

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成30年9月7日提出
【計算期間】	第2計算期間 (自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日)
【ファンド名】	ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用) ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用) ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用) 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) ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用) ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用) 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) ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用) ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用) ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 岩本 信之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	高橋 慎
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、特定の指数の動きに連動する投資成果をめざすマザーファンドを通じて、特定の有価証券に投資し、各市場の動きを反映した投資成果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。

< TOPIXインデックス >

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	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	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（株式 一般））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	投資形態	ファミリーファンド
	対象インデックス	TOPIX

< 日経225インデックス >

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	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	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（株式 一般））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	投資形態	ファミリーファンド
	対象インデックス	日経225

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

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	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	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（株式 一般））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（除く日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジあり（フルヘッジ）
	対象インデックス	その他の指数（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

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	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	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（株式 一般））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（除く日本）
	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（MSCIコクサイ指数（円ベース））

< 日本債券インデックス >

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	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	債券
	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（債券 一般））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	投資形態	ファミリーファンド
	対象インデックス	その他の指数（DBI総合指数）

< 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

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	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	債券
	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（債券 公債））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（除く日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジあり（フルヘッジ）
	対象インデックス	その他の指数（FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

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	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	債券
	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（債券 公債））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（除く日本）
	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（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

< J - R E I Tインデックス >

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	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	不動産投信（リート）
	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（不動産投信））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	投資形態	ファミリーファンド
	対象インデックス	その他の指数（東証REIT指数（配当込み））

< 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） >

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	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	不動産投信（リート）
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（不動産投信））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（除く日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジあり（フルヘッジ）

< 外国REITインデックス（為替ヘッジなし） >

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	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	不動産投信（リート）
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（不動産投信））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（除く日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

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

（注1）商品分類の定義

- ・「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「国内」…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、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「海外」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「株式」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの

- ・「債券」...目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「不動産投信(リート)」...目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を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
- ・「株式 一般」...大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「債券 一般」...公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「債券 公債」...目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。)に主として投資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
- ・「日本」...目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉と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
- ・「為替ヘッジあり」...目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
- ・「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

< TOPIXインデックス >

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<日経225インデックス>

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

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	年1回	グローバル (除く日本)			
一般 大型株	年2回	日本			日経225
中小型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	
債券	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
一般 公債	年12回 (毎月)	アジア			
社債	日々	オセアニア			
その他債券 クレジット属性 ()	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース))
不動産投信		アフリカ			
その他資産 (投資信託証券) (株式 一般)		中近東 (中東)			
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固定型 資産配分変更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

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	年1回	グローバル (除く日本)			
一般	年2回	日本			日経225
大型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()	
中小型株	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
債券	年12回 (毎月)	アジア			
一般	日々	オセアニア			
公債	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (MSCIコクサイ) 指数(円ベース)
社債		アフリカ			
その他債券		中近東 (中東)			
クレジット属性 ()		エマーゼング			
不動産投信					
その他資産 (投資信託証券) (株式 一般)					
資産複合 ()					
資産配分固定型					
資産配分変更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 日本債券インデックス >

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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般		日本		日経225
大型株	年2回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年4回	欧州		
債券	年6回 (隔月)	アジア		TOPIX
一般	年12回 (毎月)	オセアニア		
公債	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (DBI総合指数)
社債	その他 ()	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ()		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券)				
(債券 一般)				
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

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 (除く日本)			
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 (フルヘッジ)	
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 ()	年12回 (毎月)	中南米			
不動産投信		アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (FTSE世界国債 インデックス(除く日本、 円ヘッジ・円ベース))
その他資産 (投資信託証券) (債券 公債)	日々	中近東 (中東)			
資産複合 ()	その他 ()	エマージング			
資産配分固定型					
資産配分変更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

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 その他資産 () 資産複合	特殊型

(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 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回	日本	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX
不動産投信	年4回	北米			
その他資産 (投資信託証券) (債券 公債)	年6回 (隔月)	欧州			
資産複合 ()	年12回 (毎月)	アジア			
資産配分固定型 資産配分変更型	年12回 (毎月)	オセアニア	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (FTSE世界国債 インデックス(除く日本、 ヘッジなし・円ベース))
	日々	中南米			
	その他 ()	アフリカ			
		中近東 (中東)			
		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< J - R E I T インデックス >

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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般		日本		日経225
大型株	年2回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年4回	欧州		
債券	年6回 (隔月)	アジア		TOPIX
一般	年12回 (毎月)	オセアニア		
公債	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (東証REIT指数 (配当込み))
社債	その他 ()	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ()		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券) (不動産投信)				
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 外国REITインデックス（為替ヘッジなし） >

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて次の額を限度として信託金を追加することができます。

ファンド名	限度額
TOPIXインデックス	2,500億円
日経225インデックス	各ファンドについて 5,000億円
外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	
外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	
日本債券インデックス	
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	
外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	

J - R E I Tインデックス	各ファンドについて 1,000億円
外国R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）	
外国R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）	

- ・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 当ファンドは、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。

- 当ファンドの購入の申込みを行なう投資者は、販売会社と投資一任契約の資産を管理する口座に関する契約および投資一任契約を締結する必要があります。

2 各ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて実質的な運用を行ないます。

- 各ファンドは、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（各ファンド）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。



※各ファンド、マザーファンドおよび特定の有価証券については後掲の「各ファンドの基本情報」をご参照下さい。

●各ファンドの基本情報

特定の 有価証券	各ファンド	特定の指数	マザーファンド
わが国の 株式	TOPIXインデックス	東証株価指数 (TOPIX)	トピックス・インデックス・ マザーファンド
	日経225インデックス	日経平均株価 (日経225)	ストックインデックス225・ マザーファンド
海外の 株式	外国株式インデックス (為替ヘッジあり)	MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)	外国株式インデックス 為替ヘッジ型マザーファンド
	外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	MSCIコクサイ指数 (円ベース)	外国株式インデックス マザーファンド
わが国の 債券	日本債券インデックス	ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数	日本債券インデックス マザーファンド
海外の 債券	外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド
	外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	外国債券インデックス マザーファンド
わが国の リート	J-REITインデックス	東証REIT指数 (配当込み)	ダイワJ-REIT マザーファンド
海外の リート	外国REITインデックス (為替ヘッジあり) ^(注1)	S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)	ダイワ・グローバルREITインデックス・ マザーファンド
		—	先進国REITマザーファンド ^(注2)
	外国REITインデックス (為替ヘッジなし)	S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)	ダイワ・グローバルREITインデックス・ マザーファンド
		—	先進国REITマザーファンド ^(注2)

※各ファンド（「外国REITインデックス（為替ヘッジあり）」を除きます。）において、マザーファンドの受益証券の組入比率あるいは組入比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

(注1) 当ファンドは、マザーファンドに投資するとともに、保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。

(注2) 「先進国REITマザーファンド」は、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざすファンドです。

