	2,469.00	42,466,800		
理想科学工業	5,000	2,234.00	11,170,000		
SANKYO	14,200	3,810.00	54,102,000	貸付株式数	3,900株
日本金銭機械	6,500	1,173.00	7,624,500	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	3,400	2,403.00	8,170,200		
福島工業	3,800	4,340.00	16,492,000		
ダイコク電機	3,300	1,701.00	5,613,300		
竹内製作所	10,500	1,868.00	19,614,000		
アマノ	17,400	2,505.00	43,587,000		
JUKI	9,900	1,432.00	14,176,800		
サンデンホールディングス	41,000	305.00	12,505,000	貸付株式数	10,000株
蛇の目マシン	7,300	925.00	6,752,500		
ブラザー工業	72,700	2,620.00	190,474,000		
マックス	9,000	1,628.00	14,652,000		
モリタホールディングス	10,800	1,758.00	18,986,400		
グローリー	17,700	3,765.00	66,640,500		
新晃工業	4,700	1,872.00	8,798,400		
大和冷機工業	9,600	1,266.00	12,153,600		
セガサミーホールディングス	56,000	1,421.00	79,576,000	貸付株式数	15,700株
日本ピストンリング	4,000	2,278.00	9,112,000		
リケン	2,800	4,930.00	13,804,000		
TPR	5,800	3,790.00	21,982,000	貸付株式数	900株
ツバキ・ナカシマ	6,600	2,057.00	13,576,200	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ホシザキ	16,400	9,950.00	163,180,000	貸付株式数	3,400株
大豊工業	5,000	1,410.00	7,050,000		
日本精工	114,700	1,392.00	159,662,400	貸付株式数	33,100株 (33,100株)
N T N	133,000	525.00	69,825,000	貸付株式数	27,000株
ジェイテクト	58,000	1,696.00	98,368,000		
不二越	56,000	591.00	33,096,000		
ミネベアミツミ	105,700	1,921.00	203,049,700	貸付株式数	28,700株
日本トムソン	19,600	622.00	12,191,200		
T H K	39,400	3,295.00	129,823,000		
ユーシン精機	3,300	2,849.00	9,401,700	貸付株式数	800株 (800株)
イーグル工業	6,200	1,808.00	11,209,600		

日本ピラー工業	7,100	1,682.00	11,942,200	
キット	27,800	939.00	26,104,200	貸付株式数 1,200株
日立	1,369,000	687.00	940,503,000	
三菱電機	601,500	1,616.00	972,024,000	
富士電機	177,000	604.00	106,908,000	
東洋電機製造	4,700	1,628.00	7,651,600	貸付株式数 1,000株
安川電機	65,000	2,410.00	156,650,000	貸付株式数 4,200株
シンフォニアテクノロジー	44,000	374.00	16,456,000	
明電舎	64,000	382.00	24,448,000	貸付株式数 16,000株
山洋電気	16,000	1,058.00	16,928,000	
デンヨー	5,700	1,882.00	10,727,400	
三桜工業	10,200	796.00	8,119,200	
マキタ	73,100	4,260.00	311,406,000	
東芝テック	38,000	623.00	23,674,000	
芝浦メカトロニクス	22,000	346.00	7,612,000	
マブチモーター	15,800	6,240.00	98,592,000	
日本電産	73,300	11,785.00	863,840,500	貸付株式数 12,000株
東光高岳	4,500	1,659.00	7,465,500	貸付株式数 900株
ダブル・スコープ	6,700	1,780.00	11,926,000	貸付株式数 1,600株 (100株)
ダイヘン	31,000	874.00	27,094,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
田淵電機	20,600	300.00	6,180,000	貸付株式数 5,100株
JVCケンウッド	54,700	296.00	16,191,200	貸付株式数 12,100株
日新電機	12,600	1,312.00	16,531,200	
大崎電気	13,000	866.00	11,258,000	
オムロン	59,600	4,755.00	283,398,000	貸付株式数 7,300株
日東工業	7,500	1,837.00	13,777,500	
IDEC	12,600	1,546.00	19,479,600	
ジーエス・ユアサコーポ	107,000	512.00	54,784,000	貸付株式数 9,000株
サクサホールディングス	30,000	202.00	6,060,000	
メルコホールディングス	4,300	3,355.00	14,426,500	貸付株式数 1,000株
日本電気	806,000	290.00	233,740,000	
富士通	550,000	821.50	451,825,000	
沖電気	27,300	1,645.00	44,908,500	
電気興業	22,000	560.00	12,320,000	
サンケン電気	38,000	471.00	17,898,000	貸付株式数 10,000株
アイホン	4,100	1,828.00	7,494,800	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ルネサスエレクトロニクス	34,600	939.00	32,489,400	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
セイコーエプソン	83,200	2,403.00	199,929,600	
ワコム	60,200	353.00	21,250,600	貸付株式数 15,100株 (15,100株)
アルバック	9,900	6,290.00	62,271,000	
アクセル	4,700	792.00	3,722,400	
EIZO	6,800	4,350.00	29,580,000	
ジャパンディスプレイ	122,700	197.00	24,171,900	貸付株式数 31,700株 (31,700株)
日本信号	16,500	1,068.00	17,622,000	

京三製作所	21,000	535.00	11,235,000	
能美防災	7,300	1,538.00	11,227,400	
ホーチキ	5,800	1,624.00	9,419,200	
エレコム	6,100	2,407.00	14,682,700	
日本無線	5,400	1,368.00	7,387,200	
パナソニック	647,800	1,470.50	952,589,900	貸付株式数 99,400 株
アンリツ	43,900	994.00	43,636,600	
富士通ゼネラル	21,000	2,543.00	53,403,000	貸付株式数 2,000 株
日立国際電気	15,100	2,660.00	40,166,000	貸付株式数 4,300 株 (4,300 株)
ソニー	398,000	4,174.00	1,661,252,000	
T D K	32,100	7,000.00	224,700,000	
帝国通信工業	51,000	211.00	10,761,000	
タムラ製作所	24,000	533.00	12,792,000	
アルプス電気	52,500	3,225.00	169,312,500	貸付株式数 14,600 株
パイオニア	101,200	201.00	20,341,200	貸付株式数 25,900 株
日本電波工業	10,800	855.00	9,234,000	
日本トリム	1,800	4,275.00	7,695,000	貸付株式数 400 株 (200 株)
ローランド ディー. ジー.	4,100	2,680.00	10,988,000	
フオスター電機	7,600	1,695.00	12,882,000	貸付株式数 2,000 株
クラリオン	33,000	412.00	13,596,000	
S M K	18,000	387.00	6,966,000	
ヨコオ	6,800	1,432.00	9,737,600	貸付株式数 1,400 株
ホシデン	19,700	1,334.00	26,279,800	
ヒロセ電機	9,000	15,280.00	137,520,000	
日本航空電子	19,000	1,511.00	28,709,000	
T O A	7,900	1,039.00	8,208,100	
日立マクセル	8,900	2,245.00	19,980,500	
古野電気	12,400	697.00	8,642,800	
ユニデンホールディングス	67,000	246.00	16,482,000	
アルパイン	14,700	1,621.00	23,828,700	
スミダコーポレーション	7,100	1,723.00	12,233,300	貸付株式数 1,600 株
アイコム	5,400	2,693.00	14,542,200	貸付株式数 1,000 株 (1,000 株)
リオン	3,400	1,660.00	5,644,000	
船井電機	6,700	894.00	5,989,800	貸付株式数 1,800 株 (1,700 株)
横河電機	60,500	1,946.00	117,733,000	
新電元工業	24,000	554.00	13,296,000	
アズビル	16,500	4,195.00	69,217,500	
日本光電工業	23,000	2,457.00	56,511,000	貸付株式数 6,800 株
共和電業	15,400	448.00	6,899,200	
堀場製作所	11,100	7,240.00	80,364,000	貸付株式数 200 株
アドバンテスト	38,600	2,058.00	79,438,800	貸付株式数 10,800 株
エスベック	5,500	1,658.00	9,119,000	
キーエンス	25,500	51,790.00	1,320,645,000	
日置電機	3,500	2,262.00	7,917,000	
シスメックス	43,500	6,770.00	294,495,000	貸付株式数 12,100 株
日本マイクロニクス	13,500	1,182.00	15,957,000	貸付株式数 3,100 株

メガチップス	6,100	2,691.00	16,415,100	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,400	6,050.00	20,570,000		
デンソー	137,200	4,831.00	662,813,200	貸付株式数	4,300株
コーセル	8,700	1,436.00	12,493,200		
イリソ電子工業	2,800	8,800.00	24,640,000		
オブテックスグループ	5,300	3,860.00	20,458,000	貸付株式数	1,200株
千代田インテグレ	3,400	2,289.00	7,782,600		
レーザーテック	12,800	1,689.00	21,619,200		
スタンレー電気	39,800	3,420.00	136,116,000	貸付株式数	11,100株
岩崎電気	48,000	175.00	8,400,000		
ウシオ電機	34,100	1,460.00	49,786,000		
日本セラミック	5,300	2,686.00	14,235,800	貸付株式数	1,300株 (1,000株)
遠藤照明	10,700	1,133.00	12,123,100		
古河電池	13,000	788.00	10,244,000		
山一電機	6,500	1,922.00	12,493,000	貸付株式数	1,600株
函研	5,900	1,637.00	9,658,300	貸付株式数	1,400株
日本電子	25,000	597.00	14,925,000		
カシオ	46,000	1,736.00	79,856,000		
ファナック	56,700	22,345.00	1,266,961,500		
日本シイエムケイ	15,800	871.00	13,761,800	貸付株式数	3,600株 (3,600株)
エンプラス	2,500	3,320.00	8,300,000		
ローム	27,200	9,120.00	248,064,000		
浜松ホトニクス	41,400	3,595.00	148,833,000	貸付株式数	12,500株
三井ハイテック	8,800	1,324.00	11,651,200	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
新光電気工業	21,500	914.00	19,651,000		
京セラ	92,400	6,572.00	607,252,800		
太陽誘電	30,500	1,598.00	48,739,000	貸付株式数	7,800株
村田製作所	59,000	16,010.00	944,590,000		
ユーシン	17,300	733.00	12,680,900	貸付株式数	3,500株 (3,500株)
双葉電子工業	8,800	1,983.00	17,450,400		
日東電工	42,400	8,954.00	379,649,600		
北陸電気工業	57,000	138.00	7,866,000		
東海理化電機	14,200	2,087.00	29,635,400	貸付株式数	2,900株
ニチコン	17,500	1,123.00	19,652,500		
日本ケミコン	65,000	390.00	25,350,000		
K O A	8,500	2,032.00	17,272,000		
三井造船	197,000	155.00	30,535,000	貸付株式数	55,000株
日立造船	42,000	531.00	22,302,000		
三菱重工業	954,000	442.60	422,240,400		
川崎重工業	441,000	327.00	144,207,000	貸付株式数	122,000株
I H I	446,000	421.00	187,766,000	貸付株式数	124,000株 (124,000株)
名村造船所	17,300	628.00	10,864,400		
日本車輛	34,000	291.00	9,894,000	貸付株式数	8,000株 (8,000株)

F P G	20,700	1,007.00	20,844,900	貸付株式数	5,300株
じもとホールディングス	48,600	205.00	9,963,000		
全国保証	16,300	4,720.00	76,936,000	貸付株式数	4,400株
めぶきフィナンシャルG	264,200	440.00	116,248,000		
東京TYフィナンシャルG	8,100	3,045.00	24,664,500		
九州フィナンシャルG	90,500	708.00	64,074,000		
かんぽ生命保険	20,500	2,427.00	49,753,500	貸付株式数	6,100株
ゆうちょ銀行	153,000	1,398.00	213,894,000		
富山第一銀行	15,800	516.00	8,152,800		
コンコルディア・フィナンシャル	359,900	530.00	190,747,000		
西日本フィナンシャルHD	36,800	1,106.00	40,700,800		
日産自動車	664,200	1,080.00	717,336,000		
いすゞ自動車	163,100	1,377.50	224,670,250		
トヨタ自動車 ※	681,800	5,968.00	4,068,982,400		
日野自動車	80,600	1,315.00	105,989,000	貸付株式数	22,500株
三菱自動車工業	215,700	739.00	159,402,300	貸付株式数	58,900株
エフテック	6,500	1,373.00	8,924,500		
武蔵精密工業	6,900	3,005.00	20,734,500	貸付株式数	1,800株
日産車体	24,100	1,116.00	26,895,600	貸付株式数	6,600株
新明和工業	23,000	899.00	20,677,000		
極東開発工業	11,600	1,852.00	21,483,200		
日信工業	12,100	1,801.00	21,792,100	貸付株式数	3,600株 (3,600株)
トピー工業	4,700	3,260.00	15,322,000		
ティラド	27,000	346.00	9,342,000		
曙ブレーキ	38,100	353.00	13,449,300		
タチエス	9,900	2,004.00	19,839,600		
N O K	26,700	2,447.00	65,334,900		
フタバ産業	21,700	935.00	20,289,500		
K Y B	63,000	561.00	35,343,000		
市光工業	17,000	714.00	12,138,000	貸付株式数	4,000株 (4,000株)
大同メタル工業	7,700	976.00	7,515,200		
プレス工業	30,400	513.00	15,595,200		
太平洋工業	11,900	1,486.00	17,683,400	貸付株式数	800株
ケーヒン	12,500	1,574.00	19,675,000		
河西工業	8,100	1,417.00	11,477,700		
アイシン精機	51,400	5,590.00	287,326,000		
マ ツ ダ	179,800	1,517.00	272,756,600		
今仙電機製作所	8,300	1,237.00	10,267,100	貸付株式数	1,900株
本田技研	504,800	3,117.00	1,573,461,600		
スズキ	112,000	5,487.00	614,544,000		
S U B A R U	172,800	3,802.00	656,985,600		
ヤマハ発動機	78,900	2,939.00	231,887,100	貸付株式数	22,200株
ショーワ	21,900	1,094.00	23,958,600	貸付株式数	1,300株
小糸製作所	33,100	5,930.00	196,283,000	貸付株式数	9,200株
T B K	17,000	517.00	8,789,000		
エクセディ	7,400	3,165.00	23,421,000	貸付株式数	1,900株
ミツバ	10,700	1,993.00	21,325,100	貸付株式数	700株



豊田合成	17,000	2,767.00	47,039,000	貸付株式数	4,800株
愛三工業	9,800	902.00	8,839,600		
ヨロズ	5,600	1,723.00	9,648,800		
エフ・シー・シー	9,400	2,205.00	20,727,000		
シマノ	22,500	17,420.00	391,950,000	貸付株式数	4,500株
テイ・エス テック	12,800	3,220.00	41,216,000		
ジャムコ	3,600	2,710.00	9,756,000	貸付株式数	1,100株 (900株)
小野建	5,500	1,675.00	9,212,500		
ノジマ	8,700	1,763.00	15,338,100		
佐島電機	7,000	797.00	5,579,000		
カップ・クリエイト	8,400	1,285.00	10,794,000	貸付株式数	2,600株 (2,600株)
伯東	6,800	1,381.00	9,390,800		
コンドーテック	7,900	926.00	7,315,400		
ライトオン	5,000	1,029.00	5,145,000	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,100	2,584.00	20,930,400	貸付株式数	1,000株
三菱食品	5,800	3,430.00	19,894,000		
良品計画	7,400	30,500.00	225,700,000	貸付株式数	2,000株
松田産業	4,800	1,513.00	7,262,400		
第一興商	9,000	5,390.00	48,510,000		
メディパルHD	54,800	2,090.00	114,532,000		
アドヴァン	4,900	1,162.00	5,693,800		
萩原電気	3,300	2,291.00	7,560,300		
アルビス	2,100	4,790.00	10,059,000		
アズワン	4,400	5,410.00	23,804,000		
シモジマ	6,200	1,157.00	7,173,400		
ドウシシャ	7,000	2,110.00	14,770,000		
小津産業	2,600	2,204.00	5,730,400		
コナカ	12,300	606.00	7,453,800		
コーナン商事	7,700	2,182.00	16,801,400		
黒田電気	7,400	2,176.00	16,102,400		
ネットワンシステムズ	30,000	1,100.00	33,000,000		
ワタミ	8,000	1,387.00	11,096,000	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	35,800	4,435.00	158,773,000	貸付株式数	10,000株
丸文	1,700	756.00	1,285,200		
西松屋チェーン	10,100	1,188.00	11,998,800		
ゼンショーホールディングス	29,400	2,100.00	61,740,000		
ハピネット	5,800	2,176.00	12,620,800		
幸楽苑ホールディングス	6,000	1,924.00	11,544,000	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
日本ライフライン	6,700	3,995.00	26,766,500	貸付株式数	1,300株
サイゼリヤ	9,000	3,295.00	29,655,000		
エクセル	3,400	1,448.00	4,923,200		
VTホールディングス	20,500	567.00	11,623,500	貸付株式数	5,600株
マルカキカイ	3,500	1,895.00	6,632,500		
アルゴグラフィックス	6,100	2,667.00	16,268,700		
IDOM	18,900	626.00	11,831,400	貸付株式数	4,600株

ポプラ	15,300	574.00	8,782,200	
ユナイテッドアローズ	8,100	3,525.00	28,552,500	
進和	3,100	1,998.00	6,193,800	
ハイデイ日高	6,300	2,414.00	15,208,200	
シークス	4,100	4,585.00	18,798,500	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
京都きもの友禅	10,700	926.00	9,908,200	
コロワイド	18,100	1,908.00	34,534,800	貸付株式数 5,100株
壺番屋	3,300	3,805.00	12,556,500	貸付株式数 900株
スギホールディングス	12,000	6,160.00	73,920,000	貸付株式数 3,300株
島津製作所	72,100	2,252.00	162,369,200	
J M S	23,000	318.00	7,314,000	
ブイ・テクノロジー	1,200	22,830.00	27,396,000	貸付株式数 300株
スター精密	9,700	1,648.00	15,985,600	貸付株式数 2,700株
東京計器	32,000	284.00	9,088,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
東京精密	10,800	3,975.00	42,930,000	貸付株式数 2,900株
マニー	7,200	3,120.00	22,464,000	
ニコン	100,200	1,761.00	176,452,200	貸付株式数 28,000株
トプコン	29,300	2,044.00	59,889,200	貸付株式数 8,000株
オリンパス	90,500	4,160.00	376,480,000	貸付株式数 25,300株 (25,300株)
理研計器	5,600	1,999.00	11,194,400	
SCREENホールディングス	11,600	8,400.00	97,440,000	
キヤノン電子	4,300	2,160.00	9,288,000	
タムロン	5,000	2,015.00	10,075,000	
HOYA	115,100	5,685.00	654,343,500	
ノーリツ鋼機	7,200	906.00	6,523,200	
エー・アンド・デイ	12,600	456.00	5,745,600	
キヤノン	303,100	3,943.00	1,195,123,300	貸付株式数 31,500株
リコー	169,000	975.00	164,775,000	貸付株式数 48,400株
シチズン時計	59,100	755.00	44,620,500	
リズム時計	39,000	227.00	8,853,000	
大研医器	6,700	776.00	5,199,200	貸付株式数 1,400株
メニコン	4,100	3,590.00	14,719,000	
パラマウントベッドHD	5,400	4,885.00	26,379,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ニホンフラッシュ	3,800	1,474.00	5,601,200	貸付株式数 800株
前田工織	6,900	1,572.00	10,846,800	
永大産業	13,000	511.00	6,643,000	
アートネイチャー	8,200	735.00	6,027,000	
ダンロップスポーツ	4,400	1,089.00	4,791,600	
バンダイナムコHLDGS	61,900	4,065.00	251,623,500	
共立印刷	27,100	339.00	9,186,900	
SHOE I	3,100	2,758.00	8,549,800	貸付株式数 800株
フランスベッドHLDGS	7,200	978.00	7,041,600	
マーベラス	10,400	1,193.00	12,407,200	貸付株式数 3,000株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	9,200	4,510.00	41,492,000	

萩原工業	2,500	2,725.00	6,812,500	
エイベックス・グループHD	10,300	1,450.00	14,935,000	
トッパン・フォームズ	9,100	1,208.00	10,992,800	
フジシールインターナショナル	12,700	2,942.00	37,363,400	
タカラトミー	24,300	1,449.00	35,210,700	
レック	4,800	3,110.00	14,928,000	貸付株式数 1,100株
大建工業	4,400	2,382.00	10,480,800	
きもと	26,200	250.00	6,550,000	
凸版印刷	151,000	1,257.00	189,807,000	
大日本印刷	155,000	1,257.00	194,835,000	
共同印刷	21,000	391.00	8,211,000	
日本写真印刷	10,500	3,030.00	31,815,000	貸付株式数 2,800株 (2,700株)
光村印刷	30,000	261.00	7,830,000	
藤森工業	4,500	3,445.00	15,502,500	
宝印刷	3,700	1,681.00	6,219,700	
前澤化成工業	8,500	1,229.00	10,446,500	
アシックス	55,300	1,964.00	108,609,200	貸付株式数 15,500株
ツツミ	1,900	2,152.00	4,088,800	
ジェイエスピー	2,700	2,753.00	7,433,100	
ニチハ	8,100	4,175.00	33,817,500	
エフピコ	5,400	6,040.00	32,616,000	貸付株式数 1,500株
ヤマハ	38,300	3,655.00	139,986,500	
河合楽器	2,900	2,378.00	6,896,200	
クリナップ	7,800	842.00	6,567,600	
ピジョン	34,100	3,970.00	135,377,000	貸付株式数 9,500株
天馬	1,800	2,084.00	3,751,200	
キングジム	7,800	918.00	7,160,400	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
リンテック	12,300	2,688.00	33,062,400	
信越ポリマー	12,700	824.00	10,464,800	貸付株式数 3,100株
東リ	21,300	360.00	7,668,000	
イトーキ	12,600	762.00	9,601,200	
任天堂	34,700	34,570.00	1,199,579,000	
三菱鉛筆	4,700	6,580.00	30,926,000	貸付株式数 1,100株
松風	3,600	1,331.00	4,791,600	
タカラスタンダード	10,500	1,893.00	19,876,500	
コクヨ	29,200	1,511.00	44,121,200	
ナカバヤシ	20,000	288.00	5,760,000	
ニフコ	10,200	5,840.00	59,568,000	貸付株式数 2,800株
グローブライド	3,400	1,968.00	6,691,200	
岡村製作所	18,900	1,042.00	19,693,800	貸付株式数 4,600株
日本バルカー	5,700	2,211.00	12,602,700	
伊藤忠	410,600	1,596.50	655,522,900	
丸紅	546,000	684.50	373,737,000	
スクロール	12,000	381.00	4,572,000	
高島	33,000	212.00	6,996,000	
ヨンドシーホールディングス	5,100	2,689.00	13,713,900	貸付株式数 1,200株
三陽商会	56,000	161.00	9,016,000	

長瀬産業	28,400	1,620.00	46,008,000	
蝶理	3,800	2,018.00	7,668,400	
豊田通商	61,100	3,435.00	209,878,500	
オンワードホールディングス	37,000	816.00	30,192,000	貸付株式数 1,000株
兼松	116,000	223.00	25,868,000	
美津濃	30,000	630.00	18,900,000	
ユニー・ファミリーマートHD	24,500	6,210.00	152,145,000	
三井物産	501,400	1,514.50	759,370,300	
日本紙パルプ	28,000	413.00	11,564,000	
東京エレクトロン	37,400	16,755.00	626,637,000	
日立ハイテクノロジーズ	19,300	4,485.00	86,560,500	
カメイ	6,100	1,384.00	8,442,400	
OUGホールディングス	28,000	264.00	7,392,000	
スターゼン	2,400	4,665.00	11,196,000	
セイコーHD	41,000	465.00	19,065,000	
山善	17,700	1,126.00	19,930,200	
住友商事	354,700	1,460.50	518,039,350	
日本ユニシス	17,100	1,916.00	32,763,600	
内田洋行	2,600	2,604.00	6,770,400	
三菱商事	420,000	2,235.50	938,910,000	
第一実業	15,000	610.00	9,150,000	
キヤノンマーケティングJPN	15,600	2,392.00	37,315,200	
西華産業	23,000	376.00	8,648,000	
菱洋エレクトロ	4,300	1,833.00	7,881,900	貸付株式数 1,500株
ユアサ商事	4,000	3,415.00	13,660,000	
神鋼商事	1,800	2,531.00	4,555,800	
阪和興業	55,000	783.00	43,065,000	
カナデン	6,500	1,119.00	7,273,500	
菱電商事	8,000	801.00	6,408,000	
ニプロ	38,300	1,548.00	59,288,400	貸付株式数 10,700株
岩谷産業	59,000	728.00	42,952,000	
すてきなイスグループ	45,000	148.00	6,660,000	
兼松エレクトロニクス	3,800	3,440.00	13,072,000	
三愛石油	13,700	1,067.00	14,617,900	
稲畑産業	8,500	1,397.00	11,874,500	
ゴールドウイン	2,600	6,680.00	17,368,000	貸付株式数 700株 (700株)
ユニ・チャーム	119,600	3,073.00	367,530,800	貸付株式数 12,800株
デサント	12,600	1,404.00	17,690,400	貸付株式数 3,500株
ワキタ	12,200	1,246.00	15,201,200	
東邦ホールディングス	17,300	2,301.00	39,807,300	貸付株式数 4,800株
サンゲツ	15,300	2,045.00	31,288,500	
ミツウロコグループ	7,800	725.00	5,655,000	
シナネンホールディングス	1,600	2,250.00	3,600,000	
伊藤忠エネクス	9,400	943.00	8,864,200	
サンリオ	16,700	2,130.00	35,571,000	
リョーサン	7,700	4,180.00	32,186,000	貸付株式数 2,000株
新光商事	5,000	1,358.00	6,790,000	
トーヨー	3,100	3,035.00	9,408,500	