●各ファンドの運用方針

TOPIXインデックス

東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果をあげることがめざして運用を行ないます。

◆東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

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

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

(c)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注1)を用います。

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ます。

日経225インデックス

日経平均株価（日経225）に連動する投資成果をあげることがめざして運用を行ないます。

◆わが国の株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を主要投資対象とします。

投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

(a)上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。

(b)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆日経平均株価に採用されている銘柄すべての組入れを行ないポートフォリオを構築することを基本とします（ただし、財務リスクが高いと判断される銘柄については除く場合があります。）。

日経平均株価への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）に連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行いません。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注1)を用います。

MSCIコクサイ指数（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行いません。なお、保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行いません。

※為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

※マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

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ざして運用を行いません。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注1)を用います。

MSCIコクサイ指数（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行いません。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。

(注1) 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。

日本債券インデックス

ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数に連動する投資成果をめざして運用を行いません。

- ◆ポートフォリオの構築にあたっては、マルチファクターモデル^(注2)を用いるとともに、残存年限別構成比率等をチェックします。

外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行いません。

- ◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル^(注3)を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行いません。なお、保有外貨建資産については、同インデックスに連動させるため為替ヘッジを行いません。

※為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

※マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引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。

外国債券インデックス (為替ヘッジなし)

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をめざして運用を行いません。

- ◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル^(注3)を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行いません。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。

(注2) マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。

同モデルにより、イールドカーブファクター、スプレッドファクター、スペシフィックファクターなどについてリスクの計測、分析、推定を行ない、ポートフォリオを効率的に構築および管理します。

(注3) リスクモデルでは、個別債券のキャッシュフロー（利金と償還金）や価格変化を分析することにより、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なポートフォリオを構築することができます。

J-REITインデックス

東証REIT指数（配当込み）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。

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

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

外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

◆投資先のマザーファンドおよび連動する投資成果をめざす指数は以下のとおりです。

マザーファンド	連動する投資成果をめざす指数
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本） （円ベース）
先進国REITマザーファンド	—

※先進国REITマザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートおよびETFの組入総額ならびにリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

◆保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

◆為替ヘッジは一定間隔で行なうため、保有実質外貨建資産とヘッジ金額が一致するとは限りません。

※為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

※運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

◆為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

※運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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、ファンドの特色2.の運用が行なわれないことがあります。

●特定の指数について

◆東証株価指数（TOPIX）

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

◆日経平均株価（日経225）

日本経済新聞社が発表している株価指標で、東京証券取引所第一部上場銘柄のうち市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。1950年から算出が開始された、わが国の株式市場全体の動向を示す代表的な指標の一つです。

◆MSCIコクサイ指数

MSCIコクサイ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。

◆ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数

ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。日本で発行されている確定利付公募債券で、残存額が50億円以上、残存期間が1年以上である国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

◆FTSE世界国債インデックス

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

◆東証REIT指数（配当込み）

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

◆S&P先進国REIT指数

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

3 毎年6月15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。

（注）第1計算期間は、2017年6月15日（休業日の場合翌営業日）までとします。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。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。

主な投資制限

●TOPIXインデックス

●日経225インデックス

- ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- ③外貨建資産への投資は、行ないません。

●外国株式インデックス（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし）

- ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

●日本債券インデックス

- ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ③外貨建資産への投資は、行ないません。

●外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

- ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式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。
- ③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外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

●外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

- ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

●J-REITインデックス

- ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式への直接投資は、行ないません。
- ③マザーファンドを通じて行なう投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ④外貨建資産への直接投資は、行ないません。

●外国REITインデックス（為替ヘッジあり／なし）

- ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

●基準価額の動きに関する留意点

各ファンド*は、特定の指数の動きに連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行いません。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

*「外国REITインデックス（為替ヘッジあり）」および「外国REITインデックス（為替ヘッジなし）」を除きます。

TOPIXインデックス

日経225インデックス

外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

- 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れない場合があること
- 運用管理費用（信託報酬）、売買委託手数料等の費用負担
- 株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- 指数の算出に使用する株価と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- 指数の算出に使用する為替レートと基準価額の算出に使用する為替レートの不一致*
- 株価指数先物と指数の動きの不一致（先物を利用した場合）
- 株式および株価指数先物取引の最低取引単位の影響
- 株式および株価指数先物の流動性低下時における売買対応の影響
- 指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響

*「TOPIXインデックス」および「日経225インデックス」を除きます。

日本債券インデックス

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

- 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れるわけではないこと
- 基準価額の算出に使用する為替レートと、指数の算出に使用する為替レートの評価時点が異なること*
- 運用管理費用（信託報酬）等を負担することによる影響
- 追加設定および解約に対応した公社債の約定価格と指数の算出に使用する価格の差
- 債券先物取引等を利用した場合の指数との値動きの差、コストなど
- 公社債および債券先物取引等の最低取引単位の影響
- 公社債または債券先物取引等の流動性が低下した場合における売買対応の影響

*「日本債券インデックス」を除きます。

J-REITインデックス

- 東証REIT指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れない場合があること
- 運用管理費用（信託報酬）、売買委託手数料等を負担することによる影響
- 追加設定および解約に対応して行なったJリート売りの約定価格と東証REIT指数の算出に使用する価格の差
- Jリエットの銘柄数、市場規模が限られること
- 不動産投信指数先物と指数の動きの不一致（先物を利用した場合）
- Jリートおよび不動産投信指数先物の流動性が低下した場合における売りの影響
- Jリートおよび不動産投信指数先物取引の最低取引単位の影響
- 東証REIT指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響
- 追加設定および組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること

*税法その他の法規上の規制や組入銘柄の財務リスクや流動性などの理由から、東証REIT指数の採用銘柄をすべて組入れない場合や時価総額に応じた組入れを行わない場合があります。

●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

- TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、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㈱東京証券取引所が有します。
- ㈱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。
- ㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 「TOPIXインデックス」は、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ㈱東京証券取引所は、「TOPIXインデックス」の購入者または公衆に対し、「TOPIXインデックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ㈱東京証券取引所は、当社または「TOPIXインデックス」の購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は「TOPIXインデックス」の発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

- 「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算出する手法に対して著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- 「日経」および「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべて株式会社日本経済新聞社に帰属しています。
- 「日経225インデックス」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。
- 株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。
- 株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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

FTSE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。

- 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。
- (株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- (株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をすることはできません。
- (株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 「J-REITインデックス」は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- (株)東京証券取引所は、「J-REITインデックス」の購入者または公衆に対し、「J-REITインデックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- (株)東京証券取引所は、当社または「J-REITインデックス」の購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は「J-REITインデックス」の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2017年2月16日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）	
お取扱窓口	販売会社 大和証券株式会社	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。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
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。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など

運用指図	2	損益 信託金 (3)	
受託会社	<p><日経225インデックス> みずほ信託銀行株式会社 再信託受託会社： 資産管理サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行いません。 なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>	
	<p><上記以外の各ファンド> 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</p>	<p>信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行いません。 なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>	

損益 投資

投資対象	<p>ファミリーファンド方式で運用を行いません。 <TOPIXインデックス> 東京証券取引所第一部上場株式(上場予定を含みます。) など <日経225インデックス> わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄 など <外国株式インデックス(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)> 外国の株式(DR(預託証券)を含みます。) など <日本債券インデックス> わが国の公社債 など <外国債券インデックス(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)> 外国の公社債 など <J-REITインデックス> わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券 など <外国REITインデックス(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)> 海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券 など</p>
------	--

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

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

<委託会社の概況(2018年6月末日現在)>

- ・資本金の額 151億7,427万2,500円
- ・沿革

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

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

ファンド名	主要投資対象
TOPIXインデックス	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
日経225インデックス	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券
外国株式インデックス (為替ヘッジあり)	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券
外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
日本債券インデックス	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの受益証券
外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
J-REITインデックス	ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
外国REITインデックス (為替ヘッジあり)	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券 および先進国REITマザーファンドの受益証券
外国REITインデックス (為替ヘッジなし)	

以下、各ファンドにおいて(「外国REITインデックス(為替ヘッジあり)」および「外国REITインデックス(為替ヘッジなし)」は総称して)「マザーファンド」といいます。

投資態度

<TOPIXインデックス>

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．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50%以下とします。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<日経225インデックス>

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を日経平均株価（日経225）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．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50%以下とします。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式（DR（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（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．マザーファンドにおいて、保有する外貨建資産については為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式（DR（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います。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

<日本債券インデックス>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合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。

ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

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時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、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、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

ロ．マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドにおいて、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ハ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ニ．マザーファンドにおいて、投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないます。

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

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、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います。

ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

<J-REITインデックス>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果を東証REIT指数(配当込み、以下同じ。)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

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時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（「ダイワ」-REITマザーファンド）を通じて実質的に投資します。）
選定の方針	投資成果を東証REIT指数の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は東証REIT指数の構成銘柄であること。

くわしくは前掲「1 ファンドの性格（1）ファンドの目的及び基本的性格<ファンドの特色>」および後掲「<参考>マザーファンド（ダイワ）-REITマザーファンド」の概要をご参照下さい。

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ．保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

保有実質外貨建資産とは、当ファンドが保有する外貨建資産およびマザーファンドが保有する外貨建資産のうち当ファンドに属するとみなした外貨建資産をいいます。

ハ．運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、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】

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし) >

当ファンドにおいて投資の対象とする資産(「T O P I X インデックス」、「日経 2 2 5 インデックス」および「日本債券インデックス」は本邦通貨表示のものに限ります。)の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)、 、 、 および に定めるものに限ります。)

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、「日経 2 2 5 インデックス」は、みずほ信託銀行株式会社、「日経 2 2 5 インデックス」以外の各ファンドは三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし) >

1. 株券または新株引受権証書

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

1. 転換社債の転換、新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことを

あらかじめ明確にしているもの(以下、会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の新株予約権に限り
ます。)の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし) >

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

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

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

す。)

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)

20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前14.の証券のうち投資法人債券ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券（新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

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。

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
13. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
16. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
17. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債

券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

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。

< J - R E I T インデックス >

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、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) に定めるものに限ります。）
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、主として、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ダイワ J - R E I T マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券の性質を有するもの
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。）

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

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

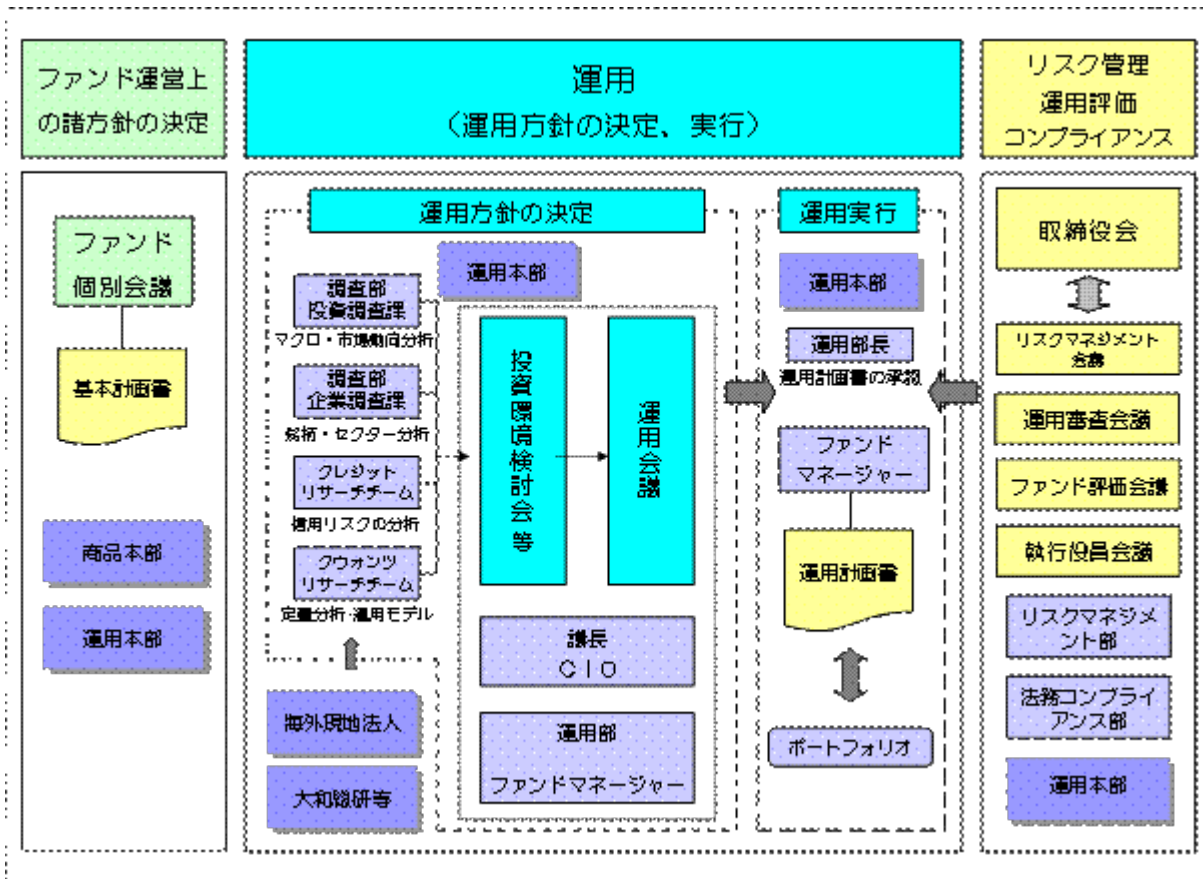
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