三信電気	6,300	1,442.00	9,084,600	
東陽テクニカ	8,300	1,076.00	8,930,800	
モスフード サービス	7,000	3,470.00	24,290,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
加賀電子	5,400	2,144.00	11,577,600	
三益半導体	4,700	1,888.00	8,873,600	
木曽路	7,000	2,649.00	18,543,000	貸付株式数 2,400株
サトレストランシステムズ	13,200	901.00	11,893,200	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
千趣会	9,600	826.00	7,929,600	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
ケーヨー	13,300	729.00	9,695,700	
上新電機	13,000	1,505.00	19,565,000	
日本瓦斯	10,300	3,880.00	39,964,000	貸付株式数 2,800株
ロイヤルホールディングス	8,800	2,450.00	21,560,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
いなげや	6,400	1,962.00	12,556,800	
島忠	13,500	2,672.00	36,072,000	貸付株式数 3,800株
チョダ	6,100	2,908.00	17,738,800	貸付株式数 1,700株
ライフコーポレーション	4,200	3,155.00	13,251,000	
リンガーハット	6,900	2,441.00	16,842,900	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
AOKIホールディングス	9,800	1,488.00	14,582,400	貸付株式数 2,700株
オークワ	8,000	1,225.00	9,800,000	
コメリ	8,500	2,904.00	24,684,000	貸付株式数 2,300株
青山商事	10,700	4,020.00	43,014,000	貸付株式数 2,900株
しまむら	6,500	14,310.00	93,015,000	
高島屋	92,000	1,103.00	101,476,000	
松屋	11,100	982.00	10,900,200	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
エイチ・ツー・オーリテイリング	25,800	1,981.00	51,109,800	
近鉄百貨店	23,000	361.00	8,303,000	
丸井グループ	58,500	1,697.00	99,274,500	貸付株式数 16,200株
クレディセゾン	41,400	2,116.00	87,602,400	貸付株式数 4,300株
アクシアルリテイリング	3,800	4,420.00	16,796,000	
イオン	226,900	1,709.50	387,885,550	貸付株式数 66,200株
イズミ	11,100	6,370.00	70,707,000	
平和堂	11,100	2,465.00	27,361,500	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
フジ	6,300	2,880.00	18,144,000	
ヤオコー	6,100	4,850.00	29,585,000	
ゼビオホールディングス	6,100	1,842.00	11,236,200	
ケーズホールディングス	24,700	2,311.00	57,081,700	貸付株式数 6,600株 (3,000株)
PALTAC	9,100	4,080.00	37,128,000	
新生銀行	535,000	190.00	101,650,000	
あおぞら銀行	348,000	422.00	146,856,000	
三菱UFJフィナンシャルG	4,201,200	711.50	2,989,153,800	
りそなホールディングス	648,500	583.90	378,659,150	

三井住友トラストHD	115,100	3,802.00	437,610,200	
三井住友フィナンシャルG	444,000	4,121.00	1,829,724,000	
第四銀行	66,000	492.00	32,472,000	
北越銀行	6,000	2,729.00	16,374,000	
千葉銀行	212,000	767.00	162,604,000	貸付株式数 59,000 株
群馬銀行	120,400	615.00	74,046,000	
武蔵野銀行	8,400	3,420.00	28,728,000	
千葉興業銀行	18,400	586.00	10,782,400	
筑波銀行	28,600	326.00	9,323,600	
七十七銀行	83,000	503.00	41,749,000	
青森銀行	44,000	394.00	17,336,000	貸付株式数 12,000 株 (12,000 株)
秋田銀行	27,000	333.00	8,991,000	
山形銀行	30,000	495.00	14,850,000	貸付株式数 8,000 株
岩手銀行	3,400	4,420.00	15,028,000	貸付株式数 600 株
東邦銀行	48,000	396.00	19,008,000	貸付株式数 6,000 株
東北銀行	64,000	150.00	9,600,000	
みちのく銀行	58,000	184.00	10,672,000	貸付株式数 9,000 株
ふくおかフィナンシャルG	222,000	522.00	115,884,000	
静岡銀行	146,000	940.00	137,240,000	貸付株式数 11,000 株
十六銀行	62,000	336.00	20,832,000	
スルガ銀行	56,900	2,512.00	142,932,800	貸付株式数 15,800 株
八十二銀行	103,100	659.00	67,942,900	貸付株式数 28,600 株
山梨中央銀行	32,000	455.00	14,560,000	貸付株式数 4,000 株
大垣共立銀行	85,000	318.00	27,030,000	
福井銀行	50,000	279.00	13,950,000	貸付株式数 14,000 株 (14,000 株)
北國銀行	56,000	406.00	22,736,000	
清水銀行	2,400	3,560.00	8,544,000	
滋賀銀行	49,000	571.00	27,979,000	貸付株式数 6,000 株
南都銀行	5,300	3,205.00	16,986,500	貸付株式数 1,400 株 (1,400 株)
百五銀行	47,000	460.00	21,620,000	
京都銀行	98,000	967.00	94,766,000	
紀陽銀行	19,500	1,884.00	36,738,000	貸付株式数 5,300 株
三重銀行	3,300	2,330.00	7,689,000	
ほくほくフィナンシャルG	35,700	1,655.00	59,083,500	
広島銀行	160,000	467.00	74,720,000	
山陰合同銀行	31,100	864.00	26,870,400	
中国銀行	38,100	1,603.00	61,074,300	貸付株式数 10,600 株
鳥取銀行	4,200	1,676.00	7,039,200	
伊予銀行	73,600	823.00	60,572,800	貸付株式数 15,700 株
百十四銀行	59,000	362.00	21,358,000	
四国銀行	43,000	318.00	13,674,000	貸付株式数 1,000 株
阿波銀行	45,000	777.00	34,965,000	貸付株式数 12,000 株
大分銀行	33,000	435.00	14,355,000	
宮崎銀行	38,000	375.00	14,250,000	
佐賀銀行	30,000	280.00	8,400,000	
十八銀行	27,000	315.00	8,505,000	
沖縄銀行	4,900	4,360.00	21,364,000	貸付株式数 900 株

琉球銀行	11,800	1,523.00	17,971,400	
セブン銀行	221,000	424.00	93,704,000	貸付株式数 59,500株
みずほフィナンシャルG	7,595,100	197.00	1,496,234,700	
高知銀行	68,000	128.00	8,704,000	
山口フィナンシャルG	49,000	1,317.00	64,533,000	貸付株式数 13,000株
芙蓉総合リース	6,300	5,980.00	37,674,000	
興銀リース	10,500	2,538.00	26,649,000	
東京センチュリー	10,800	4,310.00	46,548,000	
SBIホールディングス	61,500	1,486.00	91,389,000	貸付株式数 13,300株
日本証券金融	15,300	574.00	8,782,200	貸付株式数 4,200株
アイフル	108,200	337.00	36,463,400	貸付株式数 27,400株 (300株)
長野銀行	3,200	1,959.00	6,268,800	貸付株式数 800株
名古屋銀行	2,800	4,145.00	11,606,000	貸付株式数 1,200株
北洋銀行	86,100	391.00	33,665,100	
愛知銀行	1,900	6,480.00	12,312,000	
第三銀行	4,200	1,710.00	7,182,000	
中京銀行	2,700	2,326.00	6,280,200	
大光銀行	30,000	233.00	6,990,000	
愛媛銀行	6,400	1,423.00	9,107,200	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
トマト銀行	5,000	1,541.00	7,705,000	
みなと銀行	5,100	2,053.00	10,470,300	
京葉銀行	37,000	470.00	17,390,000	貸付株式数 10,000株
関西アーバン銀行	8,300	1,306.00	10,839,800	
栃木銀行	29,100	490.00	14,259,000	貸付株式数 800株
北日本銀行	2,400	3,110.00	7,464,000	
東和銀行	116,000	125.00	14,500,000	
福島銀行	92,000	89.00	8,188,000	
大東銀行	45,000	165.00	7,425,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
リコーリース	4,500	3,475.00	15,637,500	貸付株式数 1,300株
イオンフィナンシャルサービス	37,000	2,328.00	86,136,000	貸付株式数 10,100株 (10,100株)
アコム	117,500	481.00	56,517,500	貸付株式数 32,400株
ジャックス	32,000	490.00	15,680,000	
オリコ	127,800	192.00	24,537,600	貸付株式数 35,000株
日立キャピタル	13,100	2,718.00	35,605,800	
オリックス	393,000	1,793.50	704,845,500	
三菱UFJリース	141,200	585.00	82,602,000	
ジャフコ	9,300	4,460.00	41,478,000	
トモニホールディングス	35,900	561.00	20,139,900	
大和証券G本社	498,000	677.90	337,594,200	
野村ホールディングス	1,143,300	685.00	783,160,500	
岡三証券グループ	38,000	699.00	26,562,000	貸付株式数 10,000株
丸三証券	17,300	907.00	15,691,100	貸付株式数 4,600株 (100株)
東洋証券	29,000	251.00	7,279,000	
東海東京HD	61,100	601.00	36,721,100	

光世証券	28,000	172.00	4,816,000	貸付株式数	8,000株 (8,000株)
水戸証券	26,700	322.00	8,597,400		
いちよし証券	13,000	921.00	11,973,000	貸付株式数	1,100株
松井証券	29,100	923.00	26,859,300		
SOMPOホールディングス	115,700	4,378.00	506,534,600		
日本取引所グループ	172,300	1,905.00	328,231,500	貸付株式数	22,700株
マネックスG	59,700	280.00	16,716,000		
カブドットコム証券	23,200	374.00	8,676,800		
極東証券	7,300	1,678.00	12,249,400		
岩井コスモホールディング	6,600	1,201.00	7,926,600		
藍澤証券	11,100	687.00	7,625,700	貸付株式数	1,000株
フィデアホール	65,900	188.00	12,389,200	貸付株式数	7,600株
池田泉州HD	55,700	457.00	25,454,900		
アニコムホールディングス	4,900	2,249.00	11,020,100	貸付株式数	1,100株
MS&AD	164,500	3,993.00	656,848,500		
SONY FH	52,800	1,725.00	91,080,000	貸付株式数	14,700株
マネーパートナーズGP	10,800	503.00	5,432,400		
第一生命HLDGS	335,400	1,897.50	636,421,500		
東京海上HD	222,400	4,864.00	1,081,753,600		
イー・ギャランティ	2,700	2,631.00	7,103,700	貸付株式数	700株 (700株)
NECキャピタルソリューション	2,900	1,706.00	4,947,400		
T&Dホールディングス	202,000	1,608.50	324,917,000	貸付株式数	25,400株
アドバンスクリエイト	3,500	1,913.00	6,695,500		
三井不動産	296,600	2,672.00	792,515,200		
三菱地所	416,100	2,133.50	887,749,350		
平和不動産	10,700	1,888.00	20,201,600		
東京建物	63,900	1,579.00	100,898,100		
ダイビル	13,900	1,164.00	16,179,600		
京阪神ビルディング	11,500	677.00	7,785,500		
住友不動産	136,000	3,468.00	471,648,000	貸付株式数	10,000株
大京	102,000	229.00	23,358,000		
テーオーシー	21,700	1,057.00	22,936,900		
東京楽天地	13,000	571.00	7,423,000		
レオパレス21	69,300	649.00	44,975,700		
スターツコーポレーション	6,500	2,714.00	17,641,000		
フジ住宅	9,200	729.00	6,706,800		
空港施設	9,200	602.00	5,538,400		
ゴールドクレスト	5,200	2,376.00	12,355,200	貸付株式数	100株
リログループ	29,500	2,281.00	67,289,500	貸付株式数	6,400株
日神不動産	8,900	587.00	5,224,300		
タカラレーベン	25,200	517.00	13,028,400	貸付株式数	7,100株
サンヨーハウジ名古屋	6,300	1,125.00	7,087,500		
イオンモール	35,400	2,138.00	75,685,200		
ファースト住建	3,500	1,562.00	5,467,000	貸付株式数	900株
東祥	2,000	5,510.00	11,020,000		
トーセイ	9,300	796.00	7,402,800		
エヌ・ティ・ティ都市開発	34,200	1,125.00	38,475,000	貸付株式数	9,200株



サンフロンティア不動産	6,500	1,210.00	7,865,000	
エフ・ジェー・ネクスト	8,000	804.00	6,432,000	貸付株式数 100株
グランディハウス	12,000	429.00	5,148,000	
東武鉄道	298,000	615.00	183,270,000	
相鉄ホールディングス	89,000	560.00	49,840,000	
東京急行	304,000	853.00	259,312,000	
京浜急行	153,000	1,396.00	213,588,000	
小田急電鉄	89,900	2,339.00	210,276,100	貸付株式数 7,000株
京王電鉄	154,000	957.00	147,378,000	貸付株式数 43,000株
京成電鉄	40,600	2,946.00	119,607,600	貸付株式数 3,000株
富士急行	16,000	1,221.00	19,536,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
新京成電鉄	13,000	421.00	5,473,000	
東日本旅客鉄道	108,500	10,960.00	1,189,160,000	
西日本旅客鉄道	54,000	7,945.00	429,030,000	
東海旅客鉄道	46,500	18,685.00	868,852,500	
西武ホールディングス	79,200	2,189.00	173,368,800	貸付株式数 22,100株
鴻池運輸	7,900	1,571.00	12,410,900	
西日本鉄道	63,000	493.00	31,059,000	貸付株式数 17,000株
ハマキョウレックス	4,300	2,552.00	10,973,600	
サカイ引越センター	2,800	4,190.00	11,732,000	貸付株式数 700株 (100株)
近鉄グループHLDGS	563,000	445.00	250,535,000	貸付株式数 85,000株
阪急阪神HLDGS	70,900	4,075.00	288,917,500	
南海電鉄	118,000	613.00	72,334,000	
京阪ホールディングス	121,000	765.00	92,565,000	
神戸電鉄	18,000	402.00	7,236,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
名古屋鉄道	203,000	529.00	107,387,000	貸付株式数 57,000株 (57,000株)
山陽電鉄	23,000	575.00	13,225,000	
トランコム	1,800	5,790.00	10,422,000	
日本通運	209,000	714.00	149,226,000	貸付株式数 61,000株 (61,000株)
ヤマトホールディングス	100,500	2,473.00	248,536,500	貸付株式数 28,200株
山九	69,000	716.00	49,404,000	
日新	26,000	489.00	12,714,000	
丸全昭和運輸	16,000	455.00	7,280,000	
センコーグループHLDGS	25,100	699.00	17,544,900	
トナミホールディングス	15,000	447.00	6,705,000	
ニッコンホールディングス	17,100	2,569.00	43,929,900	貸付株式数 4,700株
福山通運	31,000	753.00	23,343,000	
セイノーホールディングス	37,900	1,485.00	56,281,500	貸付株式数 1,000株
神奈川中央交通	8,000	733.00	5,864,000	
日立物流	11,700	2,641.00	30,899,700	
丸和運輸機関	1,700	3,380.00	5,746,000	貸付株式数 400株 (400株)
日本郵船	496,000	206.00	102,176,000	貸付株式数 135,000株
商船三井	299,000	331.00	98,969,000	貸付株式数 60,000株 (60,000株)

川崎汽船	212,000	297.00	62,964,000	貸付株式数	71,000株 (71,000株)
NSユニテッド海運	30,000	231.00	6,930,000		
飯野海運	30,200	469.00	14,163,800		
九州旅客鉄道	56,200	3,870.00	217,494,000		
日本航空	98,400	3,259.00	320,685,600		
ANAホールディングス	1,039,000	375.00	389,625,000		
三菱倉庫	35,000	1,451.00	50,785,000		
三井倉庫HOLD	34,000	322.00	10,948,000		
住友倉庫	39,000	752.00	29,328,000		
渋沢倉庫	28,000	363.00	10,164,000		
ヤマタネ	6,000	1,549.00	9,294,000		
東陽倉庫	28,000	298.00	8,344,000		
日本トランスシティ	18,000	456.00	8,208,000		
東洋埠頭	43,000	181.00	7,783,000		
上組	66,000	1,180.00	77,880,000		
キューソー流通システム	2,300	2,684.00	6,173,200		
郵船ロジスティクス	5,700	1,031.00	5,876,700		
近鉄エクスプレス	10,000	1,810.00	18,100,000		
東海運	12,700	432.00	5,486,400	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
内外トランスライン	3,600	1,240.00	4,464,000	貸付株式数	1,300株
東京放送HD	34,700	1,986.00	68,914,200		
日本テレビHD	50,300	1,824.00	91,747,200		
テレビ朝日HD	15,300	2,009.00	30,737,700		
スカパーJ SATHD	35,000	506.00	17,710,000		
テレビ東京HD	5,000	2,299.00	11,495,000	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
ワイヤレスゲート	4,500	1,558.00	7,011,000	貸付株式数	700株 (500株)
コネクシオ	4,900	1,949.00	9,550,100		
日本通信	66,100	167.00	11,038,700		
日本電信電話	445,600	5,347.00	2,382,623,200		
KDDI	548,600	3,073.00	1,685,847,800		
光通信	6,700	11,370.00	76,179,000		
NTTドコモ	406,600	2,735.00	1,112,051,000		
エムティーアイ	9,600	644.00	6,182,400	貸付株式数	2,700株
GMOインターネット	21,900	1,503.00	32,915,700	貸付株式数	5,800株
カドカワ	17,700	1,401.00	24,797,700		
学研ホールディングス	2,400	3,205.00	7,692,000		
ゼンリン	8,400	2,761.00	23,192,400		
東京電力HD	484,700	459.00	222,477,300	貸付株式数	131,200株
中部電力	183,500	1,546.00	283,691,000		
関西電力	234,800	1,639.50	384,954,600	貸付株式数	64,300株
中国電力	70,500	1,281.00	90,310,500	貸付株式数	21,600株
北陸電力	49,200	1,091.00	53,677,200	貸付株式数	14,700株
東北電力	139,700	1,675.00	233,997,500	貸付株式数	39,100株
四国電力	54,700	1,455.00	79,588,500		
九州電力	124,600	1,420.00	176,932,000	貸付株式数	34,900株
北海道電力	52,600	874.00	45,972,400	貸付株式数	14,600株

沖縄電力	9,350	2,739.00	25,609,650	
電源開発	45,600	2,925.00	133,380,000	貸付株式数 12,700株
イーレックス	8,400	1,091.00	9,164,400	貸付株式数 2,100株
東京瓦斯	601,000	594.20	357,114,200	
大阪瓦斯	542,000	451.90	244,929,800	
東邦瓦斯	140,000	870.00	121,800,000	
北海道瓦斯	21,000	271.00	5,691,000	貸付株式数 5,000株
広島ガス	15,400	352.00	5,420,800	
西部瓦斯	63,000	269.00	16,947,000	
静岡ガス	15,300	785.00	12,010,500	
メタウォーター	3,300	3,090.00	10,197,000	貸付株式数 1,000株 (600株)
松竹	37,000	1,418.00	52,466,000	
東宝	36,200	3,390.00	122,718,000	
エイチ・アイ・エス	11,100	3,180.00	35,298,000	貸付株式数 2,800株
東映	20,000	1,061.00	21,220,000	
NTTデータ	34,700	6,130.00	212,711,000	
共立メンテナンス	9,800	3,440.00	33,712,000	貸付株式数 2,700株 (100株)
イチネンホールディングス	8,300	1,194.00	9,910,200	
建設技術研究所	6,200	1,145.00	7,099,000	
アインホールディングス	7,000	9,080.00	63,560,000	
東京テアトル	67,000	143.00	9,581,000	
タナベ経営	3,700	1,397.00	5,168,900	
ナガワ	1,200	4,040.00	4,848,000	
よみうりランド	15,000	460.00	6,900,000	
東京都競馬	40,000	249.00	9,960,000	
常磐興産	5,200	1,844.00	9,588,800	
カナモト	8,700	3,495.00	30,406,500	
東京ドーム	23,100	1,015.00	23,446,500	
DTS	6,000	3,335.00	20,010,000	貸付株式数 2,000株
スクウェア・エニックス・HD	21,500	3,715.00	79,872,500	
シーイーシー	3,900	2,378.00	9,274,200	
カプコン	13,500	2,632.00	35,532,000	貸付株式数 3,700株
西尾レントオール	5,200	3,310.00	17,212,000	
日本空港ビルデング	17,600	4,665.00	82,104,000	
トランス・コスモス	7,000	2,383.00	16,681,000	
乃村工藝社	12,900	2,426.00	31,295,400	
ジャステック	4,800	1,203.00	5,774,400	
SCSK	15,200	4,910.00	74,632,000	貸付株式数 4,200株
藤田観光	25,000	368.00	9,200,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
KNT-CTホールディングス	39,000	146.00	5,694,000	
日本管財	4,400	1,924.00	8,465,600	
トーカイ	2,600	4,470.00	11,622,000	
セコム	60,100	8,411.00	505,501,100	
セントラル警備保障	3,200	1,900.00	6,080,000	貸付株式数 800株
アイネス	8,200	1,146.00	9,397,200	貸付株式数 1,000株

丹青社	10,900	1,187.00	12,938,300	貸付株式数	3,600株 (3,600株)
メイテック	6,300	4,820.00	30,366,000	貸付株式数	1,900株 (1,900株)
TKC	5,400	3,295.00	17,793,000		
アサツー ディ・ケイ	8,500	2,796.00	23,766,000		
富士ソフト	8,500	3,330.00	28,305,000	貸付株式数	2,300株
応用地質	6,300	1,555.00	9,796,500		
船井総研ホールディング	8,200	2,633.00	21,590,600		
NSD	12,200	2,052.00	25,034,400		
丸紅建材リース	28,000	220.00	6,160,000		
コナミホールディングス	25,200	5,660.00	142,632,000	貸付株式数	7,000株
学 究 社	3,900	1,520.00	5,928,000		
ベネッセホールディングス	19,700	4,190.00	82,543,000	貸付株式数	5,500株
イオンディライト	6,000	3,680.00	22,080,000		
福井コンピュータHLDS	2,000	3,575.00	7,150,000	貸付株式数	500株 (500株)
ニチイ学館	14,200	1,075.00	15,265,000	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
ダイセキ	10,200	2,497.00	25,469,400		
日鉄住金物産	4,100	5,220.00	21,402,000		
元気寿司	3,200	2,246.00	7,187,200	貸付株式数	700株
トラスコ中山	12,800	2,498.00	31,974,400		
ヤマダ電機	183,800	587.00	107,890,600	貸付株式数	51,800株 (51,800株)
オートバックスセブン	18,200	1,784.00	32,468,800	貸付株式数	5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	9,800	1,459.00	14,298,200		
ニトリホールディングス	24,300	16,940.00	411,642,000		
吉野家ホールディングス	22,600	1,842.00	41,629,200		
加藤産業	8,600	3,050.00	26,230,000		
イノテック	10,400	672.00	6,988,800		
イエローハット	5,500	2,712.00	14,916,000	貸付株式数	700株
松屋フーズ	2,800	4,210.00	11,788,000		
J B C Cホールディングス	12,800	840.00	10,752,000		
サガミチェーン	8,500	1,408.00	11,968,000	貸付株式数	2,300株 (2,300株)
日 伝	2,500	3,575.00	8,937,500		
関西スーパーマーケット	6,000	1,624.00	9,744,000	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
ミロク情報サービス	5,200	2,395.00	12,454,000		
因幡電機産業	7,200	4,220.00	30,384,000		
王将フードサービス	4,000	4,155.00	16,620,000	貸付株式数	100株
プレナス	6,000	2,375.00	14,250,000	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ミニストップ	3,700	2,333.00	8,632,100	貸付株式数	1,100株
アークス	10,300	2,477.00	25,513,100		
バローホールディングス	12,000	2,618.00	31,416,000		
ミスミグループ本社	62,500	2,525.00	157,812,500	貸付株式数	17,900株
ベ ル ク	2,600	5,100.00	13,260,000		

大 庄	4,400	1,785.00	7,854,000	貸付株式数	1,200 株
ファーストリテイリング	9,300	38,120.00	354,516,000		
ソフトバンクグループ	249,700	9,135.00	2,281,009,500		
スズケン	24,900	3,555.00	88,519,500		
サンドラッグ	21,300	4,520.00	96,276,000		
サックスバーホールディング	7,000	1,230.00	8,610,000		
ジェコス	5,000	1,178.00	5,890,000		
ベルーナ	14,900	1,338.00	19,936,200		
合計			131,873,348,770		

(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。

「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28年6月6日現在	平成29年6月5日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	94,122,608	69,348,119
国債証券	11,080,174,770	12,142,154,080
地方債証券	1,347,845,700	1,236,362,600
特殊債券	931,482,400	1,025,852,000
社債券	1,328,793,924	1,127,596,700
未収利息	47,054,345	46,033,742
前払費用	1,213,696	1,328,037
流動資産合計	14,830,687,443	15,648,675,278
資産合計	14,830,687,443	15,648,675,278
負債の部		
流動負債		
未払金	12,924,160	—
未払解約金	4,737,000	21,720,400
その他未払費用	181	96
流動負債合計	17,661,341	21,720,496
負債合計	17,661,341	21,720,496
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	11,442,934,731	12,338,211,994
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,370,091,371	3,288,742,788
元本等合計	14,813,026,102	15,626,954,782
純資産合計	14,813,026,102	15,626,954,782
負債純資産合計	14,830,687,443	15,648,675,278

## 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 6 月 7 日 至 平成 29 年 6 月 5 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 28 年 6 月 6 日現在	平成 29 年 6 月 5 日現在
1. ※1 期首	平成 27 年 6 月 6 日	平成 28 年 6 月 7 日
期首元本額	12,254,549,914 円	11,442,934,731 円
期中追加設定元本額	1,950,047,639 円	2,542,998,916 円
期中一部解約元本額	2,761,662,822 円	1,647,721,653 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	38,685 円	44,382 円
iFree 日本債券インデックス	—円	76,772,345 円
iFree 8資産バランス	—円	312,561,275 円
ダイワ・ライフ・バランス30	4,154,739,629 円	4,828,937,388 円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,979,177,803 円	2,363,317,475 円
ダイワ・ライフ・バランス70	600,055,439 円	732,187,988 円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	484,805,417 円	544,123,711 円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	392,817,910 円	449,352,950 円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	115,732,343 円	134,042,851 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	60,749,993 円	70,314,431 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	34,719,343 円	47,554,981 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,739,815 円	3,133,916 円
ダイワ世界バランスファンド40VA	2,632,411,340 円	1,864,339,622 円

ダイワ世界バランスファンド 60VA	241,658,650円	234,579,504円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	275,682,065円	256,192,353円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	468,606,299円	420,756,822円
計	11,442,934,731円	12,338,211,994円
2. 期末日における受益権の総数	11,442,934,731口	12,338,211,994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6月7日 至 平成29年6月5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6月5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 28 年 6 月 6 日現在	平成 29 年 6 月 5 日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
国債証券	695,916,110	△155,074,930
地方債証券	△131,300	△6,636,800
特殊債券	△1,605,000	△4,273,800
社債券	2,061,040	△3,035,700
合計	696,240,850	△169,021,230