<各ファンド共通>

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

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

受託会社に対する管理体制

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

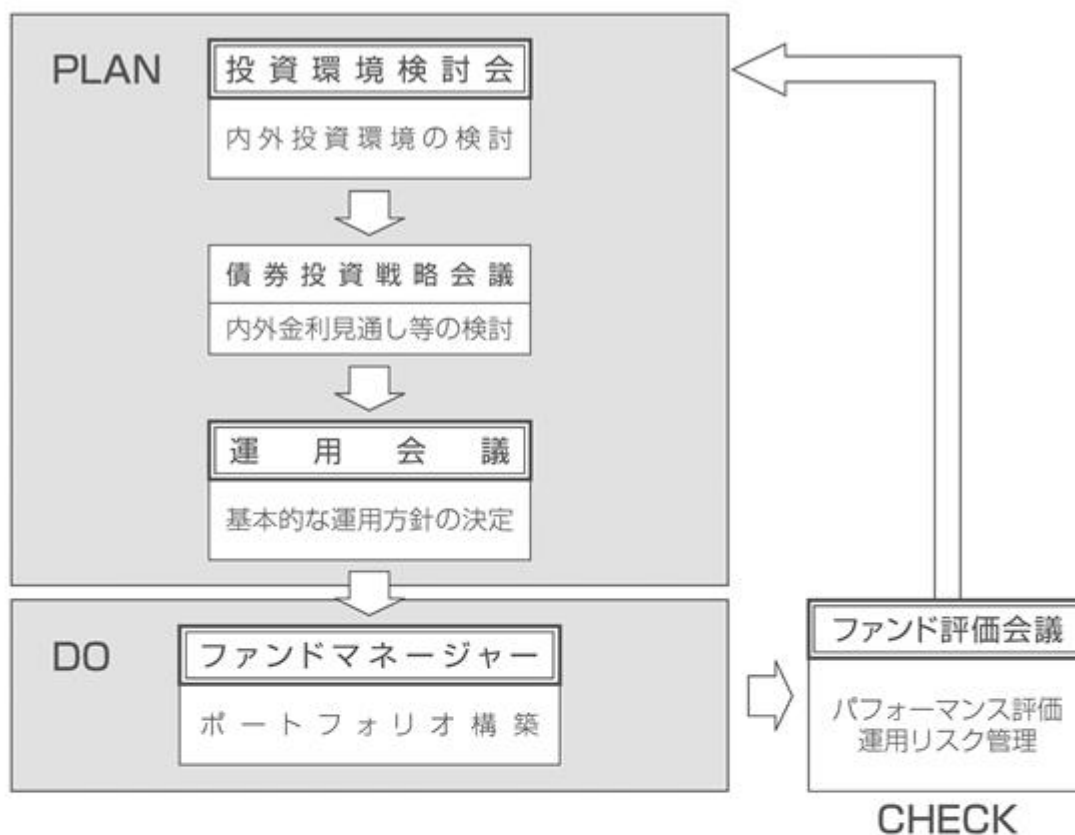
上記の運用体制は2018年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

<運用プロセスについて>

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

**PLAN**

投資環境検討会では、主にマクロ分析を基に内外投資環境について検討します。債券投資戦略会議では、内外金利の動向について検討し、金利見通しを策定します。運用会議で、基本的な運用方針を決定し、これを踏まえてファンドマネージャーがファンドの運用方針を策定し、運用部長が承認します。

DO

ファンドマネージャーは、承認された運用方針に基づきポートフォリオを構築します。

CHECK

ファンド評価会議でパフォーマンス評価、ファンドの運用リスク分析を行ない、運用ヘフィードバックを行ないます。

(4) 【分配方針】

<各ファンド共通>

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。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。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

<各ファンド共通>

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式（信託約款）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） >

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

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

ロ．委託会社は、信託財産に属する株式および株式を組入可能な投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式および株式を組入可能な投資信託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30を超えることとなる投資の指図をしません。

ハ．前ロ．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および株式を組入可能な投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

< 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

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

ロ．委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式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。

ハ．前ロ．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の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

< J - R E I T インデックス >

株式への直接投資は、行ないません。

新株引受権証券等（信託約款）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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。

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

投資信託証券（信託約款）

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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。

<J-REITインデックス>

マザーファンドを通じて行なう投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

投資する株式等の範囲（信託約款）

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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。

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。

<外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、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。

<J-REITインデックス>

(規定なし)

同一銘柄の新株引受権証券等(信託約款)

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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。

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

信用取引(信託約款)

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<日本債券インデックス>

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るものとします。

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

先物取引等（信託約款）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

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

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

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） >

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

ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨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。

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

< J - R E I T インデックス >

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

スワップ取引(信託約款)

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<日本債券インデックス>

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(以下本八.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.前八.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。

<外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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(以下本八.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．前八．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。

< J - R E I T インデックス >

(規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

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(以下本八．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(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。)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(以下本八．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．前八．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．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。

ヘ．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。

< 上記以外の各ファンド >

(規定なし)

金利先渡取引および為替先渡取引(信託約款)

- <外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>
- <外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>
- <外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>
- <外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>
- <外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>
- <外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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。

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

直物為替先渡取引(信託約款)

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

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、直物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．直物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．直物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。

ニ．委託会社は、直物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。

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

デリバティブ取引等(信託約款)

<各ファンド共通>

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。

有価証券の貸付け(信託約款)

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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、公社債および投資信託証券を次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。

3. 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

ロ．前イ．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。

< J - R E I T インデックス >

(規定なし)

外貨建資産(信託約款)

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

外貨建資産への投資は、行ないません。

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし) >

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

< J - R E I T インデックス >

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし) >

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。

< 上記以外の各ファンド >

(規定なし)

外国為替予約取引(信託約款)

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし) >

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．前イ．の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．前ロ．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約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の買予約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為替の売予約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の売予約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。

ニ．前ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

信用リスク集中回避（信託約款）

<各ファンド共通>

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

資金の借入れ（信託約款）

<各ファンド共通>

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、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．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

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	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ないます。
---------	--

主要投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。
投資態度	<p>投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。</p> <p>イ．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。</p> <p>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。</p> <p>ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。</p>
主な投資制限	<p>株式 株式への投資には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等 イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>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。</p> <p>ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

ストックインデックス225・マザーファンド

運用の基本方針	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、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を主要投資対象とします。

投資態度	<p>イ．投資成果を日経平均株価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。</p> <p>1．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行いません。</p> <p>2．株式の組入比率は、高位を保ちます。</p> <p>ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、日経平均株価が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等</p> <p>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。）</p> <p>ロ．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わが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引</p> <p>イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>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。</p> <p>ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主として海外の株式(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(円ヘッジ・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。</p> <p>保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。</p> <p>運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>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。</p>
------	--

<p>主な投資制限</p>	<p>株式 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券等 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、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。</p> <p>投資信託証券 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等 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投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等 イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。 ロ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。</p>
---------------	---

	<p>ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとし ます。</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本 の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一 部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の 想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会 社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するもの とします。</p> <p>ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額 で行なうものとします。</p> <p>ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供ある いは受入れが必要と認められたときは、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。</p>
--	---

外国株式インデックスマザーファンド

運用の基本方針	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。
主要投資対象	外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

日本債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数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。
---------	--

主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>イ．主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数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。</p> <p>ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は、行ないません。</p>

外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

運用の基本方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>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、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。</p> <p>ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ハ．投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないます。</p> <p>ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

主な投資制限

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。</p> <p>ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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。</p>
--	---

外国債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	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。
主要投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

ダイワJ-REITマザーファンド

運用の基本方針	東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」（配当込み、以下同じ。）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
---------	--

主要投資対象	<p>わが国の金融商品取引所（ ）上場（上場予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。</p>
投資態度	<p>イ．東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>ロ．投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。</p> <p>ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、「東証REIT指数」が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式</p> <p>株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>投資信託証券</p> <p>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券</p> <p>同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、当該同一銘柄の「東証REIT指数」における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</p> <p>外貨建資産</p> <p>外貨建資産への直接投資は、行ないません。</p> <p>先物取引</p> <p>委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p>

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

運用の基本方針	<p>S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。</p>
主要投資対象	<p>海外の金融商品取引所（ ）上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。</p>

投資態度	<p>イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。</p> <p>ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。</p> <p>ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ニ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。</p> <p>ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引</p> <p>委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p>

先進国REITマザーファンド

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	<p>イ．先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）または店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。）</p> <p>ロ．先進国のリート指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</p> <p>ハ．先進国のリートを対象としたリート指数先物取引</p> <p>ニ．国内の債券</p>
投資態度	<p>イ．主として、先進国のリート、先進国のリート指数を対象指数としたETF、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引および残存期間の短いわが国の債券に投資し、先進国のリート市場の中長期的な値動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行いません。</p> <p>一部日本のリートを含む指数を対象とするETFを組入れる場合があります。</p> <p>ロ．運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートおよびETFの組入総額ならびにリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p> <p>ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等 イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。 ロ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。</p> <p>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。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。</p>
---------------	---

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.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。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、主として、特定の有価証券を実質的な投資対象としますので、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。

< TOPIXインデックス >

< 日経225インデックス >

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。

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。

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容）

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。

保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

ロ．カントリー・リスク

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

その他

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容）

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

なお、当ファンドにおいては、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。そのため基準価額は、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。

その他

（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの と同内容）

<日本債券インデックス>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

その他

（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの と同内容）

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（日本債券インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

（外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の と同内容）

その他

（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの と同内容）

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（日本債券インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

（外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の と同内容）

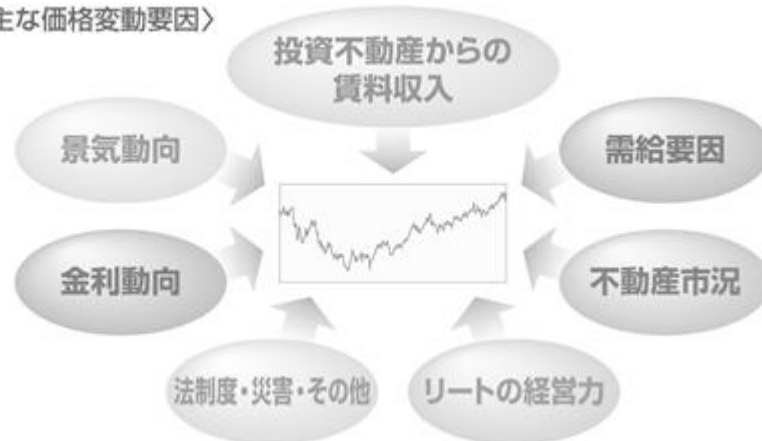
その他

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容）

< J - R E I Tインデックス >

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リーートの主な価格変動要因〉



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

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

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

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

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

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

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

その他

(T O P I X インデックスおよび日経 2 2 5 インデックスの と同内容)

< 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり) >

リート (不動産投資信託) への投資に伴うリスク

(J - R E I T インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(外国株式インデックス (為替ヘッジあり) の と同内容)

その他

(T O P I X インデックスおよび日経 2 2 5 インデックスの と同内容)

< 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) >

リート (不動産投資信託) への投資に伴うリスク

(J - R E I T インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(外国株式インデックス (為替ヘッジなし) の と同内容)

その他

(T O P I X インデックスおよび日経 2 2 5 インデックスの と同内容)

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止 (「 T O P I X インデックス」、 「日経 2 2 5 インデックス」、 「日本債券インデックス」および「 J - R E I T インデックス」を除きます。) その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付けの申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

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 (「 T O P I X インデックス」、 「日経 2 2 5 インデックス」、 「日本債券インデックス」および「 J - R E I T インデックス」を除きます。) その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

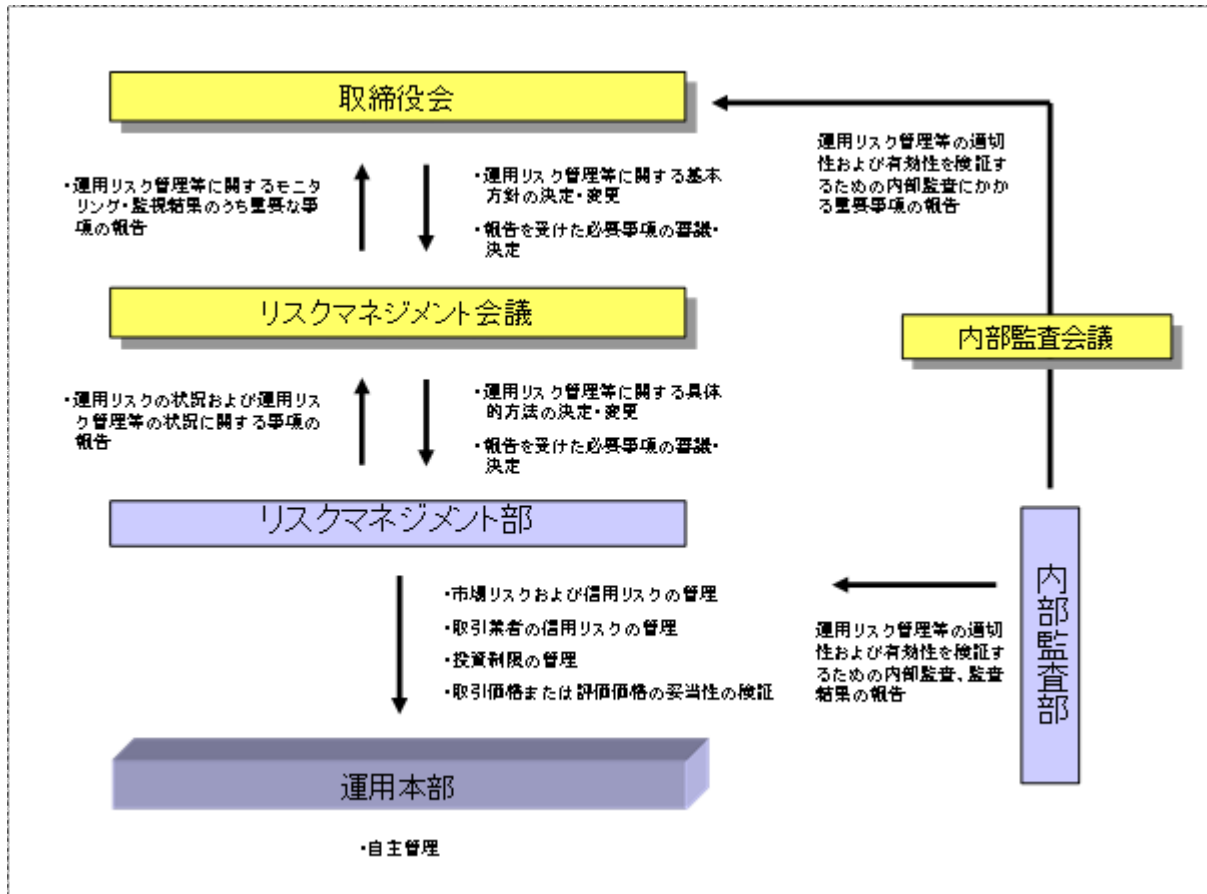
(3) その他の留意点

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。

指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映することができないことについては、 < ファンドの特色 > の「 基準価額の動きに関する留意点 」をご参照下さい。