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成 27 年 12 月 1 日から平成 28 年 6 月 6 日まで、及び平成 28 年 12 月 1 日から平成 29 年 6 月 5 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 28 年 6 月 6 日現在	平成 29 年 6 月 5 日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	平成 28 年 6 月 6 日現在	平成 29 年 6 月 5 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1.2945 円 (12,945 円)	1.2665 円 (12,665 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 6 8 2 年国債	140,000,000	140,446,600	
	3 7 0 2 年国債	10,000,000	10,036,800	
	3 7 1 2 年国債	125,000,000	125,486,250	
	3 7 3 2 年国債	125,000,000	125,540,000	
	3 7 6 2 年国債	20,000,000	20,097,000	
	1 1 4 5 年国債	62,000,000	62,363,940	
	1 1 6 5 年国債	155,000,000	155,846,300	
	1 1 9 5 年国債	41,000,000	41,205,000	
	1 2 0 5 年国債	10,000,000	10,078,000	
	1 2 1 5 年国債	55,000,000	55,302,500	
	1 2 2 5 年国債	100,000,000	100,611,000	
	1 2 3 5 年国債	100,000,000	100,670,000	
	1 2 4 5 年国債	35,000,000	35,245,000	
	1 2 5 5 年国債	150,000,000	151,138,500	
	1 2 6 5 年国債	154,000,000	155,258,180	
1 2 8 5 年国債	147,000,000	148,340,640		

1 2 9	5年国債	130,000,000	131,232,400	
1 3 0	5年国債	147,000,000	148,508,220	
1 3 1	5年国債	80,000,000	80,807,200	
1	40年国債	60,000,000	85,723,800	
2	40年国債	23,000,000	31,722,060	
3	40年国債	19,000,000	26,318,610	
4	40年国債	30,000,000	41,724,900	
5	40年国債	35,000,000	46,682,650	
6	40年国債	28,000,000	36,568,280	
7	40年国債	31,000,000	38,599,960	
8	40年国債	23,000,000	26,428,610	
9	40年国債	20,000,000	16,462,400	
1 0	40年国債	4,000,000	3,925,240	
2 9 6	10年国債	35,000,000	35,744,800	
2 9 7	10年国債	20,000,000	20,475,800	
2 9 8	10年国債	61,000,000	62,357,250	
3 0 0	10年国債	8,000,000	8,236,000	
3 0 1	10年国債	35,000,000	36,175,300	
3 0 2	10年国債	54,000,000	55,703,160	
3 0 5	10年国債	100,000,000	103,666,000	
3 0 6	10年国債	10,000,000	10,428,800	
3 0 8	10年国債	100,000,000	104,358,000	
3 0 9	10年国債	103,000,000	106,860,440	
3 1 0	10年国債	30,000,000	31,119,300	
3 1 1	10年国債	42,000,000	43,289,400	
3 1 2	10年国債	94,000,000	98,424,580	
3 1 3	10年国債	34,000,000	35,834,980	
3 1 4	10年国債	77,000,000	80,569,720	
3 1 5	10年国債	90,000,000	94,797,900	
3 1 6	10年国債	56,000,000	58,758,560	
3 1 7	10年国債	40,000,000	42,094,000	
3 1 8	10年国債	33,000,000	34,585,320	
3 1 9	10年国債	140,000,000	147,723,800	
3 2 0	10年国債	35,000,000	36,771,350	
3 2 1	10年国債	65,000,000	68,452,800	
3 2 2	10年国債	140,000,000	146,763,400	
3 2 4	10年国債	80,000,000	83,643,200	
3 2 5	10年国債	137,000,000	143,515,720	
3 2 6	10年国債	20,000,000	20,879,200	
3 2 8	10年国債	60,000,000	62,406,600	
3 2 9	10年国債	50,000,000	52,700,500	
3 3 0	10年国債	81,000,000	85,531,140	
3 3 1	10年国債	103,000,000	107,459,900	
3 3 2	10年国債	35,000,000	36,563,800	
3 3 3	10年国債	53,000,000	55,439,060	
3 3 4	10年国債	156,000,000	163,447,440	
3 3 5	10年国債	140,000,000	145,684,000	
3 3 6	10年国債	48,000,000	49,978,080	
3 3 7	10年国債	14,000,000	14,365,260	
3 3 8	10年国債	152,000,000	157,160,400	

3 3 9	1 0年国債	45,000,000	46,539,900	
3 4 0	1 0年国債	55,000,000	56,893,650	
3 4 1	1 0年国債	48,000,000	49,249,920	
3 4 2	1 0年国債	60,000,000	60,500,400	
3 4 3	1 0年国債	152,000,000	153,234,240	
3 4 4	1 0年国債	58,000,000	58,429,780	
3 4 5	1 0年国債	155,000,000	156,105,150	
3 4 6	1 0年国債	170,000,000	171,076,100	
2	3 0年国債	9,000,000	11,524,950	
3	3 0年国債	4,000,000	5,082,840	
4	3 0年国債	8,000,000	10,844,240	
5	3 0年国債	8,000,000	10,150,800	
6	3 0年国債	9,000,000	11,723,940	
7	3 0年国債	12,000,000	15,511,800	
8	3 0年国債	5,000,000	6,108,100	
9	3 0年国債	11,000,000	12,786,730	
1 0	3 0年国債	15,000,000	16,745,250	
1 1	3 0年国債	9,000,000	10,886,040	
1 2	3 0年国債	11,000,000	13,998,600	
1 3	3 0年国債	11,000,000	13,837,230	
1 4	3 0年国債	22,000,000	29,126,240	
1 5	3 0年国債	21,000,000	28,168,140	
1 6	3 0年国債	26,000,000	34,941,400	
1 7	3 0年国債	17,000,000	22,590,110	
1 8	3 0年国債	20,000,000	26,265,200	
1 9	3 0年国債	15,000,000	19,727,850	
2 0	3 0年国債	16,000,000	21,633,600	
2 1	3 0年国債	16,000,000	21,100,480	
2 2	3 0年国債	17,000,000	23,035,850	
2 3	3 0年国債	16,000,000	21,712,960	
2 4	3 0年国債	15,000,000	20,366,850	
2 5	3 0年国債	17,000,000	22,486,240	
2 6	3 0年国債	32,000,000	42,984,320	
2 7	3 0年国債	32,000,000	43,707,520	
2 8	3 0年国債	34,000,000	46,583,060	
2 9	3 0年国債	43,000,000	58,270,160	
3 0	3 0年国債	47,000,000	62,938,640	
3 1	3 0年国債	38,000,000	50,248,540	
3 2	3 0年国債	49,000,000	66,027,010	
3 3	3 0年国債	55,000,000	70,805,350	
3 4	3 0年国債	50,000,000	66,720,000	
3 5	3 0年国債	56,000,000	72,388,960	
3 6	3 0年国債	59,000,000	76,408,540	
3 7	3 0年国債	57,000,000	72,631,680	
3 8	3 0年国債	39,000,000	48,849,840	
3 9	3 0年国債	37,000,000	47,245,670	
4 0	3 0年国債	29,000,000	36,364,840	
4 1	3 0年国債	34,000,000	41,843,120	
4 2	3 0年国債	33,000,000	40,626,300	
4 3	3 0年国債	37,000,000	45,566,610	

44	30年国債	35,000,000	43,117,550	
45	30年国債	40,000,000	47,332,800	
46	30年国債	48,000,000	56,799,360	
47	30年国債	44,000,000	53,218,000	
48	30年国債	45,000,000	52,191,000	
49	30年国債	45,000,000	52,182,000	
50	30年国債	44,000,000	44,206,800	
51	30年国債	45,000,000	39,327,750	
52	30年国債	47,000,000	43,447,740	
53	30年国債	40,000,000	37,952,400	
54	30年国債	45,000,000	45,000,000	
40	20年国債	51,000,000	52,611,600	
41	20年国債	40,000,000	41,180,000	
42	20年国債	22,000,000	23,081,740	
43	20年国債	14,000,000	14,976,640	
44	20年国債	32,000,000	34,351,040	
45	20年国債	20,000,000	21,413,400	
46	20年国債	19,000,000	20,351,470	
47	20年国債	23,000,000	24,766,630	
48	20年国債	9,000,000	9,839,970	
49	20年国債	4,000,000	4,338,800	
50	20年国債	30,000,000	32,312,700	
51	20年国債	25,000,000	27,145,000	
52	20年国債	19,000,000	20,809,940	
53	20年国債	13,000,000	14,306,630	
54	20年国債	14,000,000	15,470,980	
55	20年国債	41,000,000	45,151,660	
56	20年国債	12,000,000	13,275,360	
57	20年国債	24,000,000	26,429,280	
58	20年国債	35,000,000	38,731,000	
59	20年国債	3,000,000	3,301,560	
61	20年国債	40,000,000	42,559,200	
62	20年国債	16,000,000	16,869,280	
63	20年国債	30,000,000	33,450,900	
64	20年国債	35,000,000	39,404,050	
65	20年国債	42,000,000	47,480,160	
66	20年国債	30,000,000	33,717,300	
67	20年国債	19,000,000	21,558,540	
68	20年国債	25,000,000	28,877,750	
69	20年国債	12,000,000	13,779,480	
70	20年国債	18,000,000	21,143,340	
71	20年国債	17,000,000	19,728,330	
72	20年国債	53,000,000	61,357,040	
73	20年国債	30,000,000	34,626,300	
74	20年国債	22,000,000	25,558,940	
75	20年国債	14,000,000	16,326,380	
76	20年国債	25,000,000	28,764,250	
78	20年国債	17,000,000	19,627,010	
79	20年国債	14,000,000	16,276,120	
80	20年国債	20,000,000	23,412,400	

8 1	2 0年国債	39,000,000	45,502,080	
8 2	2 0年国債	28,000,000	32,900,280	
8 3	2 0年国債	25,000,000	29,481,750	
8 4	2 0年国債	27,000,000	31,609,710	
8 5	2 0年国債	31,000,000	36,701,830	
8 6	2 0年国債	6,000,000	7,208,940	
8 7	2 0年国債	20,000,000	23,854,200	
8 8	2 0年国債	33,000,000	39,821,760	
8 9	2 0年国債	15,000,000	17,965,500	
9 0	2 0年国債	37,000,000	44,477,330	
9 1	2 0年国債	12,000,000	14,536,320	
9 2	2 0年国債	45,000,000	53,883,900	
9 3	2 0年国債	18,000,000	21,448,620	
9 4	2 0年国債	45,000,000	54,060,300	
9 5	2 0年国債	30,000,000	36,776,700	
9 6	2 0年国債	23,000,000	27,735,700	
9 7	2 0年国債	25,000,000	30,485,500	
9 8	2 0年国債	34,000,000	41,112,460	
9 9	2 0年国債	53,000,000	64,286,880	
1 0 0	2 0年国債	35,000,000	42,955,850	
1 0 1	2 0年国債	18,000,000	22,476,600	
1 0 2	2 0年国債	10,000,000	12,531,000	
1 0 3	2 0年国債	21,000,000	26,085,360	
1 0 4	2 0年国債	34,000,000	41,490,200	
1 0 5	2 0年国債	38,000,000	46,508,580	
1 0 6	2 0年国債	16,000,000	19,761,280	
1 0 7	2 0年国債	20,000,000	24,548,000	
1 0 8	2 0年国債	48,000,000	57,821,280	
1 0 9	2 0年国債	35,000,000	42,263,200	
1 1 0	2 0年国債	27,000,000	33,230,790	
1 1 1	2 0年国債	35,000,000	43,611,050	
1 1 2	2 0年国債	29,000,000	35,791,220	
1 1 3	2 0年国債	74,000,000	91,575,740	
1 1 4	2 0年国債	45,000,000	55,797,750	
1 1 5	2 0年国債	22,000,000	27,549,720	
1 1 6	2 0年国債	27,000,000	33,878,790	
1 1 7	2 0年国債	37,000,000	45,963,250	
1 1 8	2 0年国債	13,000,000	16,023,670	
1 1 9	2 0年国債	13,000,000	15,692,300	
1 2 0	2 0年国債	60,000,000	70,851,600	
1 2 1	2 0年国債	56,000,000	68,410,720	
1 2 2	2 0年国債	10,000,000	12,086,600	
1 2 3	2 0年国債	42,000,000	52,517,640	
1 2 4	2 0年国債	35,000,000	43,303,400	
1 2 5	2 0年国債	25,000,000	31,685,500	
1 2 6	2 0年国債	21,000,000	26,035,380	
1 2 7	2 0年国債	23,000,000	28,206,740	
1 2 8	2 0年国債	32,000,000	39,292,480	
1 2 9	2 0年国債	34,000,000	41,285,860	
1 3 0	2 0年国債	28,000,000	34,057,240	

131	20年国債	37,000,000	44,492,870	
132	20年国債	25,000,000	30,084,750	
133	20年国債	50,000,000	60,871,000	
134	20年国債	25,000,000	30,480,750	
135	20年国債	20,000,000	24,082,800	
136	20年国債	40,000,000	47,596,800	
137	20年国債	18,000,000	21,703,500	
138	20年国債	24,000,000	28,224,480	
139	20年国債	32,000,000	38,121,920	
140	20年国債	60,000,000	72,384,000	
141	20年国債	48,000,000	57,975,840	
142	20年国債	30,000,000	36,680,100	
143	20年国債	48,000,000	57,274,080	
144	20年国債	24,000,000	28,254,960	
145	20年国債	78,000,000	94,345,680	
146	20年国債	58,000,000	70,173,040	
147	20年国債	74,000,000	88,390,040	
148	20年国債	59,000,000	69,535,040	
149	20年国債	72,000,000	84,834,000	
150	20年国債	61,000,000	70,863,090	
151	20年国債	69,000,000	77,790,600	
152	20年国債	69,000,000	77,712,630	
153	20年国債	72,000,000	82,277,280	
154	20年国債	67,000,000	75,362,940	
155	20年国債	70,000,000	76,195,700	
156	20年国債	63,000,000	61,705,980	
157	20年国債	77,000,000	72,417,730	
158	20年国債	63,000,000	62,504,820	
159	20年国債	70,000,000	70,617,400	
160	20年国債	80,000,000	81,994,400	
国債証券 合計			12,142,154,080	
地方債証券	751 東京都公債	100,000,000	102,035,600	
	20-6 北海道公債	100,000,000	102,107,000	
	21-35 兵庫県公債	100,000,000	103,770,700	
	3 兵庫県公債12年	100,000,000	103,379,000	
	28-1 静岡県公債	100,000,000	99,427,400	
	24-16 愛知県公債	100,000,000	103,976,800	
	21-2 埼玉県公債	100,000,000	103,060,100	
	76 共同発行地方	100,000,000	102,936,700	
	116 共同発行地方	100,000,000	104,081,200	
	117 共同発行地方	100,000,000	103,689,600	
	21-6 大阪市公債	100,000,000	103,831,900	
	25-6 大阪市公債	100,000,000	104,066,600	
地方債証券 合計			1,236,362,600	
特殊債券	5 日本政策投資CO	100,000,000	103,102,800	
	98 政保道路機構	100,000,000	103,431,900	
	122 政保道路機構	100,000,000	103,103,300	
	190 政保道路機構	100,000,000	103,585,100	
	261 政保道路機構	100,000,000	102,561,800	
	2 政保地方公営機	100,000,000	102,321,700	

	3 6 地方公共団体	100,000,000	104,089,400	
	1 4 政保地方公共6	100,000,000	100,573,200	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	103,035,200	
	い789 利付商工債	100,000,000	100,047,600	
特殊債券	合計		1,025,852,000	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,113,800	
	2 5 東日本高速道	100,000,000	100,475,000	
	2 7 東日本高速道	100,000,000	100,428,200	
	3 3 中日本高速道	100,000,000	104,287,300	
	1 明治安田2014基	100,000,000	100,457,600	
	3 5 みずほBK	100,000,000	100,457,900	
	6 2 トヨタファイナンス	100,000,000	100,378,300	
	1 6 4 オリックス	100,000,000	102,269,800	
	4 4 野村ホールディング	100,000,000	101,764,100	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	114,252,300	
	7 0 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,712,400	
社債券	合計		1,127,596,700	
合計			15,531,965,380	

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28年6月6日現在	平成29年6月5日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	498,370,533	362,428,093
コール・ローン	170,297,451	298,981,373
株式	68,298,118,257	83,703,926,393
投資証券	1,912,881,590	2,205,951,187
派生商品評価勘定	38,013,012	24,307,799
未収入金	3,825,680	197,707,900
未収配当金	157,541,493	188,031,265
差入委託証拠金	408,264,066	605,744,078
流動資産合計	71,487,312,082	87,587,078,088
資産合計	71,487,312,082	87,587,078,088
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,037	847,400
未払金	128,479,420	301,592,321
未払解約金	49,999,000	100,345,000
その他未払費用	239	84
流動負債合計	178,485,696	402,784,805
負債合計	178,485,696	402,784,805
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	39,785,667,779	39,805,675,154
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	31,523,158,607	47,378,618,129
元本等合計	71,308,826,386	87,184,293,283
純資産合計	71,308,826,386	87,184,293,283
負債純資産合計	71,487,312,082	87,587,078,088



## 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 6 月 7 日 至 平成 29 年 6 月 5 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	外貨建取引等の処理基準  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28年6月6日現在	平成29年6月5日現在
1. ※1 期首	平成27年6月6日	平成28年6月7日
期首元本額	39,219,879,313 円	39,785,667,779 円
期中追加設定元本額	4,615,008,042 円	5,766,985,609 円
期中一部解約元本額	4,049,219,576 円	5,746,978,234 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	763,491,060 円	611,175,330 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	42,295,165 円	23,653,125 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	544,259,041 円	334,887,782 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	54,335,695 円	37,209,070 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,774,235,447 円	1,187,986,939 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)	－円	299,802,618 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)	－円	758,868,417 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)	－円	116,847,865 円
D-I's 外国株式インデックス	1,891,970 円	1,053,700 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	178,044 円	172,046 円
iFree 外国株式インデックス	－円	319,893,365 円

iFree 8資産バランス	—円	182,124,832円
DCダイワ外国株式インデックス	21,362,863,344円	22,940,826,869円
ダイワ・ライフ・バランス30	529,452,665円	511,661,374円
ダイワ・ライフ・バランス50	692,365,239円	686,960,408円
ダイワ・ライフ・バランス70	525,755,227円	530,750,964円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,416,102,993円	1,456,838,106円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	8,171,833円	6,562,361円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	14,515,511円	15,921,802円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,028,528円	3,467,707円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	100,000円	89,936円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	197,107円	178,417円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	20,225,892円	4,542,012円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	166,648,116円	44,098,955円
ダイワ世界バランスファンド40VA	2,187,609,194円	1,303,912,713円
ダイワ世界バランスファンド60VA	557,881,230円	455,661,623円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,338,833,622円	4,209,648,264円
ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	257,652,598円	203,554,294円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	349,923,691円	435,297,106円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	6,975,988円	25,242,460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)	—円	470,367円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,009,946,101円	2,947,842,119円
ダイワライフスタイル25	24,416,927円	21,241,772円
ダイワライフスタイル50	75,100,156円	70,870,855円
ダイワライフスタイル75	57,215,395円	56,359,581円
計	39,785,667,779円	39,805,675,154円
2. 期末日における受益権の総数	39,785,667,779口	39,805,675,154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 6 月 7 日 至 平成 29 年 6 月 5 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 6 月 5 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 28 年 6 月 6 日 現在	平成 29 年 6 月 5 日 現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△1,371,857,422	8,693,264,747
投資証券	86,602,861	150,855,182
合計	△1,285,254,561	8,844,119,929

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間 (平成 27 年 12 月 1 日から平成 28 年 6 月 6 日まで、及び平成 28 年 12 月 1 日から平成 29 年 6 月 5 日まで) を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	平成 28 年 6 月 6 日 現在				平成 29 年 6 月 5 日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	967,840,265	—	1,005,842,654	38,002,389	1,187,728,828	—	1,212,036,627	24,307,799
合計	967,840,265	—	1,005,842,654	38,002,389	1,187,728,828	—	1,212,036,627	24,307,799

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	平成 28 年 6 月 6 日 現在				平成 29 年 6 月 5 日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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								
売 建	21,840,000	—	21,830,000	10,000	—	—	—	—
デンマーク・ クローネ	8,120,000	—	8,120,000	0	—	—	—	—
香港・ドル	13,720,000	—	13,710,000	10,000	—	—	—	—

買 建	32,658,516	—	32,652,102	△6,414	210,493,400	—	209,646,000	△847,400
アメリカ・ドル	13,720,000	—	13,713,679	△6,321	210,493,400	—	209,646,000	△847,400
イギリス・ポンド	6,135,096	—	6,134,800	△296	—	—	—	—
オーストラリア・ドル	4,683,420	—	4,683,000	△420	—	—	—	—
カナダ・ドル	8,120,000	—	8,120,623	623	—	—	—	—
合計	54,498,516	—	54,482,102	3,586	210,493,400	—	209,646,000	△847,400

(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28年6月6日現在	平成29年6月5日現在
1口当たり純資産額	1.7923円	2.1902円
(1万口当たり純資産額)	(17,923円)	(21,902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	77.650	209,655.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,100	138.110	290,031.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,350	148.590	200,596.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	18,800	27.400	515,120.000	
	ABBOTT LABORATORIES	39,416	46.500	1,832,844.000	
	ARCONIC INC	10,333	28.160	290,977.280	
	VERISK ANALYTICS INC	3,750	81.860	306,975.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	10,100	62.550	631,755.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	6,950	75.560	525,142.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,179	86.670	622,203.930	
	QORVO INC	2,900	78.950	228,955.000	
	AFLAC INC	9,300	75.930	706,149.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	2,750	91.300	251,075.000		

ADOBE SYSTEMS INC	11,350	143.480	1,628,498.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,500	26.400	145,200.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,500	54.290	135,725.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,800	16.780	114,104.000	
GARMIN LTD	2,600	52.950	137,670.000	
AETNA INC	7,929	147.730	1,171,351.170	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,650	146.790	682,573.500	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16,500	134.030	2,211,495.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,751	59.230	222,171.730	
WR BERKLEY CORP	2,100	69.100	145,110.000	
AUTOZONE INC	670	621.700	416,539.000	
DOLLAR TREE INC	5,271	80.430	423,946.530	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,900	29.030	606,727.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,650	89.220	236,433.000	
CELANESE CORP-SERIES A	3,300	88.040	290,532.000	
DR HORTON INC	7,966	33.790	269,171.140	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,100	36.070	75,747.000	
DENTSPLY SIRONA INC	5,200	64.450	335,140.000	
AUTODESK INC	4,550	112.910	513,740.500	
MOODY'S CORP	3,850	118.820	457,457.000	
DEVON ENERGY CORP	10,900	33.130	361,117.000	
ALBEMARLE CORP	2,600	114.090	296,634.000	
ATMOS ENERGY CORP	2,300	84.880	195,224.000	
ALLIANT ENERGY CORP	5,000	41.830	209,150.000	
CITIGROUP INC	64,623	61.110	3,949,111.530	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,300	100.980	1,040,094.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	11,100	72.670	806,637.000	
ALLEGHANY CORP	350	597.470	209,114.500	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	218.050	239,855.000	
HESS CORP	6,500	45.750	297,375.000	
DAVITA INC	3,800	66.430	252,434.000	
DANAHER CORP	14,200	86.840	1,233,128.000	
FORTIVE CORP	7,200	63.410	456,552.000	
AVNET INC	2,800	37.000	103,600.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	13,500	60.320	814,320.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,000	20.110	80,440.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,028	18.720	75,404.160	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,900	42.220	544,638.000	
BUNGE LTD	3,100	80.300	248,930.000	
TE CONNECTIVITY LTD	8,225	79.470	653,640.750	
APPLE INC	121,200	155.450	18,840,540.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,100	58.910	536,081.000	
BOEING CO/THE	13,250	190.230	2,520,547.500	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,465	70.720	245,044.800	
BECTON DICKINSON AND CO	4,887	193.060	943,484.220	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	4,000	22.450	89,800.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,300	55.950	184,635.000	
CDK GLOBAL INC	2,900	62.620	181,598.000	
NISOURCE INC	7,300	26.350	192,355.000	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,350	67.620	226,527.000	
CR BARD INC	1,680	313.360	526,444.800	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	24,271	47.510	1,153,115.210	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	92,704	46.440	4,305,173.760	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	27,850	166.290	4,631,176.500	

ANSYS INC	1,900	129.490	246,031.000	
H&R BLOCK INC	5,100	26.890	137,139.000	
BB&T CORP	18,350	42.160	773,636.000	
BAKER HUGHES INC	9,173	54.950	504,056.350	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	38,050	54.970	2,091,608.500	
JPMORGAN CHASE & CO	81,470	82.640	6,732,680.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	5,600	71.530	400,568.000	
CIGNA CORP	5,900	164.460	970,314.000	
LKQ CORP	6,800	32.330	219,844.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,000	144.250	144,250.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,000	52.540	262,700.000	
CADENCE DESIGN SYS INC	6,400	35.270	225,728.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,660	122.670	448,972.200	
DOLLAR GENERAL CORP	6,500	78.910	512,915.000	
SERVICENOW INC	3,800	107.300	407,740.000	
CATERPILLAR INC	13,200	105.950	1,398,540.000	
CMS ENERGY CORP	6,400	47.790	305,856.000	
MOSAIC CO/THE	7,550	22.500	169,875.000	
DELTA AIR LINES INC	4,400	51.190	225,236.000	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	4,100	89.990	368,959.000	
CORNING INC	21,600	29.690	641,304.000	
CISCO SYSTEMS INC	114,100	31.980	3,648,918.000	
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	19,700	80.510	1,586,047.000	
MORGAN STANLEY	31,800	42.520	1,352,136.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,250	125.000	156,250.000	
DOW CHEMICAL CO/THE	25,700	63.050	1,620,385.000	
MSCI INC	2,000	104.460	208,920.000	
MIDDLEBY CORP	1,300	132.100	171,730.000	
COTY INC-CL A	11,139	19.090	212,643.510	
BROADCOM LTD	9,152	254.530	2,329,458.560	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,050	127.640	134,022.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,000	41.010	82,020.000	
ACUTY BRANDS INC	1,000	167.750	167,750.000	
ARAMARK	5,350	38.790	207,526.500	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,900	33.000	161,700.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,150	110.930	460,359.500	
CENTENE CORP	4,000	75.190	300,760.000	
CBOE HOLDINGS INC	2,400	86.750	208,200.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	11,600	34.130	395,908.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,050	57.350	232,267.500	
GARTNER INC	1,900	120.870	229,653.000	
SPLUNK INC	3,200	62.510	200,032.000	
AGCO CORP	1,450	65.230	94,583.500	
DOMINION ENERGY INC	14,300	81.200	1,161,160.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,300	51.270	476,811.000	
SMITH (A. O.) CORP	3,400	56.250	191,250.000	
DEERE & CO	6,050	124.910	755,705.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,600	92.390	332,604.000	
TIME WARNER INC	17,633	99.180	1,748,840.940	
VMWARE INC-CLASS A	1,450	95.360	138,272.000	
NASDAQ INC	2,700	67.500	182,250.000	
VAIL RESORTS INC	950	215.360	204,592.000	
EAST WEST BANCORP INC	3,400	54.190	184,246.000	
TARGA RESOURCES CORP	4,150	45.480	188,742.000	



REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,500	126.080	189,120.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	7,000	83.530	584,710.000	
MEDNAX INC	2,200	55.460	122,012.000	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,400	102.950	247,080.000	
TELEFLEX INC	1,000	207.020	207,020.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,100	85.980	180,558.000	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	1,750	78.320	137,060.000	
IDEX CORP	1,800	110.100	198,180.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	19,150	77.110	1,476,656.500	
ROLLINS INC	2,200	43.060	94,732.000	
AMETEK INC	5,225	61.860	323,218.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,800	52.570	304,906.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,000	80.040	640,320.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	9,950	180.970	1,800,651.500	
SCANA CORP	3,100	68.630	212,753.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,200	161.000	193,200.000	
WR GRACE & CO	1,600	72.580	116,128.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	650	478.070	310,745.500	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,600	24.490	186,124.000	
UGI CORP	3,900	51.680	201,552.000	
CUMMINS INC	3,700	158.140	585,118.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,600	59.650	811,240.000	
SABRE CORP	4,600	22.700	104,420.000	
CDW CORP/DE	3,250	61.240	199,030.000	
SIGNATURE BANK	1,300	144.920	188,396.000	
COSTAR GROUP INC	750	262.230	196,672.500	
SVB FINANCIAL GROUP	1,200	169.270	203,124.000	
AMERCO	170	356.450	60,596.500	
MERCADOLIBRE INC	900	280.370	252,333.000	
HANESBRANDS INC	8,500	21.310	181,135.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,800	105.230	189,414.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,566	67.410	307,794.060	
DEXCOM INC	1,900	67.680	128,592.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,050	91.840	188,272.000	
SEATTLE GENETICS INC	2,250	65.950	148,387.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,700	149.700	254,490.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,200	271.670	326,004.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	8,000	39.050	312,400.000	
KINDER MORGAN INC	42,881	18.950	812,594.950	
HCA HEALTHCARE INC	6,800	83.330	566,644.000	
CABOT OIL & GAS CORP	10,550	21.590	227,774.500	
T-MOBILE US INC	6,450	68.320	440,664.000	
ZILLOW GROUP INC - C	2,500	45.060	112,650.000	
COCA-COLA CO/THE	93,450	45.890	4,288,420.500	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,000	54.740	218,960.000	
EATON VANCE CORP	2,500	47.480	118,700.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,200	42.760	350,632.000	
CSX CORP	21,400	54.540	1,167,156.000	
FLUOR CORP	3,300	45.560	150,348.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,350	141.580	332,713.000	
EXPEDIA INC	2,875	146.370	420,813.750	
AUTOLIV INC	2,000	115.150	230,300.000	
AMAZON.COM INC	9,190	1,006.730	9,251,848.700	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	5,000	30.140	150,700.000	

FLOWSERVE CORP	2,900	48.590	140,911.000
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,900	117.560	576,044.000
EXXON MOBIL CORP	94,305	79.500	7,497,247.500
FLIR SYSTEMS INC	3,100	38.690	119,939.000
AES CORP	15,600	11.910	185,796.000
L3 TECHNOLOGIES INC	1,800	168.440	303,192.000
EVEREST RE GROUP LTD	900	255.530	229,977.000
EOG RESOURCES INC	13,250	89.680	1,188,260.000
EQT CORP	4,050	54.790	221,899.500
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,900	48.530	189,267.000
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,800	93.580	355,604.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,290	60.810	443,304.900
FORD MOTOR CO	85,323	11.350	968,416.050
MACY'S INC	6,898	23.810	164,241.380
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,440	26.490	91,125.600
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,687	31.750	180,562.250
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,120	25.850	132,352.000
MOBILEYE NV	3,900	61.780	240,942.000
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	300	107.890	32,367.000
AERCAP HOLDINGS NV	3,800	45.420	172,596.000
FORTINET INC	3,500	39.050	136,675.000
MARKEL CORP	320	989.380	316,601.600
NEXTERA ENERGY INC	10,700	142.710	1,526,997.000
FREEMPORT-MCMORAN INC	29,708	11.290	335,403.320
US BANCORP	38,750	51.300	1,987,875.000
UNITED RENTALS INC	1,900	108.490	206,131.000
F5 NETWORKS INC	1,450	129.310	187,499.500
FASTENAL CO	6,500	44.270	287,755.000
FISERV INC	4,950	125.710	622,264.500
GENERAL ELECTRIC CO	201,500	27.880	5,617,820.000
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	3,650	51.160	186,734.000
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	6,150	34.270	210,760.500
GENERAL MOTORS CO	31,100	34.450	1,071,395.000
TRIPADVISOR INC	2,750	39.130	107,607.500
GENERAL DYNAMICS CORP	5,900	203.700	1,201,830.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,150	213.310	1,738,476.500
ALPHABET INC-CL A	6,740	996.120	6,713,848.800
ALPHABET INC-CL C	7,057	975.600	6,884,809.200
GENERAL MILLS INC	13,600	57.550	782,680.000
FIRSTENERGY CORP	9,968	29.450	293,557.600
GENUINE PARTS CO	3,500	94.280	329,980.000
IHS MARKIT LTD	8,234	47.060	387,492.040
FIFTH THIRD BANCORP	17,500	23.640	413,700.000
HARRIS CORP	2,750	113.820	313,005.000
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	49.520	148,560.000
HALLIBURTON CO	19,850	45.300	899,205.000
HOME DEPOT INC	27,550	155.350	4,279,892.500
ASSURANT INC	1,400	100.160	140,224.000
HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,600	12.580	309,468.000
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,100	193.790	213,169.000
HERSHEY CO/THE	3,300	115.880	382,404.000
HARLEY-DAVIDSON INC	4,000	53.240	212,960.000
HUMANA INC	3,400	234.210	796,314.000
NXP SEMICONDUCTORS NV	7,600	109.150	829,540.000

HELMERICH & PAYNE	2,600	53.110	138,086.000
HENRY SCHEIN INC	1,800	186.570	335,826.000
HP INC	38,900	18.980	738,322.000
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	37,700	17.400	655,980.000
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,500	42.800	192,600.000
HOLLYFRONTIER CORP	3,900	24.040	93,756.000
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,100	42.900	90,090.000
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,800	98.790	276,612.000
KRAFT HEINZ CO/THE	13,853	93.540	1,295,809.620
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,550	152.050	3,124,627.500
INTERNATIONAL PAPER CO	8,800	54.390	478,632.000
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,600	63.500	228,600.000
ZOETIS INC	10,700	62.500	668,750.000
INGERSOLL-RAND PLC	5,779	89.480	517,104.920
CHENIERE ENERGY INC	4,700	48.700	228,890.000
ALLEGION PLC	2,200	80.060	176,132.000
LEGGETT & PLATT INC	3,100	52.460	162,626.000
LIBERTY GLOBAL PLC- C	13,723	30.600	419,923.800
WASTE CONNECTIONS INC	4,105	96.920	397,856.600
JUNIPER NETWORKS INC	7,600	30.030	228,228.000
JM SMUCKER CO/THE	2,720	130.510	354,987.200
JOHNSON & JOHNSON	61,950	130.080	8,058,456.000
ABBVIE INC	37,179	67.250	2,500,287.750
HOLOGIC INC	5,750	45.030	258,922.500
KIMBERLY-CLARK CORP	8,150	130.640	1,064,716.000
KROGER CO	20,500	30.130	617,665.000
KLA-TENCOR CORP	3,650	105.880	386,462.000
LOCKHEED MARTIN CORP	6,000	281.760	1,690,560.000
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,100	148.350	311,535.000
L BRANDS INC	5,600	52.450	293,720.000
LOWE'S COS INC	19,750	80.220	1,584,345.000
ELI LILLY & CO	22,400	80.130	1,794,912.000
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	6,900	61.910	427,179.000
LAM RESEARCH CORP	3,700	158.740	587,338.000
RANGE RESOURCES CORP	4,300	22.240	95,632.000
JONES LANG LASALLE INC	1,000	117.270	117,270.000
LOEWS CORP	6,500	47.300	307,450.000
LINCOLN NATIONAL CORP	5,149	65.780	338,701.220
MCDONALD'S CORP	18,850	153.740	2,897,999.000
3M CO	13,700	206.700	2,831,790.000
FACEBOOK INC-A	53,250	153.610	8,179,732.500
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,954	68.250	338,110.500
MANPOWERGROUP INC	1,500	104.380	156,570.000
S&P GLOBAL INC	5,950	144.160	857,752.000
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,400	226.550	317,170.000
CONCHO RESOURCES INC	3,250	124.410	404,332.500
ENVISION HEALTHCARE CORP	2,636	55.730	146,904.280
FIRST DATA CORP- CLASS A	7,200	17.980	129,456.000
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	3,800	32.130	122,094.000
PHILLIPS 66	10,650	76.370	813,340.500
MURPHY OIL CORP	3,600	24.060	86,616.000
TECHNIPFMC PLC	10,000	29.000	290,000.000
MGM RESORTS INTERNATIONAL	10,750	32.520	349,590.000
MATTEL INC	7,800	22.560	175,968.000

DXC TECHNOLOGY CO	6,538	77.590	507,283.420	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,650	105.420	279,363.000	
MYLAN NV	10,450	39.080	408,386.000	
METLIFE INC	21,350	51.440	1,098,244.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	10,500	17.590	184,695.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,378	86.620	292,602.360	
MONSANTO CO	10,056	117.820	1,184,797.920	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	597.120	358,272.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,950	162.390	479,050.500	
MERCK & CO. INC.	62,971	65.470	4,122,711.370	
MASCO CORP	7,400	37.640	278,536.000	
M & T BANK CORP	3,169	157.590	499,402.710	
MARSH & MCLENNAN COS	11,750	77.500	910,625.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,522	110.060	827,871.320	
WORKDAY INC-CLASS A	2,700	104.410	281,907.000	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,950	33.050	130,547.500	
VANTIV INC - CL A	3,550	62.000	220,100.000	
NETAPP INC	6,150	39.410	242,371.500	
NIKE INC -CL B	30,550	52.980	1,618,539.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,550	123.640	809,842.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,850	84.340	409,049.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,000	73.330	219,990.000	
ALLY FINANCIAL INC	10,200	18.910	192,882.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,830	258.520	990,131.600	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,200	89.040	552,048.000	
NEWMONT MINING CORP	12,000	34.030	408,360.000	
MCKESSON CORP	5,150	165.700	853,355.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,400	48.420	309,888.000	
XYLEM INC	4,200	53.000	222,600.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	35,250	121.790	4,293,097.500	
NUCOR CORP	7,150	58.700	419,705.000	
WESTERN UNION CO	11,346	19.280	218,750.880	
NEWELL BRANDS INC	10,092	53.350	538,408.200	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,400	60.700	1,056,180.000	
LIBERTY BROADBAND-C	2,350	91.820	215,777.000	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	600	137.100	82,260.000	
PAYCHEX INC	7,550	59.270	447,488.500	
PATTERSON COS INC	1,900	46.990	89,281.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,120	245.920	521,350.400	
ALTRIA GROUP INC	44,350	75.120	3,331,572.000	
P G & E CORP	11,500	68.850	791,775.000	
PFIZER INC	137,663	32.540	4,479,554.020	
ALKERMES PLC	3,600	59.380	213,768.000	
XCEL ENERGY INC	11,500	48.320	555,680.000	
STRYKER CORP	7,600	144.480	1,098,048.000	
PARKER HANNIFIN CORP	3,050	160.240	488,732.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,900	164.880	643,032.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,400	85.740	120,036.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	58,117	88.590	5,148,585.030	
EXELON CORP	21,222	36.600	776,725.200	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,100	101.830	519,333.000	
NVR INC	90	2,331.890	209,870.100	
CONOCOPHILLIPS	28,250	44.260	1,250,345.000	
PEPSICO INC	32,600	117.670	3,836,042.000	

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,900	106.420	1,053,558.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,050	79.000	319,950.000	
ACCENTURE PLC-CL A	14,200	125.740	1,785,508.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,950	65.930	128,563.500	
PENTAIR PLC	4,005	66.200	265,131.000	
QUALCOMM INC	33,350	58.580	1,953,643.000	
INVESCO LTD	9,150	32.930	301,309.500	
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,700	137.800	234,260.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,600	63.960	422,136.000	
RAYTHEON COMPANY	6,700	163.280	1,093,976.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,800	65.940	118,692.000	
RED HAT INC	4,200	91.540	384,468.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,770	480.430	850,361.100	
REPUBLIC SERVICES INC	5,350	64.680	346,038.000	
PRICELINE GROUP INC/THE	1,120	1,895.960	2,123,475.200	
ROSS STORES INC	9,000	63.740	573,660.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,100	104.200	218,820.000	
RESMED INC	3,250	71.960	233,870.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,100	109.940	340,814.000	
ROBERT HALF INTL INC	2,800	47.340	132,552.000	
REYNOLDS AMERICAN INC	19,478	67.730	1,319,244.940	
RALPH LAUREN CORP	1,300	69.170	89,921.000	
AUTONATION INC	1,700	39.860	67,762.000	
ROCKWELL COLLINS INC	3,613	108.230	391,034.990	
REGIONS FINANCIAL CORP	27,435	13.540	371,469.900	
CHEVRON CORP	42,968	103.110	4,430,430.480	
EDISON INTERNATIONAL	7,500	82.010	615,075.000	
TESLA INC	2,900	339.850	985,565.000	
SYMANTEC CORP	13,900	30.080	418,112.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,472	139.250	483,476.000	
SYNOPTIS INC	3,400	75.820	257,788.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,905	353.030	1,731,612.150	
CBRE GROUP INC - A	7,100	35.470	251,837.000	
TWITTER INC	13,000	18.310	238,030.000	
NAVIENT CORP	7,100	14.220	100,962.000	
SOUTHERN CO/THE	22,350	51.010	1,140,073.500	
SYSCO CORP	11,850	55.730	660,400.500	
TRAVELERS COS INC/THE	6,523	125.150	816,353.450	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,200	51.420	164,544.000	
STERICYCLE INC	1,950	82.320	160,524.000	
STEEL DYNAMICS INC	5,700	34.360	195,852.000	
SCHLUMBERGER LTD	31,652	68.960	2,182,721.920	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,900	40.700	158,730.000	
AT&T INC	139,491	38.870	5,422,015.170	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	60.360	205,224.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,780	345.400	614,812.000	
SEMPRA ENERGY	5,400	117.500	634,500.000	
TIFFANY & CO	2,800	89.990	251,972.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	6,500	43.220	280,930.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	22,750	81.630	1,857,082.500	
SALESFORCE.COM INC	14,700	90.860	1,335,642.000	
SIGNET JEWELERS LTD	1,300	53.010	68,913.000	
WESTROCK CO	5,930	55.100	326,743.000	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	21,584	42.250	911,924.000	

TESORO CORP	2,650	84.510	223,951.500	
UNION PACIFIC CORP	18,600	111.200	2,068,320.000	
MARATHON OIL CORP	19,000	12.720	241,680.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	11,900	52.700	627,130.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,700	122.120	2,161,524.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,700	107.670	1,690,419.000	
UNUM GROUP	5,400	45.220	244,188.000	
SPRINT CORP	17,765	8.870	157,575.550	
ANTERO RESOURCES CORP	3,400	19.680	66,912.000	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	3,494	87.930	307,227.420	
VOYA FINANCIAL INC	4,500	35.340	159,030.000	
AMEREN CORPORATION	5,500	57.170	314,435.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	21,876	179.390	3,924,335.640	
VERISIGN INC	2,200	92.550	203,610.000	
VALERO ENERGY CORP	10,392	62.100	645,343.200	
ULTA BEAUTY INC	1,310	311.470	408,025.700	
FNF GROUP	5,738	43.580	250,062.040	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,000	114.150	228,300.000	
ANTHEM INC	6,050	187.580	1,134,859.000	
WALT DISNEY CO/THE	34,450	107.180	3,692,351.000	
WELLS FARGO & CO	108,472	51.810	5,619,934.320	
FOOT LOCKER INC	3,200	58.040	185,728.000	
WASTE MANAGEMENT INC	10,000	74.250	742,500.000	
WILLIAMS COS INC	18,700	28.880	540,056.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,100	55.610	172,391.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	189.890	322,813.000	
WAL-MART STORES INC	35,150	79.620	2,798,643.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,600	123.940	570,124.000	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	22,100	4.730	104,533.000	
WYNN RESORTS LTD	1,800	134.680	242,424.000	
XEROX CORP	19,244	7.080	136,247.520	
WABTEC CORP	1,900	84.170	159,923.000	
TJX COMPANIES INC	14,900	75.220	1,120,778.000	
WATERS CORP	1,800	183.960	331,128.000	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,800	82.030	147,654.000	
ALLERGAN PLC	8,557	228.160	1,952,365.120	
WHOLE FOODS MARKET INC	7,200	35.080	252,576.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,100	83.100	1,753,410.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,033	147.180	446,396.940	
WESTERN DIGITAL CORP	6,450	91.520	590,304.000	
WEC ENERGY GROUP INC	7,030	63.570	446,897.100	
WESTAR ENERGY INC	3,200	53.470	171,104.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,750	45.170	530,747.500	
VISA INC-CLASS A SHARES	42,550	96.150	4,091,182.500	
PPL CORP	15,400	40.060	616,924.000	
PULTEGROUP INC	6,700	23.710	158,857.000	
PPG INDUSTRIES INC	5,950	110.420	656,999.000	
NORTHERN TRUST CORP	4,900	88.510	433,699.000	
NVIDIA CORP	12,200	143.640	1,752,408.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,093	119.160	1,321,841.880	
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	9,550	24.200	231,110.000	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4,700	41.470	194,909.000	
TYSON FOODS INC-CL A	6,500	57.890	376,285.000	
NETFLIX INC	9,650	165.180	1,593,987.000	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,950	176.390	1,578,690.500	
TORCHMARK CORP	2,675	76.470	204,557.250	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,450	93.970	324,196.500	
TEXTRON INC	6,350	47.750	303,212.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	23,950	27.930	668,923.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,300	27.600	284,280.000	
NEWS CORP - CLASS A	8,337	13.580	113,216.460	
OGE ENERGY CORP	4,700	35.790	168,213.000	
OMNICOM GROUP	5,500	85.120	468,160.000	
ORACLE CORP	70,083	45.660	3,199,989.780	
MASTERCARD INC - A	22,000	125.200	2,754,400.000	
ONEOK INC	4,900	49.550	242,795.000	
CENTURYLINK INC	12,795	25.870	331,006.650	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,300	231.200	531,760.000	
YUM! BRANDS INC	7,900	73.990	584,521.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,150	237.840	273,516.000	
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,350	96.860	421,341.000	
NOBLE ENERGY INC	9,600	28.510	273,696.000	
BANK OF AMERICA CORP	230,601	22.450	5,176,992.450	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,850	90.720	349,272.000	
NORDSTROM INC	3,000	42.470	127,410.000	
AMERICAN EXPRESS CO	17,800	78.490	1,397,122.000	
ANALOG DEVICES INC	8,299	80.910	671,472.090	
ADVANCED MICRO DEVICES	17,500	10.900	190,750.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	6,000	37.750	226,500.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	23,422	64.240	1,504,629.280	
ANADARKO PETROLEUM CORP	12,700	50.060	635,762.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,150	108.420	449,943.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,850	113.380	436,513.000	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,500	30.830	138,735.000	
MALLINCKRODT PLC	2,500	42.650	106,625.000	
AVERY DENNISON CORP	2,100	84.750	177,975.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,750	67.470	927,712.500	
EMERSON ELECTRIC CO	14,550	59.340	863,397.000	
AON PLC	6,000	131.400	788,400.000	
AMGEN INC	16,950	159.150	2,697,592.500	
CORE LABORATORIES N. V.	1,000	102.490	102,490.000	
COACH INC	6,400	46.000	294,400.000	
EATON CORP PLC	10,136	77.880	789,391.680	
CELGENE CORP	17,650	118.730	2,095,584.500	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,020	184.770	742,775.400	
APPLIED MATERIALS INC	24,500	46.800	1,146,600.000	
CIT GROUP INC	4,500	44.200	198,900.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,100	104.580	219,618.000	
CME GROUP INC	7,800	116.930	912,054.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,844	32.890	290,879.160	
ECOLAB INC	5,900	134.330	792,547.000	
EQUIFAX INC	2,750	137.610	378,427.500	
GAP INC/THE	5,800	22.560	130,848.000	
GILEAD SCIENCES INC	30,000	65.400	1,962,000.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,098	92.840	380,458.320	
HORMEL FOODS CORP	6,850	34.110	233,653.500	
STATE STREET CORP	8,793	82.680	727,005.240	
STAPLES INC	15,600	9.100	141,960.000	

SUNTRUST BANKS INC	11,198	53.490	598,981.020
SCHWAB (CHARLES) CORP	26,900	38.950	1,047,755.000
BAXTER INTERNATIONAL INC	10,950	59.720	653,934.000
CAMPBELL SOUP CO	4,600	57.730	265,558.000
CROWN HOLDINGS INC	3,100	58.570	181,567.000
CARDINAL HEALTH INC	7,150	75.790	541,898.500
FEDEX CORP	5,700	203.110	1,157,727.000
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,954	78.040	854,850.160
FMC CORP	2,950	76.470	225,586.500
FLEX LTD	12,200	17.620	214,964.000
CERNER CORP	7,000	67.420	471,940.000
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,800	139.240	250,632.000
CITRIX SYSTEMS INC	3,650	83.430	304,519.500
INTEL CORP	108,000	36.320	3,922,560.000
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,800	25.210	221,848.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,650	49.640	429,386.000
ILLINOIS TOOL WORKS	7,200	143.610	1,033,992.000
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,500	5.485	211,172.500
ILLUMINA INC	3,350	183.790	615,696.500
SEALED AIR CORP	4,400	44.530	195,932.000
INTUITIVE SURGICAL INC	870	924.690	804,480.300
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,100	112.860	349,866.000
SNAP-ON INC	1,300	162.750	211,575.000
CARMAX INC	4,250	63.600	270,300.000
COMERICA INC	4,000	68.570	274,280.000
INGREDION INC	1,600	115.080	184,128.000
DUKE ENERGY CORP	15,678	86.280	1,352,697.840
TARGET CORP	11,950	55.520	663,464.000
DOVER CORP	3,500	83.150	291,025.000
WW GRAINGER INC	1,300	172.720	224,536.000
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,900	53.200	154,280.000
CINTAS CORP	1,850	128.280	237,318.000
CA INC	7,105	32.190	228,709.950
CONAGRA BRANDS INC	9,500	39.590	376,105.000
CLOROX COMPANY	2,950	136.630	403,058.500
ENERGY CORP	3,950	80.240	316,948.000
MICROSOFT CORP	167,650	71.760	12,030,564.000
INCYTE CORP	3,850	131.500	506,275.000
CVS HEALTH CORP	24,224	79.050	1,914,907.200
MEDTRONIC PLC	31,738	85.820	2,723,755.160
MICRON TECHNOLOGY INC	24,100	31.210	752,161.000
BLACKROCK INC	2,750	414.710	1,140,452.500
CENTERPOINT ENERGY INC	9,100	28.880	262,808.000
HASBRO INC	2,600	107.160	278,616.000
KELLOGG CO	6,100	72.970	445,117.000
KEYCORP	24,500	17.410	426,545.000
KANSAS CITY SOUTHERN	2,400	95.590	229,416.000
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	35,211	47.190	1,661,607.090
KOHL'S CORP	3,900	38.980	152,022.000
COOPER COS INC/THE	1,100	238.320	262,152.000
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	11,100	12.950	143,745.000
APACHE CORP	8,760	46.990	411,632.400
CHUBB LTD	10,599	145.140	1,538,338.860
ARROW ELECTRONICS INC	2,000	76.430	152,860.000



ALLSTATE CORP	8,350	86.670	723,694.500	
EBAY INC	24,200	35.320	854,744.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	24,950	53.520	1,335,324.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	3,250	81.110	263,607.500	
XILINX INC	5,600	66.880	374,528.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	13,910	60.690	844,197.900	
DISH NETWORK CORP-A	5,300	66.080	350,224.000	
YAHOO! INC	20,600	50.600	1,042,360.000	
ZIONS BANCORPORATION	4,800	40.100	192,480.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,150	96.130	495,069.500	
TOLL BROTHERS INC	3,800	38.290	145,502.000	
TRIMBLE INC	5,900	36.740	216,766.000	
LENNAR CORP-A	4,800	52.730	253,104.000	
LEAR CORP	1,550	152.640	236,592.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	6,500	34.580	224,770.000	
PROGRESSIVE CORP	13,400	43.080	577,272.000	
PRAXAIR INC	6,450	136.620	881,199.000	
PACCAR INC	7,987	63.150	504,379.050	
PVH CORP	1,900	105.960	201,324.000	
BIOGEN INC	4,980	256.650	1,278,117.000	
IDEXX LABORATORIES INC	2,000	169.860	339,720.000	
STARBUCKS CORP	33,100	64.570	2,137,267.000	
PERRIGO CO PLC	3,150	73.440	231,336.000	
EVERSOURCE ENERGY	7,130	62.370	444,698.100	
INTUIT INC	5,600	142.810	799,736.000	
BORGWARNER INC	4,800	44.270	212,496.000	
BEST BUY CO INC	6,500	59.670	387,855.000	
BALL CORP	7,584	41.360	313,674.240	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	31,047	27.600	856,897.200	
BED BATH & BEYOND INC	3,600	35.200	126,720.000	
XL GROUP LTD	6,100	43.280	264,008.000	
ELECTRONIC ARTS INC	6,800	114.520	778,736.000	
VULCAN MATERIALS CO	3,050	126.260	385,093.000	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,650	129.900	733,935.000	
VF CORP	7,750	54.340	421,135.000	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	8,771	61.300	537,662.300	
VIACOM INC-CLASS B	8,171	35.250	288,027.750	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,400	239.400	335,160.000	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,300	19.310	121,653.000	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,200	101.530	223,366.000	
CARNIVAL CORP	8,050	65.470	527,033.500	
COMCAST CORP-CLASS A	108,540	41.990	4,557,594.600	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	5,200	41.750	217,100.000	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,800	65.200	312,960.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	26,500	7.590	201,135.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 488,872,626.100 (54,015,536,459)	
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	5.370	87,531.000	
TUI AG-DI	11,747	11.980	140,729.060	
BP PLC	440,500	4.627	2,038,413.750	
UNILEVER PLC	29,560	43.725	1,292,511.000	