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

参考情報

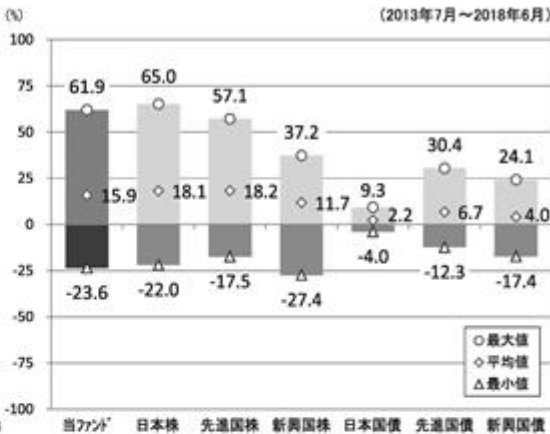
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

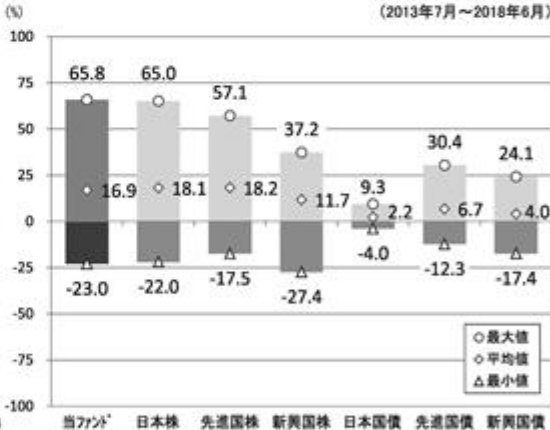
[TOPIXインデックス]



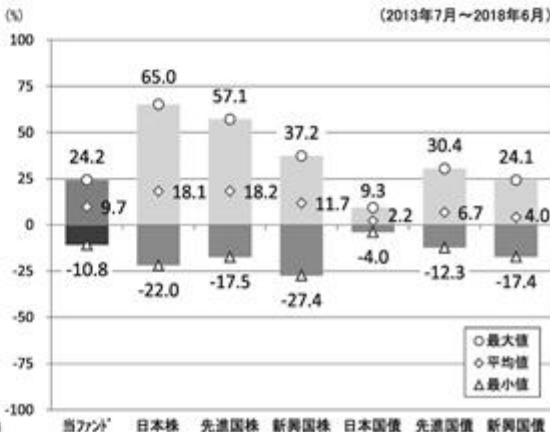
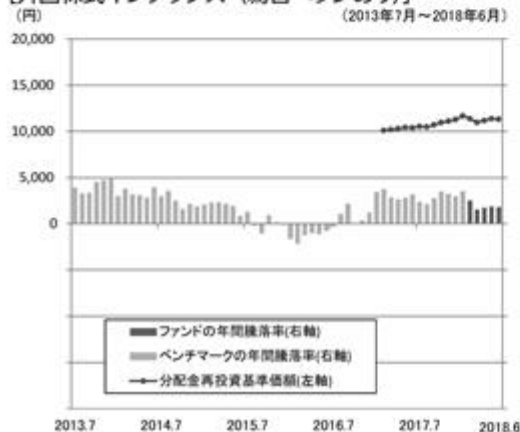
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



[日経225インデックス]

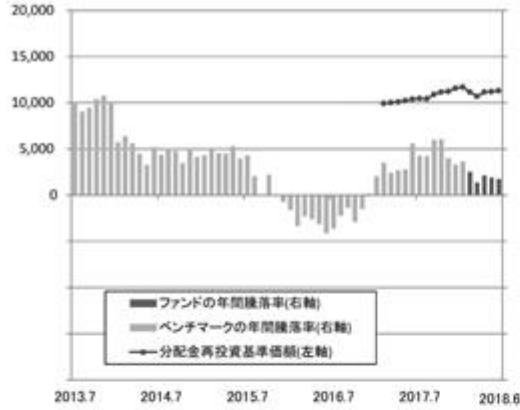


[外国株式インデックス (為替ヘッジあり)]

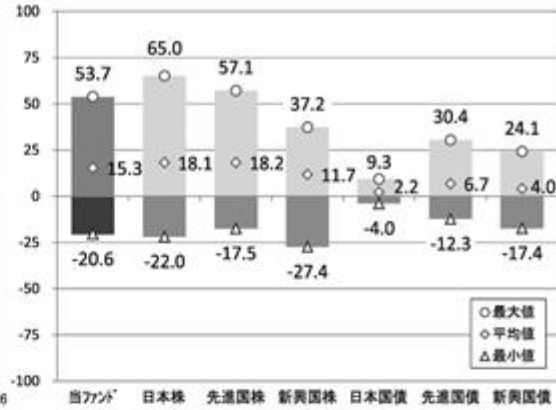


[外国株式インデックス (為替ヘッジなし)]

(円) (2013年7月～2018年6月)

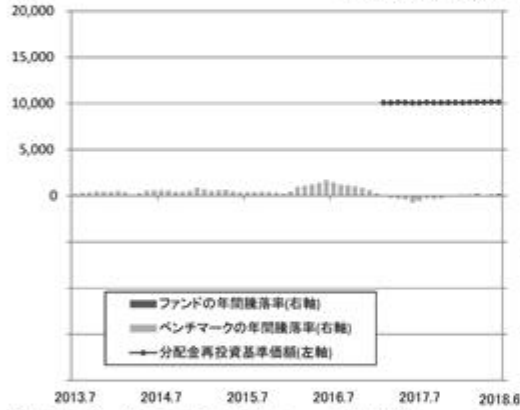


(2013年7月～2018年6月)

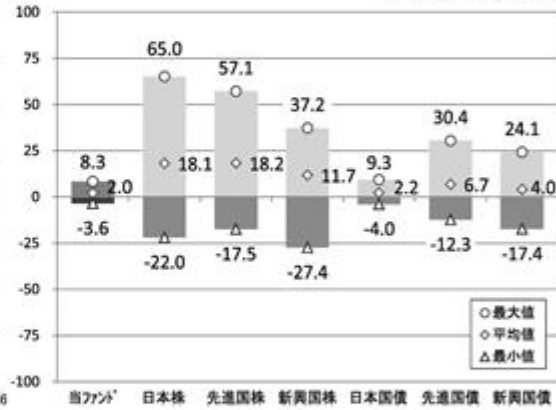


[日本債券インデックス]