BARCLAYS PLC	395,500	2.109	834,109.500	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	43,400	8.915	386,911.000	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	38,100	3.677	140,093.700	
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,150	76.550	164,582.500	
PRUDENTIAL PLC	59,200	17.670	1,046,064.000	
INMARSAT PLC	10,300	8.430	86,829.000	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	83,891	2.584	216,774.340	
JOHNSON MATTHEY PLC	4,564	31.480	143,674.720	
BAE SYSTEMS PLC	72,700	6.700	487,090.000	
AVIVA PLC	93,966	5.320	499,899.120	
GLAXOSMITHKLINE PLC	113,502	17.060	1,936,344.120	
WORLDPAY GROUP PLC	42,700	3.119	133,181.300	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	8,000	7.975	63,800.000	
AUTO TRADER GROUP PLC	22,400	4.359	97,641.600	
DCC PLC	2,000	75.400	150,800.000	
CONVATEC GROUP PLC	27,500	3.426	94,215.000	
ROYAL MAIL PLC	22,400	4.391	98,358.400	
RELX PLC	25,546	16.800	429,172.800	
DIAGEO PLC	58,600	23.615	1,383,839.000	
RIO TINTO PLC	28,650	31.560	904,194.000	
STANDARD CHARTERED PLC	76,100	7.450	566,945.000	
TESCO PLC	191,100	1.825	348,853.050	
FRESNILLO PLC	5,000	16.510	82,550.000	
SMITH & NEPHEW PLC	20,300	13.740	278,922.000	
GLENCORE PLC	285,125	2.867	817,595.930	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	6,500	14.160	92,040.000	
SMITHS GROUP PLC	9,333	16.270	151,847.910	
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	9.380	57,218.000	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	31,083	3.466	107,733.670	
DIXONS CARPHONE PLC	24,800	3.230	80,104.000	
PEARSON PLC	18,863	7.145	134,776.130	
SAINSBURY (J) PLC	38,125	2.751	104,881.870	
NEXT PLC	3,300	43.610	143,913.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	73,900	1.848	136,567.200	
WHITBREAD PLC	4,311	42.250	182,139.750	
IMI PLC	6,650	12.650	84,122.500	
BUNZL PLC	7,755	24.360	188,911.800	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	20,600	2.900	59,740.000	
GKN PLC	40,600	3.560	144,536.000	
VODAFONE GROUP PLC	613,683	2.299	1,411,164.050	
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,993	40.200	120,318.600	
KINGFISHER PLC	51,911	3.295	171,046.740	
WPP PLC	29,800	17.540	522,692.000	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	15,927	10.020	159,588.540	
SEVERN TRENT PLC	5,733	24.750	141,891.750	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	15,400	80.170	1,234,618.000	
ST JAMES' S PLACE PLC	11,900	11.930	141,967.000	
SCHRODERS PLC	3,200	31.580	101,056.000	
TATE & LYLE PLC	11,400	7.430	84,702.000	
SSE PLC	23,900	14.850	354,915.000	
WEIR GROUP PLC/THE	5,400	18.200	98,280.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,700	5.945	134,951.500	
ASTRAZENECA PLC	29,050	53.640	1,558,242.000	
WOLSELEY PLC	5,965	50.350	300,337.750	

LEGAL & GENERAL GROUP PLC	138,100	2.547	351,740.700	
3I GROUP PLC	22,991	9.305	213,931.250	
SKY PLC	24,500	9.900	242,550.000	
ASHTED GROUP PLC	11,400	16.080	183,312.000	
SAGE GROUP PLC/THE	24,214	7.290	176,520.060	
NATIONAL GRID PLC	80,234	10.340	829,619.560	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,649,965	0.693	1,144,250.720	
RSA INSURANCE GROUP PLC	24,260	6.250	151,625.000	
IMPERIAL BRANDS PLC	22,250	36.490	811,902.500	
CENTRICA PLC	128,360	1.984	254,666.240	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,000	31.930	95,790.000	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	3,650	30.590	111,653.500	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	43,360	55.780	2,418,620.800	
BHP BILLITON PLC	48,577	11.850	575,637.450	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,100	29.970	242,757.000	
HSBC HOLDINGS PLC	460,000	6.784	3,120,640.000	
SHIRE PLC	21,074	45.540	959,709.960	
OLD MUTUAL PLC	117,025	1.970	230,539.250	
ANGLO AMERICAN PLC	32,083	10.295	330,294.480	
MONDI PLC	8,300	20.570	170,731.000	
WM MORRISON SUPERMARKETS	50,900	2.471	125,773.900	
CARNIVAL PLC	4,511	51.350	231,639.850	
EASYJET PLC	3,500	13.890	48,615.000	
COMPASS GROUP PLC	37,741	16.900	637,822.900	
PERSIMMON PLC	7,050	23.980	169,059.000	
BT GROUP PLC	196,600	3.031	595,992.900	
COCA-COLA HBC AG-DI	4,400	23.250	102,300.000	
BURBERRY GROUP PLC	10,489	18.180	190,690.020	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,286	44.680	191,498.480	
CAPITA PLC	15,090	5.905	89,106.450	
TRAVIS PERKINS PLC	5,900	16.090	94,931.000	
INTERTEK GROUP PLC	3,800	43.300	164,540.000	
ITV PLC	86,800	1.914	166,135.200	
PETROFAC LTD	5,600	3.720	20,832.000	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	7,149	34.830	248,999.670	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	100,700	20.870	2,101,609.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	87,218	21.355	1,862,540.390	
MEGGITT PLC	17,700	5.035	89,119.500	
G4S PLC	34,600	3.280	113,488.000	
COBHAM PLC	55,600	1.377	76,561.200	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,300	16.800	55,440.000	
ADMIRAL GROUP PLC	5,200	20.710	107,692.000	
INVESTEC PLC	16,000	5.980	95,680.000	
ANTOFAGASTA PLC	9,800	8.050	78,890.000	
STANDARD LIFE PLC	45,463	3.836	174,396.060	
EXPERIAN PLC	22,054	16.000	352,864.000	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 43,958,635.640 (6,249,159,643)	
イスラエル・シユケル	株	イスラエル・シユケル	イスラエル・シユケル	
AZRIELI GROUP LTD	1,000	193.500	193,500.000	
FRUTAROM	900	231.200	208,080.000	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	56,400	6.080	342,912.000	

	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	15.030	210,420.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	442.100	265,260.000	
	BANK HAPOALIM BM	26,500	23.790	630,435.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	33,400	17.250	576,150.000	
	NICE LTD	1,400	283.800	397,320.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,000	63.320	189,960.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 3,014,037.000 (93,887,253)	
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	2.120	79,500.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	61,700	2.790	172,143.000	
	BHP BILLITON LIMITED	74,700	24.070	1,798,029.000	
	SOUTH32 LTD	127,200	2.620	333,264.000	
	LENLEASE GROUP	13,300	16.530	219,849.000	
	ALUMINA LTD	56,900	1.985	112,946.500	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	17,400	31.970	556,278.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	35,500	4.750	168,625.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	11.190	132,042.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	61,800	30.250	1,869,450.000	
	WESTPAC BANKING CORP	77,798	30.510	2,373,616.980	
	SANTOS LTD	42,800	3.270	139,956.000	
	AUSNET SERVICES	41,000	1.700	69,700.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	67,400	28.280	1,906,072.000	
	RIO TINTO LTD	9,700	62.820	609,354.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	41,400	7.690	318,366.000	
	AMCOR LIMITED	26,700	16.060	428,802.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,800	5.660	264,888.000	
	OIL SEARCH LTD	32,900	7.110	233,919.000	
	SEEK LTD	7,500	16.920	126,900.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	17,100	13.450	229,995.000	
	NEWCREST MINING LTD	17,600	21.310	375,056.000	
	INCITEC PIVOT LTD	38,200	3.480	132,936.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	40,000	80.380	3,215,200.000	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	6,000	33.900	203,400.000	
	ORICA LTD	8,300	19.630	162,929.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	31,000	13.010	403,310.000	
	CIMIC GROUP LTD	2,100	40.780	85,638.000	
	WOOLWORTHS LTD	30,000	26.530	795,900.000	
	COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	9.400	128,780.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	20,500	4.580	93,890.000	
	CROWN RESORTS LTD	8,100	13.320	107,892.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	10,254	5.160	52,910.640	
	TELSTRA CORP LTD	98,600	4.490	442,714.000	
	AMP LTD	71,300	5.120	365,056.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	10,300	20.270	208,781.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	6,984	89.970	628,350.480	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,600	21.900	275,940.000	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	9,100	11.190	101,829.000	
	CSL LTD	10,600	132.000	1,399,200.000	
	WESFARMERS LTD	25,895	41.970	1,086,813.150	
	COCHLEAR LTD	1,400	150.640	210,896.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	13,400	11.770	157,718.000	

SUNCORP GROUP LTD	29,500	14.360	423,620.000	
BORAL LTD	27,700	6.850	189,745.000	
ASX LTD	4,700	52.130	245,011.000	
COMPUTERSHARE LTD	10,400	14.690	152,776.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	3.790	53,060.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	54,900	6.450	354,105.000	
SONIC HEALTHCARE LTD	9,500	23.940	227,430.000	
TRANSURBAN GROUP	47,800	12.640	604,192.000	
CHALLENGER LTD	13,900	12.880	179,032.000	
SYDNEY AIRPORT	25,100	7.680	192,768.000	
TATTS GROUP LTD	36,900	4.190	154,611.000	
AGL ENERGY LTD	15,500	25.930	401,915.000	
BRAMBLES LTD	37,300	10.490	391,277.000	
APA GROUP	26,700	9.900	264,330.000	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,300	70.530	232,749.000	
TPG TELECOM LTD	6,500	5.610	36,465.000	
REA GROUP LTD	1,200	65.110	78,132.000	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,400	57.210	80,094.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 27,040,146.750 (2,218,373,640)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル
IMPERIAL OIL LTD	6,700		37.850	253,595.000
CONSTELLATION SOFTWARE INC	440		711.980	313,271.200
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,696		28.710	134,822.160
RESTAURANT BRANDS INTERN	5,087		82.100	417,642.700
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	10,700		27.540	294,678.000
INTACT FINANCIAL CORP	3,150		94.480	297,612.000
BCE INC	3,430		61.080	209,504.400
FRANCO-NEVADA CORP	4,000		100.900	403,600.000
SUNCOR ENERGY INC	38,830		41.940	1,628,530.200
METRO INC	5,500		45.980	252,890.000
NATIONAL BANK OF CANADA	8,100		54.050	437,805.000
BANK OF NOVA SCOTIA	28,200		76.680	2,162,376.000
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9,150		105.630	966,514.500
TORONTO-DOMINION BANK	43,200		64.840	2,801,088.000
GREAT-WEST LIFECO INC	6,700		33.910	227,197.000
ROYAL BANK OF CANADA	34,550		93.760	3,239,408.000
TOURMALINE OIL CORP	5,400		27.100	146,340.000
VERMILION ENERGY INC	2,800		41.900	117,320.000
TRANSCANADA CORP	20,150		63.340	1,276,301.000
PEMBINA PIPELINE CORP	8,900		43.820	389,998.000
BOMBARDIER INC-B	45,400		2.560	116,224.000
BARRICK GOLD CORP	27,300		21.870	597,051.000
CAE INC	5,800		21.930	127,194.000
THOMSON REUTERS CORP	6,704		59.590	399,491.360
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	19,300		22.160	427,688.000
EMPIRE CO LTD 'A'	3,900		21.240	82,836.000
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,400		59.900	83,860.000
VERESEN INC	8,000		18.570	148,560.000
CCL INDUSTRIES INC - CL B	690		321.820	222,055.800
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	9,700		9.370	90,889.000
LINAMAR CORP	1,100		62.250	68,475.000
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	5,400		23.840	128,736.000

HYDRO ONE LTD	4,000	23.850	95,400.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,160	77.300	398,868.000	
EMERA INC	1,300	48.780	63,414.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,800	41.010	114,828.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,600	63.230	543,778.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,200	65.960	342,992.000	
KINROSS GOLD CORP	29,500	5.830	171,985.000	
BANK OF MONTREAL	15,000	91.270	1,369,050.000	
POWER CORP OF CANADA	8,700	29.140	253,518.000	
METHANEX CORP	2,200	55.740	122,628.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,700	131.900	224,230.000	
TRISURA GROUP LTD-WI	122	22.100	2,696.200	
CAMECO CORP	9,200	12.330	113,436.000	
TELUS CORP	5,400	45.810	247,374.000	
POWER FINANCIAL CORP	6,200	32.640	202,368.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,400	23.600	316,240.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,600	153.790	246,064.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	20,800	3.420	71,136.000	
AGRIUM INC	3,100	123.940	384,214.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	25,800	38.940	1,004,652.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	540	598.000	322,920.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,900	62.600	557,140.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,100	123.750	136,125.000	
BLACKBERRY LTD	11,900	15.220	181,118.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	14,250	44.280	630,990.000	
ENBRIDGE INC	38,000	52.730	2,003,740.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	20,750	51.180	1,061,985.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	45,800	23.580	1,079,964.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	7,100	16.900	119,990.000	
GOLDCORP INC	19,959	18.170	362,655.030	
ENCANA CORP	23,100	13.080	302,148.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,200	213.330	682,656.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,500	49.860	124,650.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,200	40.000	208,000.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,950	105.860	1,900,187.000	
CGI GROUP INC - CLASS A	5,000	69.070	345,350.000	
HUSKY ENERGY INC	7,558	15.800	119,416.400	
ONEX CORPORATION	2,000	96.780	193,560.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	9,500	29.000	275,500.000	
FINNING INTERNATIONAL INC	3,900	26.640	103,896.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,400	52.650	179,010.000	
IGM FINANCIAL INC	2,300	40.010	92,023.000	
OPEN TEXT CORP	6,200	44.160	273,792.000	
CI FINANCIAL CORP	5,400	26.880	145,152.000	
SAPUTO INC	5,800	44.640	258,912.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	15,800	10.860	171,588.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,800	64.330	630,434.000	
YAMANA GOLD INC	23,300	3.480	81,084.000	
FORTIS INC	9,200	45.020	414,184.000	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	13,300	11.710	155,743.000	
CENOVUS ENERGY INC	19,600	11.610	227,556.000	
DOLLARAMA INC	2,500	128.640	321,600.000	
ATCO LTD -CLASS I	1,700	51.370	87,329.000	
ALTAGAS LTD	3,900	30.000	117,000.000	

	FIRST CAPITAL REALTY INC	2,600	20.640	53,664.000	
	KEYERA CORP	4,400	41.660	183,304.000	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,900	24.030	93,717.000	
	INTER PIPELINE LTD	8,800	26.730	235,224.000	
	ARC RESOURCES LTD	8,300	17.700	146,910.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 39,332,640.950 (3,219,376,662)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	30,300	23.350	707,505.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	41,500	20.480	849,920.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,470	10.030	125,074.100	
	KEPPEL CORP LTD	34,500	6.500	224,250.000	
	UOL GROUP LTD	13,200	7.080	93,456.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	11,200	10.810	121,072.000	
	CAPITALAND LTD	59,000	3.620	213,580.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	3.240	132,840.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,300	44.300	101,890.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	74,200	10.580	785,036.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	153,000	1.175	179,775.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	188,650	3.810	718,756.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	35,000	3.700	129,500.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	22,700	3.140	71,278.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.365	60,006.000	
	SATS LTD	16,000	5.250	84,000.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	19,000	7.300	138,700.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,800	2.430	113,724.000	
	STARHUB LTD	16,000	2.730	43,680.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	48,500	3.540	171,690.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	69,000	2.920	201,480.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 5,267,212.600 (421,218,993)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFY AG-REG	1,050	163.000	171,150.000	
	UBS GROUP AG-REG	85,500	15.440	1,320,120.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	200	681.500	136,300.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,750	73.050	273,937.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	16,350	264.900	4,331,115.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	800	75.150	60,120.000	
	SIKA AG-BR	50	6,315.000	315,750.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	72,210.000	144,420.000	
	ABB LTD-REG	46,200	24.830	1,147,146.000	
	SWISS RE AG	7,550	88.550	668,552.500	
	NESTLE SA-REG	72,400	82.950	6,005,580.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	420	599.000	251,580.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,000	208.800	208,800.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	46,520	13.360	621,507.200	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,200	49.900	259,480.000	
	SGS SA-REG	130	2,322.000	301,860.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	500	201.700	100,850.000	
	VIFOR PHARMA AG	900	110.900	99,810.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	700	382.500	267,750.000	

ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,522	284.300	1,001,304.600	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,200	148.600	178,320.000	
NOVARTIS AG-REG	51,850	79.400	4,116,890.000	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	50	1,396.000	69,800.000	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	12,200	81.500	994,300.000	
SWISSCOM AG-REG	590	463.100	273,229.000	
GEBERIT AG-REG	850	455.800	387,430.000	
GIVAUDAN-REG	210	2,014.000	422,940.000	
ACTELION LTD-REG	2,250	272.250	612,562.500	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	200	544.500	108,900.000	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,200	161.600	193,920.000	
LONZA GROUP AG-REG	1,750	206.700	361,725.000	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,100	74.900	82,390.000	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	10,490	57.600	604,224.000	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	770	323.300	248,941.000	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,250	157.600	197,000.000	
SWISS PRIME SITE-REG	1,650	89.750	148,087.500	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	5,940.000	136,620.000	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 26,824,411.800 (3,074,614,081)	
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	315.300	599,070.000	
ERICSSON LM-B SHS	71,030	64.050	4,549,471.500	
VOLVO AB-B SHS	35,300	146.900	5,185,570.000	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,500	499.500	749,250.000	
SKF AB-B SHARES	9,450	181.900	1,718,955.000	
ELECTROLUX AB-SER B	5,450	282.000	1,536,900.000	
NORDEA BANK AB	70,850	110.700	7,843,095.000	
SWEDISH MATCH AB	4,550	297.000	1,351,350.000	
TELE2 AB-B SHS	8,950	90.400	809,080.000	
GETINGE AB-B SHS	4,700	184.000	864,800.000	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	34,950	104.500	3,652,275.000	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	35,200	121.200	4,266,240.000	
SWEDBANK AB - A SHARES	20,900	207.600	4,338,840.000	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	21,800	218.600	4,765,480.000	
SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	14,100	303.300	4,276,530.000	
SKANSKA AB-B SHS	7,650	208.900	1,598,085.000	
SANDVIK AB	24,450	138.300	3,381,435.000	
INVESTOR AB-B SHS	10,400	405.700	4,219,280.000	
ATLAS COPCO AB-A SHS	15,700	320.400	5,030,280.000	
SECURITAS AB-B SHS	7,400	144.000	1,065,600.000	
TELIA CO AB	60,000	39.860	2,391,600.000	
ALFA LAVAL AB	7,000	174.500	1,221,500.000	
ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	286.800	2,609,880.000	
ASSA ABLOY AB-B	23,300	195.600	4,557,480.000	
LUNDBERGS AB-B SHS	900	691.000	621,900.000	
LUNDIN PETROLEUM AB	4,200	167.800	704,760.000	
BOLIDEN AB	6,500	238.500	1,550,250.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	9,750	89.900	876,525.000	
KINNEVIK AB - B	5,300	252.400	1,337,720.000	
HEXAGON AB-B SHS	6,200	388.000	2,405,600.000	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,500	209.300	732,550.000	



スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 80,811,351.500 (1,034,385,300)
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	44,550	291.500	12,986,325.000
	DANSKE BANK A/S	15,850	248.200	3,933,970.000
	ISS A/S	3,900	274.500	1,070,550.000
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	85	12,340.000	1,048,900.000
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,200	574.000	2,984,800.000
	TDC A/S	19,300	39.030	753,279.000
	CARLSBERG AS-B	2,450	728.500	1,784,825.000
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,500	306.600	1,686,300.000
	COLOPLAST-B	2,800	580.000	1,624,000.000
	DSV A/S	4,250	406.100	1,725,925.000
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,675	175.200	468,660.000
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	150	12,880.000	1,932,000.000
	TRYG A/S	2,500	137.000	342,500.000
	PANDORA A/S	2,550	626.500	1,597,575.000
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,350	476.300	1,119,305.000
GENMAB A/S	1,300	1,453.000	1,888,900.000	
DONG ENERGY A/S	3,400	292.200	993,480.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 37,941,294.000 (635,137,262)
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	2.900	75,400.000
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.780	199,164.420
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	7.120	166,608.000
	CONTACT ENERGY LTD	13,000	5.160	67,080.000
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	7.730	155,373.000
RYMAN HEALTHCARE LTD	8,800	8.470	74,536.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 738,161.420 (58,248,318)
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	45.340	1,387,404.000
	DNB ASA	22,550	142.400	3,211,120.000
	ORKLA ASA	19,050	85.600	1,630,680.000
	TELENOR ASA	18,000	137.900	2,482,200.000
	STATOIL ASA	25,973	146.300	3,799,849.900
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,500	203.000	304,500.000
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,160	318.900	1,326,624.000
	MARINE HARVEST	8,700	149.000	1,296,300.000
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,850	137.000	664,450.000
SCHIBSTED ASA-B SHS	1,800	187.500	337,500.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 16,440,627.900 (215,701,038)
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ
	BAYER AG-REG	19,150	121.600	2,328,640.000
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,800	31.265	118,807.000
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	47,650	15.590	742,863.500	

COMMERZBANK AG	24,685	9.354	230,903.490	
VOLKSWAGEN AG	800	141.900	113,520.000	
VOLKSWAGEN AG-PREF	4,300	137.550	591,465.000	
MAN SE	850	94.610	80,418.500	
SIEMENS AG-REG	17,700	129.500	2,292,150.000	
E. ON SE	51,700	7.833	404,966.100	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,600	85.930	653,068.000	
GEA GROUP AG	4,200	37.370	156,954.000	
OSRAM LICHT AG	2,160	70.000	151,200.000	
CONTINENTAL AG	2,550	202.000	515,100.000	
BASF SE	21,250	85.310	1,812,837.500	
LINDE AG	4,300	176.500	758,950.000	
K+S AG-REG	4,400	23.065	101,486.000	
ALLIANZ SE-REG	10,650	173.350	1,846,177.500	
THYSSENKRUPP AG	8,500	23.510	199,835.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,100	127.250	521,725.000	
RWE AG	11,800	18.160	214,288.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	5,050	17.785	89,814.250	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	900	75.280	67,752.000	
BRENTAG AG	3,650	53.070	193,705.500	
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,450	76.810	725,854.500	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,700	49.500	133,650.000	
HOCHTIEF AG	500	164.550	82,275.000	
SAP SE	22,742	96.100	2,185,506.200	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,720	177.400	659,928.000	
SCHAEFFLER AG	3,800	15.020	57,076.000	
ZALANDO SE	1,900	43.305	82,279.500	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,500	83.740	293,090.000	
COVESTRO AG	2,100	67.330	141,393.000	
INNOGY SE	3,400	36.840	125,256.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,450	52.580	181,401.000	
BEIERSDORF AG	2,300	96.600	222,180.000	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,500	50.760	76,140.000	
MERCK KGAA	2,950	108.400	319,780.000	
ADIDAS AG	4,410	171.500	756,315.000	
HENKEL AG & CO KGAA	2,400	111.900	268,560.000	
METRO AG	4,100	29.990	122,959.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	75,800	17.380	1,317,404.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,050	86.540	437,027.000	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	22,500	65.840	1,481,400.000	
QIAGEN N.V.	5,248	30.405	159,565.440	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	25,900	20.095	520,460.500	
HANNOVER RUECK SE	1,400	107.050	149,870.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	22,500	32.635	734,287.500	
DEUTSCHE BOERSE AG	4,450	93.610	416,564.500	
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	5,550	38.400	213,120.000	
LANXESS AG	2,200	68.170	149,974.000	
AXEL SPRINGER SE	1,000	57.690	57,690.000	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	8,400	35.580	298,872.000	
SYMRISE AG	3,000	65.190	195,570.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,500	4.475	73,837.500	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,200	73.380	88,056.000	
HUGO BOSS AG -ORD	1,650	68.250	112,612.500	
RTL GROUP	1,000	70.270	70,270.000	

VONOVIA SE	10,900	35.905	391,364.500
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,976	32.060	704,550.560
NN GROUP NV	7,450	32.225	240,076.250
ARCELORMITTAL	14,100	18.825	265,432.500
UNILEVER NV-CVA	37,950	51.090	1,938,865.500
HEINEKEN NV	5,300	88.120	467,036.000
RELX NV	22,719	18.430	418,711.170
AEGON NV	40,744	4.435	180,699.640
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	29,483	19.705	580,962.510
AKZO NOBEL	5,800	75.750	439,350.000
KONINKLIJKE DSM NV	4,100	67.130	275,233.000
WOLTERS KLUWER	6,900	38.915	268,513.500
BOSKALIS WESTMINSTER	2,100	30.400	63,840.000
ING GROEP NV	90,350	14.930	1,348,925.500
KONINKLIJKE KPN NV	78,250	3.052	238,819.000
ASML HOLDING NV	8,600	118.950	1,022,970.000
ABN AMRO GROUP NV-CVA	6,600	22.845	150,777.000
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,200	36.505	189,826.000
VOPAK	1,600	40.675	65,080.000
RANDSTAD HOLDING NV	2,600	52.280	135,928.000
HEINEKEN HOLDING NV	2,300	83.730	192,579.000
GEMALTO	2,000	52.750	105,500.000
ALTICE NV - A	8,400	22.625	190,050.000
ALTICE NV - B	2,900	22.635	65,641.500
JCDECAUX SA	1,600	30.270	48,432.000
TOTAL SA	52,850	46.800	2,473,380.000
MICHELIN (CGDE)	4,250	116.550	495,337.500
AIR LIQUIDE SA	9,048	111.100	1,005,232.800
KERING	1,800	299.850	539,730.000
SCHNEIDER ELECTRIC SE	13,200	69.620	918,984.000
BOUYGUES SA	5,000	38.380	191,900.000
BNP PARIBAS	25,850	63.400	1,638,890.000
PEUGEOT SA	11,250	17.910	201,487.500
NATIXIS	22,950	5.963	136,850.850
THALES SA	2,550	99.150	252,832.500
DANONE	13,850	67.320	932,382.000
CARREFOUR SA	12,800	23.405	299,584.000
SUEZ	7,475	16.205	121,132.370
VIVENDI	23,741	19.920	472,920.720
L' OREAL	5,850	192.900	1,128,465.000
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	11,500	50.000	575,000.000
LEGRAND SA	6,067	60.750	368,570.250
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,300	54.850	71,305.000
PERNOD RICARD SA	4,917	122.500	602,332.500
SOCIETE BIC SA	700	110.500	77,350.000
EURAZEO	866	64.240	55,631.840
REXEL SA	7,050	15.955	112,482.750
SOCIETE GENERALE SA	18,000	47.300	851,400.000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,440	231.450	1,490,538.000
ACCOR SA	4,000	43.350	173,400.000
CAPGEMINI	3,750	93.860	351,975.000
VALEO SA	5,650	64.580	364,877.000
PUBLICIS GROUPE	4,350	68.310	297,148.500
BUREAU VERITAS SA	6,050	20.615	124,720.750

EIFFAGE	1,300	81.660	106,158.000	
SODEXO SA	2,150	123.250	264,987.500	
IPSEN	900	121.100	108,990.000	
INGENICO GROUP	1,350	86.810	117,193.500	
ZODIAC AEROSPACE	4,800	23.600	113,280.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	270	492.250	132,907.500	
SEB SA	500	160.450	80,225.000	
ESSILOR INTERNATIONAL	4,750	119.200	566,200.000	
DASSAULT AVIATION SA	60	1,356.100	81,366.000	
AXA SA	45,500	23.885	1,086,767.500	
CHRISTIAN DIOR SE	1,300	256.500	333,450.000	
LAGARDERE SCA	2,650	28.305	75,008.250	
EDENRED	4,750	23.450	111,387.500	
RENAULT SA	4,400	85.210	374,924.000	
HERMES INTERNATIONAL	620	449.450	278,659.000	
STMICROELECTRONICS NV	15,300	14.730	225,369.000	
REMY COINTREAU	550	98.320	54,076.000	
ATOS SE	2,150	130.600	280,790.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,050	83.690	255,254.500	
WENDEL	600	136.700	82,020.000	
ORANGE	46,800	15.550	727,740.000	
ALSTOM	3,650	31.370	114,500.500	
CNP ASSURANCES	3,750	19.795	74,231.250	
SANOFI	26,775	88.870	2,379,494.250	
VINCI SA	11,900	78.090	929,271.000	
AIRBUS SE	13,550	75.600	1,024,380.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,450	19.365	221,729.250	
CREDIT AGRICOLE SA	25,700	13.790	354,403.000	
ENGIE	37,173	13.500	501,835.500	
IMERYS SA	900	78.670	70,803.000	
EDF	12,750	9.723	123,968.250	
SES	8,350	22.965	191,757.750	
SAFRAN SA	7,200	79.780	574,416.000	
ILIAD SA	600	230.800	138,480.000	
ARKEMA	1,550	95.760	148,428.000	
ADP	750	140.450	105,337.500	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	24.005	97,220.250	
SCOR SE	3,650	35.430	129,319.500	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	10,450	10.700	111,815.000	
BOLLORE	19,000	4.148	78,812.000	
UCB SA	2,750	63.930	175,807.500	
KBC GROEP NV	5,800	66.100	383,380.000	
COLRUYT SA	1,600	49.715	79,544.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,850	87.120	161,172.000	
SOLVAY SA	1,700	118.050	200,685.000	
UMICORE	2,250	61.620	138,645.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	17,700	104.900	1,856,730.000	
AGEAS	4,490	36.265	162,829.850	
PROXIMUS	3,500	32.495	113,732.500	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,200	60.010	72,012.000	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	21,750	2.020	43,935.000	
PRYSMIAN SPA	4,800	25.680	123,264.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	29,043	14.050	408,054.150	
SAIPEM SPA	13,430	3.574	47,998.820	

MEDIOBANCA SPA	13,015	8.410	109,456.150
TENARIS SA	10,550	13.560	143,058.000
UNICREDIT SPA	43,956	15.490	680,878.440
TELECOM ITALIA SPA	266,282	0.838	223,144.310
TELECOM ITALIA-RSP	134,950	0.683	92,238.320
INTESA SANPAOLO-RSP	21,000	2.426	50,946.000
INTESA SANPAOLO	293,897	2.590	761,193.230
ATLANTIA SPA	10,607	26.040	276,206.280
POSTE ITALIANE SPA	11,800	6.335	74,753.000
RECORDATI SPA	2,600	37.900	98,540.000
ENI SPA	58,800	14.050	826,140.000
LEONARDO SPA	9,525	15.810	150,590.250
ENEL SPA	187,834	4.730	888,454.820
SNAM SPA	58,200	4.118	239,667.600
LUXOTTICA GROUP SPA	3,850	54.150	208,477.500
TERNA SPA	35,400	5.075	179,655.000
EXOR NV	2,500	50.750	126,875.000
CNH INDUSTRIAL NV	24,300	9.935	241,420.500
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	25,050	9.780	244,989.000
FERRARI NV	2,835	80.250	227,508.750
TELEFONICA SA	104,627	10.015	1,047,839.400
ENDESA SA	7,650	22.045	168,644.250
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	153,712	7.239	1,112,721.160
IBERDROLA SA	132,934	7.147	950,079.290
BANCO DE SABADELL SA	122,909	1.819	223,571.470
BANKINTER SA	15,100	8.191	123,684.100
REPSOL SA	25,800	14.820	382,356.000
GRIFOLS SA	6,700	25.370	169,979.000
BANCO SANTANDER SA	336,550	5.820	1,958,721.000
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	14,900	16.350	243,615.000
AMADEUS IT GROUP SA	10,100	52.620	531,462.000
GAS NATURAL SDG SA	8,450	22.185	187,463.250
MAPFRE SA	25,450	3.193	81,261.850
CAIXABANK S. A	81,600	4.124	336,518.400
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	20,100	6.956	139,815.600
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,376	35.615	191,466.240
AENA SA	1,600	182.550	292,080.000
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	25,300	36.665	927,624.500
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	5,600	19.920	111,552.000
ENAGAS SA	5,400	26.545	143,343.000
RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,000	20.175	201,750.000
FERROVIAL SA	11,700	20.350	238,095.000
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	15,700	5.516	86,601.200
BANKIA SA	108,422	1.029	111,566.230
UPM-KYMMENE OYJ	12,400	25.410	315,084.000
NOKIA OYJ	134,150	5.830	782,094.500
WARTSILA OYJ ABP	3,200	54.250	173,600.000
STORA ENSO OYJ-R SHS	13,100	11.350	148,685.000
METSO OYJ	2,400	30.930	74,232.000
ELISA OYJ	3,250	35.230	114,497.500
SAMPO OYJ-A SHS	10,300	45.630	469,989.000
FORTUM OYJ	10,450	14.470	151,211.500
KONE OYJ-B	7,850	44.610	350,188.500
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,650	36.830	97,599.500

	NESTE OYJ	2,950	35.440	104,548.000	
	ORION OYJ-CLASS B	2,450	58.200	142,590.000	
	OMV AG	3,550	46.455	164,915.250	
	ERSTE GROUP BANK AG	6,650	32.720	217,588.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	39.330	112,090.500	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	2,400	23.440	56,256.000	
	ANDRITZ AG	1,600	54.260	86,816.000	
	BANK OF IRELAND	661,800	0.239	158,170.200	
	JERONIMO MARTINS	6,000	17.600	105,600.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,500	3.240	160,380.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	11,650	13.720	159,838.000	
	KERRY GROUP PLC-A	3,850	79.520	306,152.000	
	CRH PLC	19,400	32.440	629,336.000	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	1,900	97.850	185,915.000	
ユーロ 小計				ユーロ 91,279,978.050 (11,368,008,467)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	33,000	71.300	2,352,900.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	55,000	45.350	2,494,250.000	
	MTR CORP	34,500	44.300	1,528,350.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	34,000	118.300	4,022,200.000	
	SINO LAND CO	74,000	13.660	1,010,840.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	63,169	101.900	6,436,921.100	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	68.400	2,188,800.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	12,500	77.600	970,000.000	
	FIRST PACIFIC CO	56,000	6.140	343,840.000	
	CLP HOLDINGS LTD	37,500	84.650	3,174,375.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	25,386	51.450	1,306,109.700	
	HANG LUNG GROUP LTD	21,000	33.350	700,350.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	181,142	16.700	3,025,071.400	
	HANG SENG BANK LTD	17,900	165.000	2,953,500.000	
	WHEELOK & CO LTD	20,000	60.250	1,205,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	131,000	9.990	1,308,690.000	
	WH GROUP LTD	185,000	7.390	1,367,150.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	27,300	205.000	5,596,500.000	
	LI & FUNG LTD	132,000	3.230	426,360.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	52,000	20.650	1,073,800.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	5,800	116.500	675,700.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	16,500	32.300	532,950.000	
	NWS HOLDINGS LTD	35,500	15.100	536,050.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	18,000	27.050	486,900.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	29,040	33.000	958,320.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	14,000	36.350	508,900.000	
	SJM HOLDINGS LTD	47,000	7.600	357,200.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	30,000	26.500	795,000.000	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	61,669	59.650	3,678,555.850	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	68.350	1,025,250.000	
	PCCW LTD	95,000	4.550	432,250.000	
	AIA GROUP LTD	281,200	55.350	15,564,420.000	
	SANDS CHINA LTD	57,200	35.100	2,007,720.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	12.880	386,400.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	31,500	36.400	1,146,600.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	20,000	17.000	340,000.000	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	87,500	35.400	3,097,500.000	
	WYNN MACAU LTD	38,000	17.880	679,440.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	87,000	10.340	899,580.000	
香港・ドル	小計			香港・ドル 77,593,743.050 (1,100,279,277)	
合計				83,703,926,393 [83,703,926,393]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,097	605,897.080	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,087	1,081,759.680	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,550	434,378.000	
		GGP INC	12,800	287,872.000	
		VORNADO REALTY TRUST	3,827	355,413.490	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,750	381,397.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,200	547,104.000	
		EQUINIX INC	1,758	781,114.560	
		AMERICAN TOWER CORP	9,750	1,291,777.500	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	17,293	314,213.810	
		KIMCO REALTY CORP	10,000	176,000.000	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	12,000	172,680.000	
		VENTAS INC	7,900	530,090.000	
		WEYERHAEUSER CO	16,814	563,437.140	
		AGNC INVESTMENT CORP	7,800	162,630.000	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,900	125,166.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	8,250	862,867.500	
		IRON MOUNTAIN INC	5,610	197,808.600	
		VEREIT INC	22,300	186,428.000	
		PROLOGIS INC	11,912	677,554.560	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,900	228,076.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,000	169,300.000	
		DUKE REALTY CORP	8,000	233,440.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,480	388,692.400	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,600	197,392.000	
		WELLTOWER INC	8,400	619,836.000	
		HCP INC	10,700	341,330.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	138,798.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,600	271,154.000	
		MACERICH CO/THE	2,700	156,060.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23,200	279,096.000	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3,400	132,090.000	
		REALTY INCOME CORP	6,000	339,480.000	
PUBLIC STORAGE	3,350	716,632.000			
REGENCY CENTERS CORP	3,500	213,185.000			
SL GREEN REALTY CORP	2,250	232,447.500			
UDR INC	6,300	247,905.000			
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,700	443,149.000			
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,750	210,265.000			
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 15,293,917.320 (1,689,824,925)	

イギリス・ポンド			イギリス・ポンド
	LAND SECURITIES GROUP PLC	18,200	195,468.000
	SEGRO PLC	23,750	118,987.500
	HAMMERSON PLC	19,200	112,608.000
	BRITISH LAND CO PLC	22,100	139,230.000
	INTU PROPERTIES PLC	21,100	57,370.900
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 623,664.400 (88,660,131)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	SCENTRE GROUP	122,222	531,665.700
	DEXUS	23,950	251,235.500
	GPT GROUP	44,060	234,399.200
	MIRVAC GROUP	84,400	192,432.000
	STOCKLAND	57,000	273,600.000
	WESTFIELD CORP	45,496	392,630.480
	GOODMAN GROUP	41,700	359,454.000
	VICINITY CENTRES	82,873	233,701.860
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 2,469,118.740 (202,566,501)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1,500	47,865.000
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,000	69,060.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,300	84,282.000
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 201,207.000 (16,468,793)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	46,000	76,360.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	57,400	154,406.000
	CAPITALAND MALL TRUST	63,200	123,556.000
	SUNTEC REIT	53,000	97,520.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 451,842.000 (36,133,804)
ユーロ			ユーロ
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,350	554,952.500
	ICADE	900	67,410.000
	GECINA SA	950	132,050.000
	KLEPIERRE	5,200	198,276.000
	FONCIERE DES REGIONS	750	63,697.500
ユーロ 小計			ユーロ 1,016,386.000 (126,580,713)
香港・ドル	LINK REIT	52,000	香港・ドル 3,224,000.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 3,224,000.000 (45,716,320)
投資証券 合計			2,205,951,187 [2,205,951,187]



合計		2,205,951,187 [2,205,951,187]
----	--	----------------------------------

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 598 銘柄 投資証券 39 銘柄	97.0%	3.0%	64.8%
イギリス・ポンド	株式 104 銘柄 投資証券 5 銘柄	98.6%	1.4%	7.4%
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 61 銘柄 投資証券 8 銘柄	91.6%	8.4%	2.8%
カナダ・ドル	株式 91 銘柄 投資証券 3 銘柄	99.5%	0.5%	3.8%
シンガポール・ドル	株式 21 銘柄 投資証券 4 銘柄	92.1%	7.9%	0.5%
スイス・フラン	株式 37 銘柄	100%	-%	3.6%
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 17 銘柄	100%	-%	0.7%
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 投資証券 5 銘柄	98.9%	1.1%	13.4%
香港・ドル	株式 39 銘柄 投資証券 1 銘柄	96.0%	4.0%	1.3%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

「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28年6月6日現在	平成29年6月5日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,979,015,915	3,149,181,340
コール・ローン	1,585,796,185	576,721,511
国債証券	149,390,204,925	158,442,056,917
派生商品評価勘定	43,199	1,106,529
未収入金	—	741,508
未収利息	1,177,128,921	1,175,416,358
前払費用	24,940,253	26,138,159
流動資産合計	156,157,129,398	163,371,362,322
資産合計	156,157,129,398	163,371,362,322
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	47,444,219	554,739
未払金	3,840,983,255	3,008,550,685
未払解約金	86,846,093	177,851,692
その他未払費用	3,328	276
流動負債合計	3,975,276,895	3,186,957,392
負債合計	3,975,276,895	3,186,957,392
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	57,896,260,148	59,593,264,615
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	94,285,592,355	100,591,140,315
元本等合計	152,181,852,503	160,184,404,930
純資産合計	152,181,852,503	160,184,404,930
負債純資産合計	156,157,129,398	163,371,362,322

## 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 6 月 7 日 至 平成 29 年 6 月 5 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 28 年 6 月 6 日現在	平成 29 年 6 月 5 日現在
1. ※1 期首	平成 27 年 6 月 6 日	平成 28 年 6 月 7 日
期首元本額	57,624,910,904 円	57,896,260,148 円
期中追加設定元本額	5,315,126,820 円	6,024,834,970 円
期中一部解約元本額	5,043,777,576 円	4,327,830,503 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	1,556,099,713 円	1,121,999,580 円

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	56,570,512円	38,357,642円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	372,622,957円	271,295,240円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	86,576,167円	70,424,743円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	1,214,159,110円	961,339,342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)	－円	178,399,112円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス (為替ヘ ジ なし)	－円	502,056,453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 ジ なし)	－円	149,456,114円
D-I's 外国債券インデッ ク ス	840,107円	868,793円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー 2050	18,731円	21,393円
iFree 外国債券インデ ク ス	－円	424,519,500円
iFree 8資産バランス	－円	147,385,312円
DCダイワ外国債券インデッ ク ス	36,880,147,740円	38,859,442,774円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	547,312,449円	621,053,332円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	238,646,478円	277,971,494円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	144,490,878円	172,143,457円
DCダイワ・ワールドアセッ ト (六つの羽/安定コース)	233,333,046円	255,376,513円
DCダイワ・ワールドアセッ ト (六つの羽/6分散コース)	188,988,273円	210,564,326円
DCダイワ・ワールドアセッ ト (六つの羽/成長コース)	55,572,036円	62,885,717円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー 2020	12,252,582円	13,236,426円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー 2030	14,037,885円	18,914,253円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー 2040	753,022円	1,223,472円
ダイワ世界バランスファン ド 40VA	1,767,767,582円	1,230,894,283円

ダイワ世界バランスファンド 60VA	193,202,410円	184,369,286円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	7,396,651,932円	6,797,417,527円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	530,993,354円	483,217,750円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	338,464,832円	297,951,841円
ダイワ・バランスファンド2 5VA (適格機関投資家専用)	400,591,569円	383,566,822円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	88,851,615円	116,718,180円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	4,742,492円	13,203,244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)	－円	376,292円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,475,477,658円	5,619,835,473円
ダイワライフスタイル25	32,957,814円	34,306,945円
ダイワライフスタイル50	51,124,584円	57,267,550円
ダイワライフスタイル75	13,012,620円	15,204,434円
計	57,896,260,148円	59,593,264,615円
2. 期末日における受益権の総数	57,896,260,148口	59,593,264,615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6月7日 至 平成29年6月5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 6 月 5 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 28 年 6 月 6 日現在	平成 29 年 6 月 5 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	2,986,566,534	119,455,545
合計	2,986,566,534	119,455,545

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間 (平成 27 年 12 月 1 日から平成 28 年 6 月 6 日まで、及び平成 28 年 12 月 1 日から平成 29 年 6 月 5 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 28 年 6 月 6 日 現在			平成 29 年 6 月 5 日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	1,453,365,870	—	1,405,964,850	△47,401,020	339,571,320	—	340,123,110	551,790
アメリカ・ドル	631,322,197	—	606,168,320	△25,153,877	119,486,842	—	119,067,650	△419,192
イギリス・ポンド	122,119,249	—	115,542,960	△6,576,289	31,497,870	—	31,546,200	48,330
オーストラリア・ドル	28,348,957	—	27,565,980	△782,977	18,346,705	—	18,259,240	△87,465
カナダ・ドル	31,640,732	—	30,608,380	△1,032,352	7,490,972	—	7,442,890	△48,082
シンガポール・ドル	5,617,248	—	5,478,900	△138,348	—	—	—	—
スイス・フラン	4,368,093	—	4,254,510	△113,583	—	—	—	—
スウェーデン・クローナ	7,859,686	—	7,717,200	△142,486	—	—	—	—

デンマーク・ クローネ	10,747,140	—	10,507,280	△239,860	1,665,518	—	1,674,000	8,482
ノルウェー・ クローネ	3,943,974	—	3,882,940	△61,034	1,179,181	—	1,179,900	719
ポーランド・ ズロチ	9,338,493	—	9,130,000	△208,493	—	—	—	—
メキシコ・ペソ	14,545,340	—	13,849,460	△695,880	—	—	—	—
ユーロ	576,956,960	—	564,657,920	△12,299,040	148,551,292	—	149,359,430	808,138
南アフリカ・ ランド	6,557,801	—	6,601,000	43,199	11,352,940	—	11,593,800	240,860
合計	1,453,365,870	—	1,405,964,850	△47,401,020	339,571,320	—	340,123,110	551,790

(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28年6月6日現在	平成29年6月5日現在
1口当たり純資産額	2.6285円	2.6880円
(1万口当たり純資産額)	(26,285円)	(26,880円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		4% United States Treasury Note/Bond 20180815	3,173,000.000	3,277,709.000	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,488,000.000	2,577,194.800	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	3,161,000.000	3,240,878.470	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,096,000.000	3,206,155.680	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,621,000.000	2,751,840.320	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,215,171.000	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	4,280,000.000	4,533,247.600	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,256,765.400	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,955,202.840	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,676,283.900	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,377,542.480	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,698,473.310	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20180531	1,322,000.000	1,337,123.680	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,065,000.000	1,078,142.100	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,341,000.000	1,356,756.750	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,584,477.280	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20180831	3,444,000.000	3,455,812.920	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20180930	2,835,000.000	2,840,301.450	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	1,320,000.000	1,329,424.800	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,184,950.520	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,165,000.000	2,169,481.550	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,861,000.000	1,864,405.630	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,426,000.000	1,425,657.760	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,270,070.960	



1.375% United States Treasury Note/Bond 20190228	1,843,000.000	1,846,372.690	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190331	300,000.000	301,230.000	
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	2,462,442.600	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,377,630.350	
1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,360,024.560	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,784,000.000	1,767,747.760	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,525,504.160	
1% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,872,000.000	1,859,120.640	
1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,198,896.950	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	882,444.160	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,138,791.040	
1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,341,945.990	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,883,412.540	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,366,368.820	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,390,759.500	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,961,151.360	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,151,253.600	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,654,594.350	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,439,319.450	
1% United States Treasury Note/Bond 20180531	3,407,000.000	3,400,322.280	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,456,373.320	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,693,000.000	1,695,895.030	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,158,383.350	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,873,136.640	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,697,000.000	1,699,783.080	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	2,768,000.000	2,867,675.680	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	2,032,999.510	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,915,763.200	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181031	3,611,000.000	3,611,541.650	

1. 75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,364,416.600	
2. 75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,276,719.530	
1. 25% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,638,000.000	2,638,712.260	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,541,441.170	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20181231	2,026,000.000	2,033,435.420	
2. 375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,064,755.740	
2. 75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,493,273.660	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20190131	2,185,000.000	2,193,696.300	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,680,318.810	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,373,000.000	2,382,444.540	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,761,362.520	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20190331	2,383,000.000	2,398,251.200	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,891,073.640	
2. 5% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,412,000.000	5,599,688.160	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20190430	2,975,000.000	2,994,516.000	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,466,404.760	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,241,000.000	2,250,344.970	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,773,826.920	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2,885,000.000	2,904,156.400	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,553,062.050	
8. 875% United States Treasury Note/Bond 20190215	904,000.000	1,021,194.560	
8. 125% United States Treasury Note/Bond 20190815	724,000.000	830,478.680	
8. 75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	787,252.500	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,676,262.680	
6. 25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	821,587.500	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,120,776.750	
6. 5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	864,819.900	
6. 125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	969,110.830	
5. 5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	925,911.000	
5. 25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	961,008.840	

5. 25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	618,225.190	
6. 25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,392,594.400	
5. 375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,241,000.000	1,691,433.360	
4. 5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,926,000.000	2,512,216.620	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	759,044.550	
4. 375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	706,059.640	
4. 5% United States Treasury Note/Bond 20380515	1,019,000.000	1,335,205.890	
3. 5% United States Treasury Note/Bond 20390215	849,000.000	968,318.460	
4. 25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,417,616.600	
4. 5% United States Treasury Note/Bond 20390815	760,000.000	993,282.000	
4. 375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,555,128.300	
4. 625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,274,830.100	
4. 375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,902,112.100	
3. 875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,908,324.950	
4. 25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,860,121.250	
4. 75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,381,739.060	
4. 375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,762,228.650	
3. 75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,611,241.890	
3. 125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,545,265.000	
3. 125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,728,868.290	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,853,000.000	1,928,991.530	
2. 75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,720,717.860	
2. 75% United States Treasury Note/Bond 20421115	3,030,000.000	3,010,092.900	
3. 125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,026,000.000	2,153,090.980	
2. 875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,998,000.000	4,057,650.160	
3. 625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,314,000.000	3,834,894.520	
3. 75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,233,673.060	
3. 625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,191,198.750	
3. 375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,065,816.030	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,348,583.540	

2. 25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2, 834, 000. 000	2, 903, 064. 580	
2. 375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5, 662, 000. 000	5, 806, 607. 480	
3. 125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3, 729, 000. 000	3, 964, 672. 800	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20190831	2, 989, 000. 000	3, 009, 414. 870	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1, 301, 000. 000	1, 319, 591. 290	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3, 404, 000. 000	3, 436, 678. 400	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3, 625, 000. 000	3, 694, 926. 250	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3, 190, 000. 000	3, 202, 951. 400	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2, 163, 000. 000	2, 193, 411. 780	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5, 921, 000. 000	6, 013, 959. 700	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3, 696, 000. 000	3, 837, 187. 200	
1. 875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2, 886, 000. 000	2, 911, 021. 620	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4, 325, 000. 000	4, 340, 699. 750	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3, 169, 000. 000	3, 230, 383. 530	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2, 204, 000. 000	2, 218, 965. 160	
1. 25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3, 963, 000. 000	3, 950, 278. 770	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2, 427, 000. 000	2, 405, 375. 430	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5, 743, 000. 000	5, 722, 325. 200	
2. 5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3, 763, 000. 000	3, 531, 914. 170	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2, 788, 000. 000	2, 786, 689. 640	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1, 809, 000. 000	1, 812, 527. 550	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2, 792, 000. 000	2, 790, 017. 680	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2, 891, 000. 000	2, 895, 047. 400	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5, 788, 000. 000	5, 810, 573. 200	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	4, 035, 000. 000	4, 182, 842. 400	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2, 607, 000. 000	2, 603, 741. 250	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2, 612, 000. 000	2, 614, 638. 120	
1. 875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2, 826, 000. 000	2, 846, 064. 600	
1. 5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3, 013, 000. 000	3, 018, 393. 270	
1. 125% United States Treasury Note/Bond 20180615	2, 196, 000. 000	2, 194, 177. 320	