(円) (2013年7月～2018年6月)

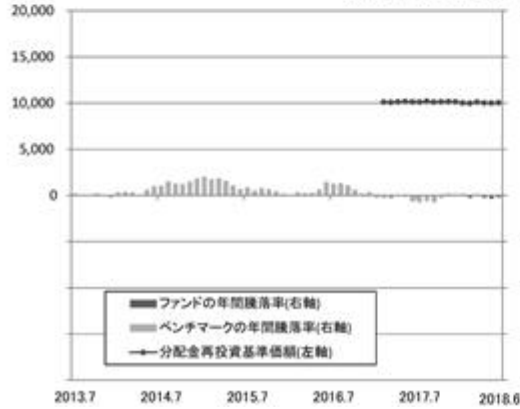


(2013年7月～2018年6月)

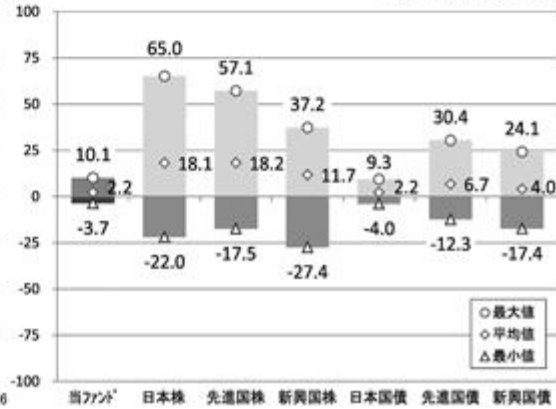


[外国債券インデックス (為替ヘッジあり)]

(円) (2013年7月～2018年6月)

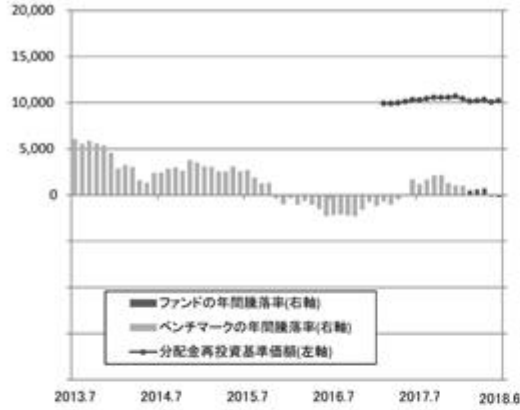


(2013年7月～2018年6月)

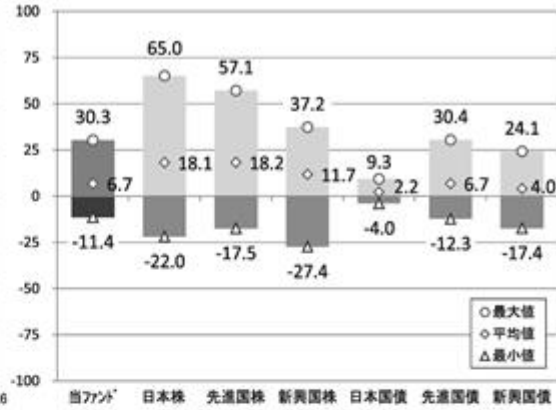


[外国債券インデックス（為替ヘッジなし）]

(円) (2013年7月～2018年6月)

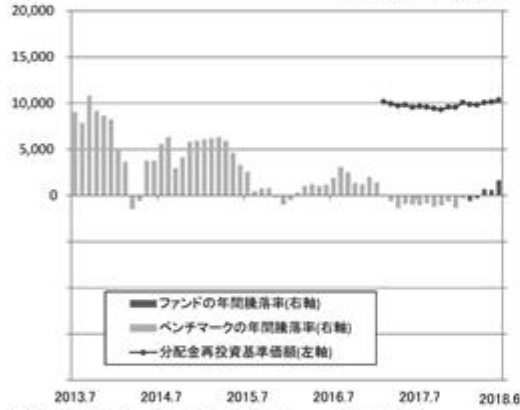


(2013年7月～2018年6月)

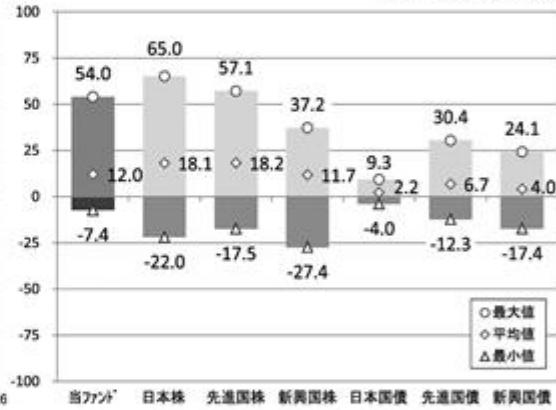


[J-REITインデックス]

(円) (2013年7月～2018年6月)

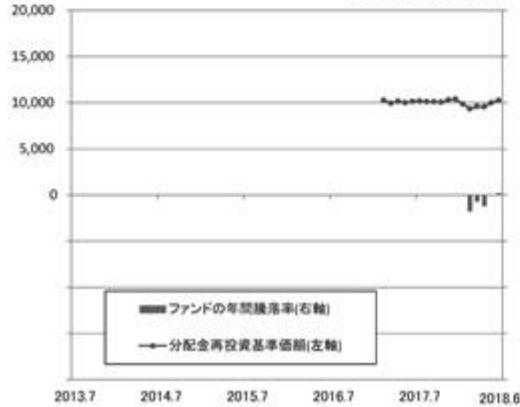


(2013年7月～2018年6月)

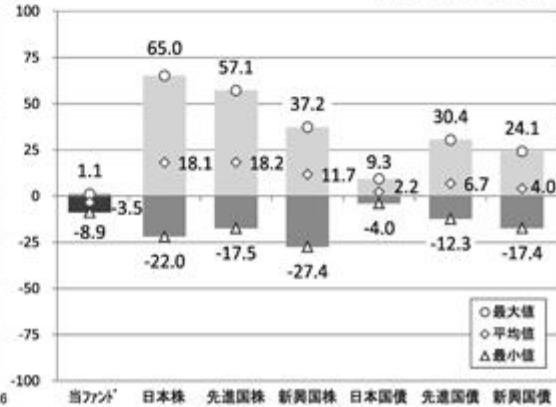


[外国REITインデックス（為替ヘッジあり）]