1. 625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	3,016,005.000	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,872,567.880	
0. 875% United States Treasury Note/Bond 20180715	2,189,000.000	2,181,119.600	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,149,421.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,204,690.410	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	6,143,000.000	6,100,244.720	
2. 875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,614,303.880	
1% United States Treasury Note/Bond 20180815	14,000.000	13,964.440	
1. 875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,457,982.950	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,857,445.760	
1% United States Treasury Note/Bond 20180915	2,179,000.000	2,173,116.700	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,468,118.960	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,864,064.600	
0. 875% United States Treasury Note/Bond 20181015	2,057,000.000	2,047,105.830	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,906,576.000	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,101,136.680	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,843,710.880	
1. 875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,568,973.820	
1. 25% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,138,000.000	2,138,406.220	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,105,907.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	2,687,000.000	2,714,488.010	
1. 25% United States Treasury Note/Bond 20181215	2,151,000.000	2,151,580.770	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,064,605.300	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20221231	2,492,000.000	2,533,267.520	
1. 125% United States Treasury Note/Bond 20190115	2,146,000.000	2,141,879.680	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,105,462.180	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,155,545.480	
0. 75% United States Treasury Note/Bond 20190215	2,065,000.000	2,047,798.550	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,550,781.610	
2. 5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,208,368.040	

1% United States Treasury Note/Bond 20190315	2,100,000.000	2,090,550.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,254,964.030	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,262,000.000	2,220,628.020	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,964,475.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,082,344.550	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190415	1,905,000.000	1,890,769.650	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,029,000.000	5,778,856.790	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,429,689.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,042,986.500	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,201,566.130	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190515	2,507,000.000	2,487,495.540	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180531	4,000,000.000	3,987,320.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,675,295.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,465,800.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190615	2,100,000.000	2,082,507.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,000,000.000	993,860.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,451,150.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,913,510.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190715	2,500,000.000	2,471,375.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,297,656.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,078,408.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,500,000.000	2,470,200.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180831	2,200,000.000	2,187,526.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,621,634.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,770,000.000	1,760,512.800	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,623,965.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,677,473.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,327,040.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190915	2,600,000.000	2,574,286.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180930	3,000,000.000	2,981,340.000	

1. 375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,426,518.350	
1. 125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,974,498.020	
1% United States Treasury Note/Bond 20191015	2,147,000.000	2,130,639.860	
0. 75% United States Treasury Note/Bond 20181031	2,326,000.000	2,310,276.240	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,425,640.000	
1. 25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,946,780.000	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,457,800.000	
2. 875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,650,000.000	3,690,478.500	
1% United States Treasury Note/Bond 20191115	1,400,000.000	1,388,562.000	
1% United States Treasury Note/Bond 20181130	1,000,000.000	996,520.000	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,522,270.400	
1. 75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,408,232.000	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20191215	1,440,000.000	1,440,950.400	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	2,027,180.000	
1. 25% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,400,000.000	1,400,154.000	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,549,400.000	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20200115	1,500,000.000	1,500,405.000	
1. 125% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,700,000.000	1,696,345.000	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20270215	4,040,000.000	4,069,007.200	
1. 875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,033,267.300	
2. 25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,528,037.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,875,000.000	4,018,491.250	
1. 375% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,130,000.000	2,129,574.000	
1. 125% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,300,000.000	2,294,687.000	
1. 875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,033,959.600	
2. 125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,325,691.000	
1. 625% United States Treasury Note/Bond 20200315	1,900,000.000	1,911,799.000	
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	5,054,250.000	
1. 875% United States Treasury Note/Bond 20220331	900,000.000	906,606.000	

	1.5% United States Treasury Note/Bond 20200415	850,000.000	852,023.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	2,000,000.000	2,038,280.000	
	3% United States Treasury Note/Bond 20470515	300,000.000	311,319.000	
	1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,021,540.000	
	2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,007,020.000	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	4,000,000.000	4,009,200.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,004,680.000	
	1.25% United States Treasury Note/Bond 20190531	4,000,000.000	3,996,680.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 630,931,425.980 (69,711,613,256)	
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	2,409,048.000	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	2,121,000.000	2,316,980.400	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,588,712.700	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,182,000.000	1,568,395.800	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,175,000.000	1,228,227.500	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	60,000.000	60,030.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	460,000.000	438,518.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	200,000.000	201,700.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	350,000.000	367,955.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	210,000.000	212,562.000	
	8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,444,060.800	
	6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,449,312.800	
	4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,590,000.000	2,189,589.000	
	5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,942,598.400	
	4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,897,632.000	
	4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,265,780.700	
	4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,943,982.400	
	4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	3,017,182.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,302,763.800	



	4. 25% United Kingdom Gilt 20271207	1, 232, 000. 000	1, 624, 022. 400	
	4. 5% United Kingdom Gilt 20421207	1, 666, 000. 000	2, 620, 618. 000	
	4. 75% United Kingdom Gilt 20301207	1, 590, 000. 000	2, 264, 796. 000	
	4. 25% United Kingdom Gilt 20491207	1, 373, 000. 000	2, 257, 898. 500	
	4. 5% United Kingdom Gilt 20190307	1, 573, 000. 000	1, 694, 592. 900	
	4. 25% United Kingdom Gilt 20390907	1, 246, 000. 000	1, 830, 374. 000	
	4% United Kingdom Gilt 20220307	1, 232, 000. 000	1, 444, 643. 200	
	4. 5% United Kingdom Gilt 20340907	1, 870, 000. 000	2, 701, 215. 000	
	3. 75% United Kingdom Gilt 20190907	1, 428, 000. 000	1, 545, 952. 800	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1, 244, 000. 000	2, 190, 684. 000	
	3. 75% United Kingdom Gilt 20200907	1, 795, 000. 000	2, 004, 835. 500	
	4. 25% United Kingdom Gilt 20401207	1, 577, 000. 000	2, 346, 733. 700	
	3. 75% United Kingdom Gilt 20210907	1, 633, 000. 000	1, 873, 214. 300	
	3. 75% United Kingdom Gilt 20520722	1, 352, 000. 000	2, 118, 854. 400	
	1. 75% United Kingdom Gilt 20220907	2, 242, 000. 000	2, 391, 765. 600	
	3. 25% United Kingdom Gilt 20440122	2, 156, 000. 000	2, 839, 020. 800	
	1. 25% United Kingdom Gilt 20180722	2, 854, 000. 000	2, 889, 960. 400	
	2. 25% United Kingdom Gilt 20230907	1, 942, 000. 000	2, 137, 753. 600	
	3. 5% United Kingdom Gilt 20680722	1, 621, 000. 000	2, 747, 432. 900	
	1. 75% United Kingdom Gilt 20190722	2, 251, 000. 000	2, 329, 334. 800	
	2. 75% United Kingdom Gilt 20240907	1, 842, 000. 000	2, 105, 590. 200	
	3. 5% United Kingdom Gilt 20450122	2, 124, 000. 000	2, 939, 403. 600	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 80, 743, 727. 900 (11, 478, 528, 358)	
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, 612, 365. 500	
	5. 75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2, 420, 000. 000	2, 782, 467. 600	
	4. 5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2, 409, 000. 000	2, 599, 166. 460	
	5. 75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2, 162, 000. 000	2, 561, 580. 840	
	5. 5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2, 068, 000. 000	2, 462, 388. 280	

	4. 75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,118,217.490	
	2. 75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,562,794.630	
	3. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,314,000.000	1,404,311.220	
	3. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,565,068.660	
	4. 5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,108,000.000	1,347,682.560	
	3. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20181021	1,197,000.000	1,224,519.030	
	4. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,277,449.920	
	2. 75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	2,011,000.000	2,064,170.840	
	3. 75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	863,000.000	951,181.340	
	2. 75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	538,841.800	
	1. 75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,194,780.500	
	3. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	412,000.000	417,574.360	
	2. 75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,142,000.000	2,196,278.280	
	2. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,278,000.000	1,245,091.500	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	682,000.000	632,964.200	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	700,000.000	703,661.000	
	2. 75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,200,000.000	1,224,192.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 40,686,748.010 (3,337,940,807)	
カナダ・ドル	2. 75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 325,000.000	カナダ・ドル 401,531.000	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	623,135.240	
	5. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,429,311.490	
	5. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,745,948.400	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,192,000.000	1,793,256.720	
	4. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	969,000.000	1,003,263.840	
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1,524,000.000	1,615,668.600	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,872,652.960	
	3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,476,000.000	1,595,334.600	
	3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	1,045,902.240	

	2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,351,000.000	1,469,752.900	
	3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	2,049,140.310	
	1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,287,231.960	
	1. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180901	1,021,000.000	1,028,473.720	
	2. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,535,173.250	
	1. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190301	853,000.000	868,993.750	
	1. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,627,000.000	1,664,795.210	
	2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,047,000.000	1,225,618.200	
	2. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,247,809.520	
	1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,719,000.000	1,754,256.690	
	0. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	931,000.000	929,677.980	
	1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,148,780.080	
	0. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,237,000.000	1,233,152.930	
	0. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,472,422.400	
	0. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180801	1,344,000.000	1,341,688.320	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,040,000.000	1,001,364.000	
	0. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20181101	1,470,000.000	1,466,942.400	
	0. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840,000.000	823,620.000	
	0. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190201	1,620,000.000	1,615,739.400	
	0. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190501	900,000.000	901,035.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	200,000.000	200,260.000	
	0. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190801	460,000.000	460,308.200	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 39,852,241.310 (3,261,905,951)	
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	508,528.700	
	3. 25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	738,177.600	
	3. 5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	867,635.360	
	3. 125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	470,412.000	
	2. 5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	599,000.000	614,052.870	

	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	503,000.000	540,473.500	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	385,411.630	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	509,008.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	427,800.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	518,496.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	238,000.000	272,748.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	134,312.500	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	415,000.000	418,527.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	124,000.000	127,782.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	228,636.800	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	228,000.000	243,882.480	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	252,500.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	190,000.000	188,347.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	201,640.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	150,000.000	148,669.500	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 7,797,041.940 (623,529,444)	
スイス・フラン	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	スイス・フラン 404,000.000	スイス・フラン 511,080.200	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	497,000.000	721,032.690	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	517,000.000	556,457.440	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	407,000.000	446,316.200	
	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	362,000.000	401,266.140	
	スイス・フラン 小計		スイス・フラン 2,636,152.670 (302,155,819)	
スウェーデン・ク ローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	スウェーデン・クローナ 9,095,000.000	スウェーデン・クローナ 10,849,607.400	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	8,385,000.000	9,128,414.100	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,789,410.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	10,033,649.150	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,684,647.500	

	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,895,000.000	6,951,560.850	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	5,986,265.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,950,000.000	2,993,660.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 59,417,215.400 (760,540,358)	
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	19,421,549.840	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	9,542,637.480	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	8,050,000.000	9,244,620.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,326,093.220	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	8,363,000.000	9,424,933.740	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20181115	3,164,000.000	3,202,600.800	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	1,600,000.000	1,591,984.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 57,754,419.080 (966,808,976)	
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	7,615,459.250	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,789,333.840	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,824,000.000	5,072,194.800	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,573,623.600	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,506,899.200	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,376,606.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	2,450,000.000	2,513,749.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 34,447,866.090 (451,956,003)	
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	2,659,737.100	
	5.5% Poland Government Bond 20191025	1,912,000.000	2,066,527.840	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,478,000.000	2,437,360.800	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,226,216.950	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,097,222.000	

	Poland Government Bond 20181025	2,758,000.000	2,693,324.900	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	2,970,453.600	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,820,000.000	1,716,715.000	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	1,620,000.000	1,595,376.000	
	Poland Government Bond 20190425	400,000.000	386,060.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,042,268.100	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,474,380.800	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	884,000.000	1,003,605.200	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,575,000.000	2,756,666.250	
	2.5% Poland Government Bond 20180725	2,099,000.000	2,121,879.100	
	3.25% Poland Government Bond 20190725	1,840,000.000	1,891,336.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,639,270.330	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 35,778,399.970 (1,064,765,183)	
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	677,622.510	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	545,324.100	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	811,925.460	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,638,394.240	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,192,725.000	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,953,362.000	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,554,847.720	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	650,000.000	639,411.500	
	3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	895,000.000	899,027.500	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	863,012.500	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	718,390.250	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	599,812.260	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,044,000.000	1,043,373.600	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	984,973.990	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	477,000.000	451,103.670	

	3. 733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	560,303.900	
	3. 889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	662,146.720	
	4. 935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	609,444.000	
	4. 181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,076,681.340	
	4. 048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	871,423.310	
	3. 654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	648,000.000	651,434.400	
	3. 955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	734,995.360	
	3. 659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	701,673.000	
	3. 795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,166,201.280	
	4. 254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	800,361.000	
	3. 759% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190315	768,000.000	774,005.760	
	3. 8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	700,153.740	
	4. 736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	630,000.000	629,067.600	
	3. 9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	50,000.000	49,935.000	
	3. 62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	351,602.240	
	3. 882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500,000.000	506,755.000	
	4. 059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	600,000.000	608,478.000	
	3. 899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	350,000.000	350,409.500	
	マレーシア・リングgit 小計		マレーシア・リングgit 26,378,377.450 (682,936,192)	
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	20,376,794.700	
	5. 75% Mexican Bonos 20260305	10,090,000.000	9,134,981.500	
	8% Mexican Bonos 20471107	3,500,000.000	3,718,645.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	10,633,000.000	11,066,826.400	
	10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	25,671,753.780	
	7. 5% Mexican Bonos 20270603	10,668,000.000	10,847,222.400	
	10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	8,674,988.000	
	8. 5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	9,681,969.000	
	8. 5% Mexican Bonos 20181213	22,092,000.000	22,518,375.600	
	8. 5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	10,765,187.000	
	8% Mexican Bonos 20200611	14,128,000.000	14,438,816.000	
	6. 5% Mexican Bonos 20210610	27,826,000.000	27,155,393.400	
	7. 75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,465,319.000	
	6. 5% Mexican Bonos 20220609	13,099,000.000	12,708,649.800	
	7. 75% Mexican Bonos 20421113	14,654,000.000	15,094,352.700	
	4. 75% Mexican Bonos 20180614	16,633,000.000	16,237,134.600	
	7. 75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	7,187,387.200	

メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 238,743,796.080 (1,408,588,397)
ユーロ		ユーロ	ユーロ
	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	444,752.640
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	411,847.200
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	293,898.600
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	417,473.250
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	200,644.000
	Finland Government Bond 20220415	270,000.000	273,936.600
	0.25% Austria Government Bond 20191018	527,000.000	537,866.740
	1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	939,941.640
	0.75% Austria Government Bond 20261020	576,000.000	591,678.720
	1.5% Austria Government Bond 20470220	234,000.000	235,270.620
	Austria Government Bond 20230715	300,000.000	301,539.000
	0.5% Austria Government Bond 20270420	380,000.000	377,948.000
	0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,455,491.620
	1% Belgium Government Bond 20310622	924,000.000	921,690.000
	1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	612,059.040
	1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,344,353.060
	1.6% Belgium Government Bond 20470622	544,000.000	533,353.920
	2.15% Belgium Government Bond 20660622	290,000.000	305,338.100
	0.2% Belgium Government Bond 20231022	150,000.000	152,224.500
	0.8% Belgium Government Bond 20270622	600,000.000	609,420.000
	0.5% Belgium Government Bond 20241022	250,000.000	255,870.000
	2.25% Belgium Government Bond 20570622	260,000.000	285,053.600
	1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	304,158.000
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,174,000.000	1,675,685.420
	6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,567,000.000	2,542,567.190
	5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,116,534.380
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,402,304.500



6. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,624,203.390	
5. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,389,460.640	
4. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,927,596.250	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,254,887.150	
4. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,042,552.750	
4. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	2,211,000.000	2,332,516.560	
4. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,506,014.710	
3. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	2,875,238.100	
3. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,701,784.190	
3. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,290,343.500	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,150,452.640	
3. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	2,197,807.700	
2. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,582,306.320	
2. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,597,982.140	
3. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,939,529.880	
2. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,586,724.400	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,707,000.000	1,906,650.720	
1. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,469,930.760	
2. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,728,000.000	2,294,628.480	
1. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,809,567.240	
1. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,558,205.100	
1. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	2,012,363.840	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,824,762.810	
1. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,765,834.420	
2. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,959,000.000	2,626,431.300	
1. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,778,282.340	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,667,133.300	
0. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,394,000.000	2,496,463.200	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	1,534,000.000	1,657,333.600	
0. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,243,619.840	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,800,837.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,000,000.000	997,880.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20180615	1,500,000.000	1,512,015.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20180914	700,000.000	707,112.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20181214	950,000.000	961,191.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20190315	400,000.000	405,408.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20190614	400,000.000	405,940.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20181012	1,209,000.000	1,238,765.580	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190222	1,438,000.000	1,481,801.480	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190412	1,113,000.000	1,139,188.890	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,177,576.590	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,766,693.220	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,492,410.160	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,614,372.900	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,700,000.000	1,740,018.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	360,000.000	367,952.400	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	795,902.520	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,486,985.550	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,225,000.000	3,273,776.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	4,007,550.550	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,007,000.000	4,980,163.330	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,709,000.000	4,222,897.560	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,075,000.000	3,358,638.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,564,000.000	2,474,169.800	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,759,946.100	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,424,000.000	3,568,734.000	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,697,000.000	4,704,876.140	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	2,567,000.000	2,740,606.210	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,734,000.000	4,348,317.640	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	3,263,000.000	3,604,472.950	

3. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3, 380, 000. 000	3, 776, 913. 400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1, 017, 000. 000	1, 642, 912. 650	
3. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3, 146, 000. 000	3, 976, 921. 520	
2. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3, 113, 000. 000	3, 430, 681. 650	
3. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3, 550, 000. 000	4, 114, 698. 500	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3, 630, 000. 000	4, 211, 852. 700	
2. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3, 099, 000. 000	3, 722, 859. 690	
2. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2, 694, 000. 000	3, 045, 243. 720	
3. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2, 088, 000. 000	2, 806, 564. 320	
1. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3, 347, 000. 000	3, 709, 915. 210	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181125	1, 920, 000. 000	1, 964, 793. 600	
2. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3, 086, 000. 000	3, 543, 005. 740	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190525	2, 264, 000. 000	2, 335, 225. 440	
2. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2, 787, 000. 000	3, 300, 226. 050	
1. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2, 799, 000. 000	3, 115, 342. 980	
0. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2, 322, 000. 000	2, 383, 904. 520	
0. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2, 792, 000. 000	2, 827, 821. 360	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3, 070, 000. 000	3, 118, 045. 500	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2, 101, 000. 000	2, 200, 818. 510	
0. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2, 193, 000. 000	2, 247, 605. 700	
1. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	2, 720, 000. 000	2, 866, 852. 800	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20190225	1, 592, 000. 000	1, 608, 413. 520	
0. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2, 737, 000. 000	2, 728, 159. 490	
1. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1, 079, 000. 000	1, 051, 593. 400	
1. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	587, 000. 000	550, 617. 740	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2, 170, 000. 000	2, 203, 526. 500	
0. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2, 400, 000. 000	2, 316, 048. 000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	1, 100, 000. 000	1, 111, 605. 000	
1. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	620, 000. 000	647, 720. 200	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200225	700, 000. 000	710, 605. 000	

1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	900,000.000	925,353.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	800,000.000	837,360.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	789,109.040	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,890,329.910	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,113,176.700	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	971,071.150	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	1,544,000.000	1,625,368.800	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,347,000.000	1,481,673.060	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,295,197.740	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,349,000.000	2,134,603.640	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,692,822.670	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,631,195.300	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,466,330.560	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,548,942.450	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115	924,000.000	953,420.160	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,084,000.000	1,510,250.480	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,730,365.740	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,407,759.180	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,299,688.430	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,359,555.180	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	400,000.000	407,292.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	500,000.000	513,075.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,618,177.540	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,600,453.500	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,325,788.960	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,908,872.200	
1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,476,746.650	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,410,137.200	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,663,485.930	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,644,234.550	

1. 65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,566,649.300	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,529,751.510	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,591,000.000	1,597,602.650	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,535,223.040	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20181015	1,171,000.000	1,178,775.440	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	781,484.580	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,264,968.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,259,000.000	1,242,972.930	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,239,189.600	
0.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190415	812,000.000	814,606.520	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,667,655.540	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	839,343.120	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,454,712.000	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	669,060.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,337,684.320	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	448,000.000	369,465.600	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191015	858,000.000	856,395.540	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	900,000.000	862,767.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,060,000.000	1,056,003.800	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	300,000.000	304,608.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	350,000.000	354,669.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	120,000.000	120,102.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,654,000.000	3,425,119.700	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,963,072.960	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,455,000.000	2,004,480.750	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190201	2,074,000.000	2,222,456.920	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,139,071.920	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,098,000.000	2,700,545.600	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,890,000.000	3,334,135.200	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	3,085,674.420	

5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,734,000.000	2,240,449.380	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,710,541.650	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180801	2,187,000.000	2,306,628.900	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190301	2,708,000.000	2,922,825.640	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	2,531,000.000	2,767,800.360	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,608,444.080	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,614,100.220	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,841,574.400	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,475,229.860	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,484,124.200	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,405,503.680	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,671,073.810	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,395,789.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	2,036,022.180	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,348,956.200	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,810,000.000	2,224,435.700	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,242,836.920	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180601	1,770,000.000	1,837,153.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,363,000.000	1,696,076.310	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,607,569.000	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20181201	2,111,000.000	2,224,825.120	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,942,462.340	
2.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190501	1,100,000.000	1,153,097.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,507,489.250	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,135,404.680	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,692,594.360	
1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	1,246,000.000	1,285,186.700	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,584,078.200	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,768,420.640	
4% Belgium Government Bond 20220328	1,377,000.000	1,668,056.490	

4% Belgium Government Bond 20190328	1, 121, 000. 000	1, 215, 433. 040	
3. 75% Belgium Government Bond 20200928	1, 736, 000. 000	1, 984, 317. 440	
4. 25% Belgium Government Bond 20410328	1, 674, 000. 000	2, 622, 371. 220	
4. 25% Belgium Government Bond 20210928	1, 446, 000. 000	1, 739, 798. 280	
4. 5% Belgium Government Bond 20260328	1, 001, 000. 000	1, 364, 242. 880	
4. 25% Belgium Government Bond 20220928	1, 316, 000. 000	1, 634, 116. 680	
4% Belgium Government Bond 20320328	680, 000. 000	961, 826. 000	
3% Belgium Government Bond 20190928	1, 123, 000. 000	1, 217, 174. 780	
2. 25% Belgium Government Bond 20230622	1, 338, 000. 000	1, 532, 638. 860	
1. 25% Belgium Government Bond 20180622	1, 052, 000. 000	1, 072, 587. 640	
3. 75% Belgium Government Bond 20450622	753, 000. 000	1, 118, 528. 790	
2. 6% Belgium Government Bond 20240622	1, 505, 000. 000	1, 770, 361. 600	
3% Belgium Government Bond 20340622	597, 000. 000	769, 282. 260	
4. 5% IRISH TREASURY 20181018	759, 000. 000	810, 748. 620	
4. 4% IRISH TREASURY 20190618	684, 000. 000	752, 707. 800	
5. 9% IRISH TREASURY 20191018	570, 000. 000	656, 463. 300	
5. 4% IRISH TREASURY 20250313	1, 131, 000. 000	1, 551, 630. 210	
5% IRISH TREASURY 20201018	765, 000. 000	904, 796. 100	
3. 9% IRISH TREASURY 20230320	504, 000. 000	616, 603. 680	
3. 4% IRISH TREASURY 20240318	607, 000. 000	733, 753. 740	
2. 4% IRISH TREASURY 20300515	761, 000. 000	866, 094. 100	
0. 8% IRISH TREASURY 20220315	516, 000. 000	539, 137. 440	
2% IRISH TREASURY 20450218	531, 000. 000	538, 715. 430	
1% IRISH TREASURY 20260515	673, 000. 000	687, 604. 100	
1. 7% IRISH TREASURY 20370515	350, 000. 000	351, 253. 000	
4. 5% IRISH TREASURY 20200418	1, 035, 000. 000	1, 181, 959. 650	
6. 25% Austria Government Bond 20270715	985, 000. 000	1, 557, 009. 200	
3. 9% Austria Government Bond 20200715	1, 248, 000. 000	1, 421, 646. 720	
3. 5% Austria Government Bond 20210915	1, 337, 000. 000	1, 563, 313. 990	
4. 15% Austria Government Bond 20370315	1, 073, 000. 000	1, 643, 599. 940	
4. 35% Austria Government Bond 20190315	989, 000. 000	1, 077, 050. 670	
4. 85% Austria Government Bond 20260315	875, 000. 000	1, 223, 083. 750	
3. 65% Austria Government Bond 20220420	797, 000. 000	951, 976. 650	
3. 4% Austria Government Bond 20221122	872, 000. 000	1, 045, 493. 120	
3. 8% Austria Government Bond 20620126	318, 000. 000	538, 816. 020	

1. 95% Austria Government Bond 20190618	738,000.000	776,855.700	
3. 15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	872,224.920	
1. 75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,071,701.680	
2. 4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	754,086.510	
1. 15% Austria Government Bond 20181019	426,000.000	436,449.780	
1. 65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,036,980.480	
4. 375% Finland Government Bond 20190704	416,000.000	459,779.840	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	874,290.260	
3. 375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	704,174.400	
3. 5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	529,786.980	
2. 75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	481,920.430	
1. 625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	672,716.520	
1. 5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	489,529.600	
2. 625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	538,721.480	
1. 125% Finland Government Bond 20180915	425,000.000	435,025.750	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	601,409.520	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,952,000.000	2,823,509.440	
1. 6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,804,207.850	
1. 95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,552,000.000	1,548,632.160	
2. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,912,601.600	
1. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,250,000.000	1,299,050.000	
1. 95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,815,768.080	
0. 25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190131	1,672,000.000	1,686,111.680	
0. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,147,000.000	1,179,012.770	
2. 9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	852,000.000	852,681.600	
3. 45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	400,000.000	419,040.000	
1. 3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,730,000.000	1,708,548.000	
0. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	580,000.000	582,059.000	
1. 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	1,789,488.000	
2. 35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	550,000.000	554,598.000	



	5. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	2,910,911.100	
	4. 2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,094,311.340	
	4. 9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,428,000.000	1,976,166.360	
	4. 1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	2,206,000.000	2,318,858.960	
	4. 8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,115,871.900	
	4. 6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,629,370.700	
	4. 3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,966,096.500	
	4. 7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,373,000.000	1,859,934.450	
	4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,351,439.200	
	4. 65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,789,000.000	2,265,518.040	
	4. 85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,959,608.940	
	5. 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	3,051,600.400	
	5. 9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,721,053.400	
	5. 85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,493,011.860	
	5. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,319,253.760	
	4. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,601,000.000	1,970,478.780	
	5. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,270,000.000	1,716,405.000	
	3. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20181031	1,754,000.000	1,856,573.920	
	5. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,049,000.000	1,505,734.600	
	2. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190430	1,836,000.000	1,942,102.440	
	3. 8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,351,116.200	
	2. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,352,687.210	
	1. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,979,724.000	
	ユーロ 小計		ユーロ 509,843,962.630 (63,495,967,106)	
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	4,178,000.000	4,220,448.480	
	7. 25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,756,002.560	
	10. 5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	15,434,000.000	17,471,288.000	
	6. 25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	5,582,564.680	

	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,512,689.700	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,426,194.880	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,615,943.690	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	5,539,000.000	5,517,120.950	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	13,452,000.000	12,423,863.640	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	8,621,000.000	7,951,493.140	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	8,862,000.000	8,242,723.440	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	6,944,000.000	6,408,270.400	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	6,243,000.000	5,825,093.580	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	4,166,000.000	4,015,190.800	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	2,179,000.000	2,080,073.400	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 104,048,961.340 (894,821,067)	
国債証券 合計			158,442,056,917 [158,442,056,917]	
合計			158,442,056,917 [158,442,056,917]	

- (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 242 銘柄	100%	43.9%
イギリス・ポンド	国債証券 41 銘柄	100%	7.2%
オーストラリア・ドル	国債証券 22 銘柄	100%	2.1%
カナダ・ドル	国債証券 32 銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 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 17 銘柄	100%	0.7%
マレーシア・リングgit	国債証券 33 銘柄	100%	0.4%
メキシコ・ペソ	国債証券 17 銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券 295 銘柄	100%	40.1%
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。

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成29年6月6日から平成29年12月5日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成 30 年 1 月 12 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

貞廣篤典 

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士

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」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス 50 の平成 29 年 6 月 6 日から平成 29 年 12 月 5 日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス 50 の平成 29 年 12 月 5 日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成 29 年 6 月 6 日から平成 29 年 12 月 5 日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

ダイワ・ライフ・バランス50

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成29年12月5日現在	
	金 額 (円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		46,622,813
親投資信託受益証券		8,489,871,351
未収入金		2,335,000
流動資産合計		8,538,829,164
資産合計		8,538,829,164
負債の部		
流動負債		
未払解約金		6,281,647
未払受託者報酬		1,290,507
未払委託者報酬		7,313,076
その他未払費用		322,549
流動負債合計		15,207,779
負債合計		15,207,779
純資産の部		
元本等		
元本	※1	4,760,385,271
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)		3,763,236,114
(分配準備積立金)		1,701,365,805
元本等合計		8,523,621,385
純資産合計		8,523,621,385
負債純資産合計		8,538,829,164

## (2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間 自 平成 29 年 6 月 6 日 至 平成 29 年 12 月 5 日
	金額 (円)
営業収益	
有価証券売買等損益	480,283,225
営業収益合計	480,283,225
営業費用	
支払利息	11,433
受託者報酬	1,290,507
委託者報酬	7,313,076
その他費用	322,549
営業費用合計	8,937,565
営業利益	471,345,660
経常利益	471,345,660
中間純利益	471,345,660
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	9,333,278
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	3,090,650,405
剰余金増加額又は欠損金減少額	374,581,456
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	374,581,456
剰余金減少額又は欠損金増加額	164,008,129
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	164,008,129
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	3,763,236,114

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成 29 年 6 月 6 日 至 平成 29 年 12 月 5 日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成 29 年 12 月 5 日現在
1. ※1 期首元本額	4,486,718,406 円
期中追加設定元本額	511,364,142 円
期中一部解約元本額	237,697,277 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,760,385,271 口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成 29 年 6 月 6 日 至 平成 29 年 12 月 5 日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成 29 年 12 月 5 日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区 分	当中間計算期間末 平成 29 年 12 月 5 日現在
	該当事項はありません。



(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成29年12月5日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7905円 (17,905円)

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年12月5日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,746,351,339
株式 ※2※3		141,583,955,320
派生商品評価勘定		50,080,040
未収入金		27,369,080
未収配当金		230,763,897
未収利息		389,914
その他未収収益 ※4		5,148,381
流動資産合計		147,644,057,971
資産合計		147,644,057,971
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		71,080
前受金		69,330,000
未払金		381,975,760
未払解約金		140,661,200
受入担保金		4,123,817,407
流動負債合計		4,715,855,447
負債合計		4,715,855,447
純資産の部		
元本等		
元本 ※1		128,506,019,421
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		14,422,183,103
元本等合計		142,928,202,524
純資産合計		142,928,202,524
負債純資産合計		147,644,057,971

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 29 年 6 月 6 日 至 平成 29 年 12 月 5 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 12 月 5 日現在
1. ※1 期首	平成 29 年 6 月 6 日
期首元本額	134,619,084,916 円
期中追加設定元本額	6,993,490,189 円
期中一部解約元本額	13,106,555,684 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	4,370,049,538 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	11,109,551,697 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	63,463,456 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	80,019,243 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,408,867,164 円
ダイワ国際分散バランスファ	70,073,352 円

ンド30VA(一般投資家私募)	
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,941,148,296円
D-I's TOPIXインデックス	28,365,668円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	25,160,362円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	571,628円
iFree TOPIXインデックス	261,468,983円
iFree 8資産バランス	626,954,388円
DCダイワ日本株式インデックス	60,673,349,674円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,192,616,256円
ダイワ・ライフ・バランス50	2,317,552,032円
ダイワ・ライフ・バランス70	2,181,670,247円
年金ダイワ日本株式インデックス	4,032,025,541円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	17,251,021円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	51,709,568円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	13,388,722円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	364,602円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	362,318円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	690,983円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	6,930,943円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	19,322,872円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)	15,921,448円
ダイワ世界バランスファンド40VA	350,707,766円
ダイワ世界バランスファンド60VA	168,953,117円
ダイワ・バランスファンド35VA	10,947,597,416円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	227,225,197円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	239,347,643円

ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	894,706,985 円
ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	144,200,065 円
ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用)	242,040,229 円
ダイワ・ノーロード TOPIXファンド	71,959,168 円
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	5,903,882,348 円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	4,249,350 円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	1,182,749,403 円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,191,403,744 円
ダイワライフスタイル25	175,289,512 円
ダイワライフスタイル50	626,651,386 円
ダイワライフスタイル75	504,958,798 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)	14,121,247,292 円
計	128,506,019,421 円
2. 期末日における受益権の総数	128,506,019,421 口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 3,910,911,950 円
4. ※3 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 699,700,000 円
5. ※4 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 3,842,870 円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成 29 年 12 月 5 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ぬ。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)  
 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成 29 年 12 月 5 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	1,313,010,000	—	1,363,060,000	50,050,000
合計	1,313,010,000	—	1,363,060,000	50,050,000

- (注) 1. 時価の算定方法  
 株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
 原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1 口当たり情報)

	平成 29 年 12 月 5 日現在
1 口当たり純資産額	1.1122 円
(1 万口当たり純資産額)	(11,122 円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年12月5日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		84,047,399
国債証券		11,915,069,150
地方債証券		1,129,038,100
特殊債券		919,732,200
社債券		1,123,667,600
未収利息		44,371,954
前払費用		851,680
流動資産合計		15,216,778,083
資産合計		15,216,778,083
負債の部		
流動負債		
未払解約金		234,231
流動負債合計		234,231
負債合計		234,231
純資産の部		
元本等		
元本	※1	12,010,120,261
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		3,206,423,591
元本等合計		15,216,543,852
純資産合計		15,216,543,852
負債純資産合計		15,216,778,083

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 29 年 6 月 6 日 至 平成 29 年 12 月 5 日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成 29 年 12 月 5 日現在
1. ※1 期首	平成 29 年 6 月 6 日
期首元本額	12,338,211,994 円
期中追加設定元本額	1,205,690,575 円
期中一部解約元本額	1,533,782,308 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	50,696 円
i F r e e 日本債券インデ ックス	94,987,702 円
i F r e e 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	549,945,967 円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	5,130,322,238 円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,650,014,135 円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	845,269,979 円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コース)	594,643,613 円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	481,772,759 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2020	149,269,450 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2030	62,590,885 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2040	46,760,059 円
ダイワ世界バランスファンド	3,511,254 円
	771,212,719 円



40VA ダイワ世界バランスファンド	220,899,817円
60VA ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	199,599,698円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	209,269,290円
計	12,010,120,261円
2. 期末日における受益権の総数	12,010,120,261口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成29年12月5日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成29年12月5日現在
1口当たり純資産額	1.2670円
(1万口当たり純資産額)	(12,670円)

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

貸借対照表

	平成29年12月5日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		419,293,915
コール・ローン		78,120,210
株式		91,806,022,136
投資証券		2,491,475,140
派生商品評価勘定		26,760,398
未収入金		5,784,269
未収配当金		156,728,014
差入委託証拠金		717,950,888
流動資産合計		95,702,134,970
資産合計		95,702,134,970
負債の部		
流動負債		
未払金		59,711,437
未払解約金		27,200,000
流動負債合計		86,911,437
負債合計		86,911,437
純資産の部		
元本等		
元本	※1	39,731,692,595
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		55,883,530,938
元本等合計		95,615,223,533
純資産合計		95,615,223,533
負債純資産合計		95,702,134,970

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 29 年 6 月 6 日 至 平成 29 年 12 月 5 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 12 月 5 日現在
1. ※1 期首	平成 29 年 6 月 6 日
期首元本額	39,805,675,154 円
期中追加設定元本額	2,831,877,772 円
期中一部解約元本額	2,905,860,331 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	563,793,707 円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	18,626,936 円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	281,081,321 円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	32,623,332 円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	907,424,053 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)	398,856,583 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)	889,918,098 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)	304,663,433 円
D-I's 外国株式インデッ クス	1,411,329 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2050	175,432 円
iFree 外国株式インデ ックス (為替ヘッジなし)	392,074,014 円
iFree 8資産バランス	292,087,750 円
DCダイワ外国株式インデッ	24,077,910,273 円

クス	
ダイワ・ライフ・バランス30	500,461,180円
ダイワ・ライフ・バランス50	709,817,413円
ダイワ・ライフ・バランス70	565,613,567円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,437,820,318円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	5,379,713円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	14,469,810円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,584,603円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	81,383円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	162,594円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	2,143,628円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	8,996,210円
ダイワ世界バランスファンド40VA	494,851,854円
ダイワ世界バランスファンド60VA	393,481,949円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,802,584,243円
ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	179,654,034円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	500,122,607円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	44,392,060円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)	464,688円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,756,545,561円
ダイワライフスタイル25	20,423,108円
ダイワライフスタイル50	71,324,265円
ダイワライフスタイル75	58,671,546円
計	39,731,692,595円
2. 期末日における受益権の総数	39,731,692,595口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成29年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引に関する注記)  
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成 29 年 12 月 5 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, 204, 753, 596	—	1, 231, 513, 994	26, 760, 398
合計	1, 204, 753, 596	—	1, 231, 513, 994	26, 760, 398

- (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 12 月 5 日現在
1 口当たり純資産額	2. 4065 円
(1 万口当たり純資産額)	(24, 065 円)

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

貸借対照表

	平成29年12月5日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		2,559,610,512
コール・ローン		853,427,798
国債証券		165,837,950,561
派生商品評価勘定		3,443,887
未収入金		523,781
未収利息		1,226,505,015
前払費用		21,192,130
流動資産合計		170,502,653,684
資産合計		170,502,653,684
負債の部		
流動負債		
未払金		2,456,691,842
未払解約金		32,833,014
流動負債合計		2,489,524,856
負債合計		2,489,524,856
純資産の部		
元本等		
元本	※1	59,384,180,616
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		108,628,948,212
元本等合計		168,013,128,828
純資産合計		168,013,128,828
負債純資産合計		170,502,653,684

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 29 年 6 月 6 日 至 平成 29 年 12 月 5 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 12 月 5 日現在
1. ※1 期首	平成 29 年 6 月 6 日
期首元本額	59,593,264,615 円
期中追加設定元本額	2,969,637,926 円
期中一部解約元本額	3,178,721,925 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	940,218,252 円
VA	
ダイワ国内重視バランスファ	31,459,334 円



ンド30VA(一般投資家私募)	
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	236,873,568円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	64,271,557円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	765,127,578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)	247,478,992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)	526,793,974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)	400,342,697円
D-I's 外国債券インデックス	880,097円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	22,820円
iFree 外国債券インデックス	575,513,586円
iFree 8資産バランス	248,481,818円
DCダイワ外国債券インデックス	40,006,090,240円
ダイワ・ライフ・バランス30	631,956,912円
ダイワ・ライフ・バランス50	299,207,037円
ダイワ・ライフ・バランス70	191,123,644円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	268,716,892円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	217,740,890円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	67,480,495円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	11,339,433円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	17,924,010円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,323,903円
ダイワ世界バランスファンド40VA	490,001,964円
ダイワ世界バランスファンド60VA	166,221,824円

ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,393,028,770円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	361,365,888円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	142,269,988円
ダイワ・バランスファンド2 5VA (適格機関投資家専用)	353,629,355円
ダイワ・インデックスセレクト ト 外国債券	127,207,498円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	21,936,052円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワ SMA専用)	374,472円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,467,097,713円
ダイワライフスタイル25	34,475,752円
ダイワライフスタイル50	59,700,901円
ダイワライフスタイル75	16,502,710円
計	59,384,180,616円
2. 期末日における受益権の総数	59,384,180,616口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成29年12月5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				

売 建	14,630,248	—	14,629,810	438
イギリス・ポンド	9,392,665	—	9,392,380	285
カナダ・ドル	5,237,583	—	5,237,430	153
買 建	678,242,261	—	681,685,710	3,443,449
アメリカ・ドル	274,699,689	—	275,935,080	1,235,391
イギリス・ポンド	79,433,761	—	79,798,340	364,579
オーストラリア・ドル	11,529,794	—	11,638,880	109,086
カナダ・ドル	16,170,933	—	16,490,760	319,827
シンガポール・ドル	8,296,250	—	8,342,000	45,750
デンマーク・クローネ	8,895,027	—	8,934,120	39,093
ユーロ	279,216,807	—	280,546,530	1,329,723
合計	692,872,509	—	696,315,520	3,443,887

(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12月5日現在
1 口当たり純資産額	2.8293 円
(1 万口当たり純資産額)	(28,293 円)

## 2 ファンドの現況

### 純資産額計算書

平成 29 年 12 月 29 日

I 資産総額	8,701,240,515 円
II 負債総額	2,481,306 円
III 純資産総額 (I - II)	8,698,759,209 円
IV 発行済数量	4,807,033,166 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.8096 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 12 月 29 日

I 資産総額	149,302,549,510 円
II 負債総額	4,000,830,730 円
III 純資産総額 (I - II)	145,301,718,780 円
IV 発行済数量	128,583,954,239 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.1300 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 12 月 29 日

I 資産総額	15,452,074,191 円
II 負債総額	31,746,000 円
III 純資産総額 (I - II)	15,420,328,191 円
IV 発行済数量	12,147,734,723 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.2694 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 12 月 29 日

I 資産総額	98,491,255,804 円
--------	------------------

II	負債総額	208,933,750 円
III	純資産総額 (I - II)	98,282,322,054 円
IV	発行済数量	39,892,627,975 口
V	1 単位当たり純資産額 (III/IV)	2.4637 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 12 月 29 日

I	資産総額	169,286,956,566 円
II	負債総額	124,822,561 円
III	純資産総額 (I - II)	169,162,134,005 円
IV	発行済数量	59,509,972,563 口
V	1 単位当たり純資産額 (III/IV)	2.8426 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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- (6) 受益権の譲渡の対抗要件  
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- (7) 受益権の再分割  
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- (8) 償還金  
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。
- (9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて  
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

## 第三部 委託会社等の情報

### 第1 委託会社等の概況

#### 1 委託会社等の概況

##### a. 資本金の額

2017年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 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。

2017年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	79	209,661
追加型株式投資信託	708	15,305,990
株式投資信託 合計	787	15,515,652
単位型公社債投資信託	24	125,842
追加型公社債投資信託	14	1,663,877
公社債投資信託 合計	38	1,789,719
総合計	825	17,305,371

### 3 委託会社等の経理状況

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。  
また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第58期事業年度（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。  
また、第59期事業年度に係る中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。
3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。


## 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 (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)
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。




## 独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人


指定有限責任社員 公認会計士  
業務執行社員

高波 博之 

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

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29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (平成29年9月30日)	
資産の部		
流動資産		
現金・預金		22,206
有価証券		98
未収委託者報酬		11,259
繰延税金資産		391
その他		278
流動資産合計		34,233
固定資産		
有形固定資産	※1	231
無形固定資産		
ソフトウェア		2,066
その他		446
無形固定資産合計		2,512
投資その他の資産		
投資有価証券		6,874
関係会社株式		5,129
その他		1,262
投資その他の資産合計		13,266
固定資産合計		16,010
資産合計		50,244

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(平成29年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	7,070
未払費用	3,973
未払法人税等	916
賞与引当金	692
その他	※2 606
流動負債合計	13,260
固定負債	
退職給付引当金	2,324
役員退職慰労引当金	134
繰延税金負債	21
その他	6
固定負債合計	2,487
負債合計	15,747
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,116
利益剰余金合計	7,490
株主資本合計	34,160
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	336
評価・換算差額等合計	336
純資産合計	34,496
負債・純資産合計	50,244

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		40,996
その他営業収益		364
営業収益合計		41,360
営業費用		
支払手数料		20,216
その他営業費用		6,325
営業費用合計		26,542
一般管理費	※1	5,665
営業利益		9,152
営業外収益	※2	222
営業外費用		9
経常利益		9,365
特別利益		—
特別損失		—
税引前中間純利益		9,365
法人税、住民税及び事業税		2,879
法人税等調整額		69
中間純利益		6,416

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成 29 年 4 月 1 日 至 平成 29 年 9 月 30 日）

(単位：百万円)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,532	△11,532	△11,532
中間純利益	-	-	-	6,416	6,416	6,416
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△5,115	△5,115	△5,115
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,116	7,490	34,160

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,532
中間純利益	-	-	6,416
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	72	72	72
当中間期変動額合計	72	72	△5,043
当中間期末残高	336	336	34,496

## 注記事項

### (重要な会計方針)

#### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

##### (1) 子会社

移動平均法による原価法により計上しております。

##### (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

#### 2. 固定資産の減価償却の方法

##### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

##### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

#### 3. 引当金の計上基準

##### (1) 賞与引当金

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

##### (2) 退職給付引当金

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

##### (3) 役員退職慰労引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成29年9月30日現在)
有形固定資産	307百万円

※2 消費税等の取扱い

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

3 保証債務

当中間会計期間(平成29年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務1,744百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	471百万円

※2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
受取配当金	49百万円
投資有価証券売却益	134百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成 29 年 4 月 1 日 至 平成 29 年 9 月 30 日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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



(金融商品関係)

当中間会計期間 (平成 29 年 9 月 30 日)

### 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,206	22,206	—
(2) 未収委託者報酬	11,259	11,259	—
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,002	6,002	—
資産合計	39,467	39,467	—
(1) 未払金 (*)	7,002	7,002	—
(2) 未払費用 (*)	3,424	3,424	—
負債合計	10,427	10,427	—

(\*) 金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

#### (注1) 金融商品の時価の算定方法

##### 資 産

##### (1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

##### (3) 有価証券及び投資有価証券

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

##### 負 債

##### (1) 未払金及び(2) 未払費用

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

#### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	970
子会社株式	5,129
差入保証金	1,044

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

(有価証券関係)

当中間会計期間 (平成29年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
(1) 株式	124	55	69
(2) その他			
証券投資信託	4,458	3,979	479
小計	4,582	4,034	548
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	1,419	1,482	△63
小計	1,419	1,482	△63
合計	6,002	5,517	485

(注) 非上場株式 (中間貸借対照表計上額 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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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

[関連情報]

当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,224.69円
1株当たり中間純利益金額	2,459.79円

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

(注2) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,416
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,416
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 利害関係人との取引制限

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

- 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 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下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って、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5 その他

- a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。
- b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実  
訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

追加型証券投資信託

(ダイワ・ライフ・バランス50)

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、国内外の株式および債券に投資し、信託財産の中長期的な成長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。

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. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）の受益証券  
（NOMURA-B P I 総合指数）
3. 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））
4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券  
（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

#### (2) 投資態度

① 主として、各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。

② 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券	……	信託財産の純資産総額の30%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）受益証券	……	信託財産の純資産総額の40%
外国株式インデックスマザーファンド受益証券	……	信託財産の純資産総額の20%
外国債券インデックスマザーファンド受益証券	……	信託財産の純資産総額の10%

③ 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。

④ 保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。

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 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として、信託財産総額の75%以下とします。

⑦ 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（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- ② 新株引受権証券等への投資制限  
新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③ 投資信託証券への投資制限  
投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④ 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限  
同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤ 同一銘柄の転換社債等への投資制限  
同一銘柄の転換社債、ならびに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への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑥ 外貨建資産への投資制限  
外貨建資産への実質投資割合は、信託財産総額の75%以下とします。
- ⑦ 有価証券先物取引等の範囲  
有価証券先物取引等は、約款第22条の範囲で行ないます。
- ⑧ スワップ取引の範囲  
スワップ取引は、約款第23条の範囲で行ないます。
- ⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引の範囲  
金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第24条の範囲で行ないます。

### 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等とします。
- ② 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 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  
(ダイワ・ライフ・バランス50)  
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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

③ 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、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。以下この条において同じ。）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100万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、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 追加信託が行なわれたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1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49条第1項、第50条第1項、第51条第1項および第53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100万口に、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、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法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。

(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（受入担保金代用有価証券を除きます。）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29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 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、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。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第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（委託者の指定する金融商品取引法第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。）に当該申請の手続を委任することができます。

（受益権の設定にかかる受託者の通知）

第11条 受託者は、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、1円以上1円単位をもって取得の申込に応じることができます。

- ② 指定販売会社は、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って契約（以下「積立投資契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、1円以上1円単位または1口以上1口単位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4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証券の価額は、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。
- ⑤ 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39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

(受益権の譲渡にかかる記載または記録)

第12条の2 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振替の申請をするものとし、

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、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、

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12条の3 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。

第13条 (削 除)

第14条 (削 除)

第15条 (削 除)

(投資の対象とする資産の種類)

第16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、

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、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限り、)

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

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第17条 委託者は、信託金を、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4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5号から第24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. 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

3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5. 株券または新株引受権証券

6. 国債証券

7. 地方債証券

8. 特別の法律により法人の発行する債券

9. 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。

10. 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。)

11. 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。)

12. 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。)

13. 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。)

14. コマーシャル・ペーパー

15. 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

16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第5号から第15号までの証券または証書の性質を有するもの

17. 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。)

18. 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。)

19. 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。)

20. 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。)

21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

22. 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。)

23. 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

24. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第20号の証券または証書のうち第5号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、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第20号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券（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。

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

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号の権利の性質を有するもの

③ 委託者は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の70以上となる投資の指図をしません。

④ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、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株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、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新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑦ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所（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。）に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額

の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ⑧ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、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投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第17条の2 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、受託者および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。以下この条および第30条において同じ。）、第30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16条ならびに第17条第1項および第2項に定める資産への投資を、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限り行なうことができます。

- ② 前項の取扱いは、第21条から第24条まで、第26条、第29条、第34条から第36条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

（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、その指図を行いません。

（投資する株式等の範囲）

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- ② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

（同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限）

第20条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、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当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（信用取引の指図範囲）

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができます。

- ② 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（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。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図および範囲）

第22条 委託者は、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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- ② 委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- ③ 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

（スワップ取引の運用指図および範囲）

第23条 委託者は、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。

- ② 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、第4条に定める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。
- ③ 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とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみ

なした額との合計額（以下本項において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）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、委託者は、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。

- ④ 前項においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤ 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。
- ⑥ 委託者は、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲）

第24条 委託者は、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。

- ② 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、第4条に定める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。
- ③ 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とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）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の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、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。
- ④ 前項においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品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の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤ 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とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）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の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、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。
- ⑥ 前項においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産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の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑦ 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。
- ⑧ 委託者は、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たときは、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。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第24条の2 委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第25条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、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当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(有価証券の貸付けの指図および範囲)

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③ 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(外貨建資産への投資制限)

第27条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産総額の100分の75を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の75を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、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。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第28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29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を指図することができます。

(信託業務の委託等)

第30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（裁量性のないものに限りません。）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

#### 第31条 (削 除)

(混蔵寄託)

第32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33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、速やかに登記または登録をするものとします。
- 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34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35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、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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36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37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38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、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、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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39条 この信託の計算期間は、毎年6月6日から翌年6月5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)

第40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。

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第41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42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39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20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43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、貸付有価証券にかかる品貸料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。

第44条 (削 除)

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第45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）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、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、
- 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、

（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46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47条 受益者が、収益分配金については第45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45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48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。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 平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約にかかる一部解約の実行の請求を受益者がするときは、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、ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約請求で、平成19年1月4日前行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとし、
- 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があるときは、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48条の2 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49条 委託者は、信託期間中において、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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑥ 第3項から前項までの規定は、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3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第50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54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51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54条第4項に該当する場合を除き、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52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53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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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54条の規定に従い、新受託者を選任します。

- 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)

第54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ができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更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。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- ⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則

として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第55条 第49条の規定に従い信託契約の解約を行なう場合または前条の規定に従い信託約款の変更を行なう場合において、第49条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第55条の2 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56条 委託者が受益者に対してする公告は、平成20年6月30日までは日本経済新聞に掲載し、平成20年7月1日以降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 平成20年7月1日以降において、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57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45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。

第 3条 平成18年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条(受益証券の再交付)から第15条(受益証券の再交付の費用)の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

第 4条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 5条 第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

平成17年 6月 6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