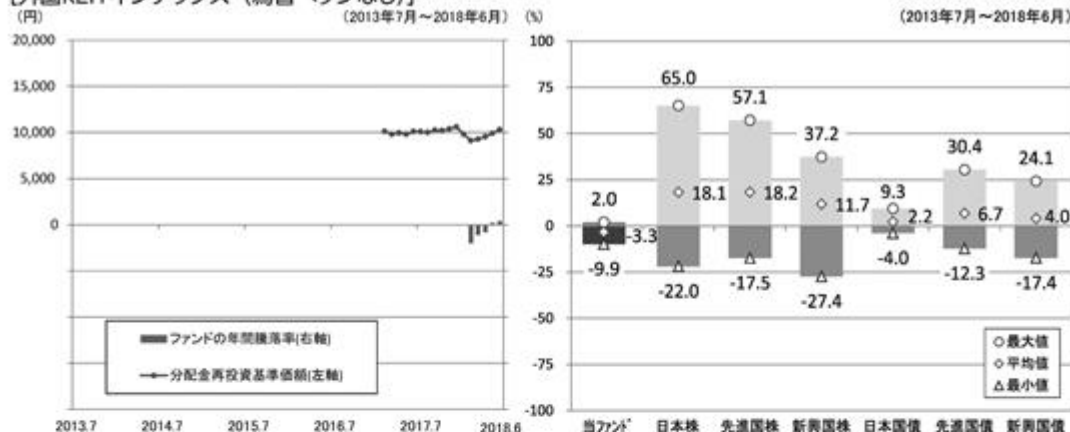
(円) (2013年7月～2018年6月)



(2013年7月～2018年6月)



【外国REITインデックス（為替ヘッジなし）】



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

・お電話によるお問い合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

申込手数料には、消費税等が課されます。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

ファンド名	信託報酬率
TOPIXインデックス	年率0.3348%(税抜0.31%)
日経225インデックス	
外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	年率0.4374%(税抜0.405%)
外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	
日本債券インデックス	年率0.3294%(税抜0.305%)以内()
外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	年率0.4104%(税抜0.38%)
外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	
J-REITインデックス	年率0.3348%(税抜0.31%)
外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	年率0.4266%(税抜0.395%)
外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	

()毎月10日(休業日の場合翌営業日)(当初設定日から2017年3月10日(休業日の場合翌営業日)までの期間については当初設定日の前営業日)における新発10年国債の利回り(日本相互証券株式会社発表の終値)に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。

(新発10年国債利回りが)

イ.1%未満の場合 年率0.1458%(税抜0.135%)

ロ.1%以上の場合 年率0.3294%(税抜0.305%)

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

< TOPIXインデックス >

< 日経225インデックス >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.19%	年率0.10%	年率0.02%
(税抜)	(税抜)	(税抜)

<外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.285% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

<日本債券インデックス>

	委託会社	販売会社	受託会社
前 イ.の場合	年率0.075%(税抜)	年率0.05%(税抜)	年率0.01%(税抜)
前 ロ.の場合	年率0.185%(税抜)	年率0.10%(税抜)	年率0.02%(税抜)

<外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.26% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

<J-REITインデックス>

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.19% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.275% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20% (所得税15%および地方税5%) の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用があります(「TOPIXインデックス」および「日経225インデックス」のみ。))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。

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

（ ）上記は、2018年6月末現在のものですので、税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】

【ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）】

(1) 【投資状況】（平成30年6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	97,419,201	99.99
内 日本	97,419,201	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,929	0.01
純資産総額	97,425,130	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30年6月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	89,482,136	1.1237 100,554,681	1.0887 97,419,201	99.99

(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	99.99%
合計	99.99%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月15日)	4,156,052	4,168,187	1.0274	1.0304
平成29年6月末日	4,224,416	-	1.0443	-
7月末日	4,242,344	-	1.0488	-
8月末日	4,239,841	-	1.0482	-
9月末日	4,422,813	-	1.0934	-
10月末日	4,661,253	-	1.1523	-
11月末日	4,730,072	-	1.1693	-
12月末日	4,801,016	-	1.1869	-
平成30年1月末日	4,850,086	-	1.1990	-
2月末日	98,559,044	-	1.1547	-
3月末日	96,524,993	-	1.1308	-
4月末日	99,947,636	-	1.1709	-
5月末日	98,295,599	-	1.1516	-
第2計算期間末 (平成30年6月15日)	99,679,256	100,618,182	1.1678	1.1788
6月末日	97,425,130	-	1.1310	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0030
第2計算期間	0.0110

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.0
第2計算期間	14.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	3,045,067	0
第2計算期間	81,311,932	0

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成30年6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	142,485,399,480	99.37
内 日本	142,485,399,480	99.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	897,453,694	0.63
純資産総額	143,382,853,174	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)	899,860,000	0.63
内 日本	899,860,000	0.63

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

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

(注3) 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30年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	701,000	6,749.39 4,731,326,104	7,170.00 5,026,170,000	3.51
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	3,980,000	707.63 2,816,377,440	631.10 2,511,778,000	1.75

3	ソニー	日本	株式	電気機器	386,300	4,349.05 1,680,039,769	5,664.00 2,188,003,200	1.53
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	256,500	8,882.16 2,278,274,673	7,973.00 2,045,074,500	1.43
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	405,800	5,131.25 2,082,261,731	5,036.00 2,043,608,800	1.43
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	430,100	4,296.06 1,847,736,002	4,306.00 1,852,010,600	1.29
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	28,300	60,368.12 1,708,417,813	62,560.00 1,770,448,000	1.23
8	本田技研	日本	株式	輸送用機器	518,200	3,306.71 1,713,540,615	3,253.00 1,685,704,600	1.18
9	KDDI	日本	株式	情報・通信業	498,300	2,977.01 1,483,444,654	3,031.00 1,510,347,300	1.05
10	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,720,700	195.67 1,510,785,424	186.50 1,439,910,550	1.00
11	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	426,100	2,495.55 1,063,356,267	3,066.00 1,306,422,600	0.91
12	任天堂	日本	株式	その他製品	35,500	41,008.87 1,455,815,207	36,200.00 1,285,100,000	0.90
13	三菱商事	日本	株式	卸売業	398,500	2,638.97 1,051,633,166	3,078.00 1,226,583,000	0.86
14	ファナック	日本	株式	電気機器	54,800	22,828.20 1,250,985,528	22,005.00 1,205,874,000	0.84
15	花王	日本	株式	化学	141,900	6,911.40 980,728,775	8,450.00 1,199,055,000	0.84
16	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	51,900	19,651.65 1,019,921,044	22,960.00 1,191,624,000	0.83
17	日本電産	日本	株式	電気機器	69,500	13,866.03 963,689,662	16,625.00 1,155,437,500	0.81
18	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	237,900	4,421.55 1,051,887,601	4,831.00 1,149,294,900	0.80
19	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	405,500	2,593.72 1,051,755,529	2,822.50 1,144,523,750	0.80
20	村田製作所	日本	株式	電気機器	60,500	17,172.06 1,038,909,976	18,620.00 1,126,510,000	0.79
21	キヤノン	日本	株式	電気機器	309,200	3,837.96 1,186,699,826	3,631.00 1,122,705,200	0.78
22	東京海上HD	日本	株式	保険業	214,000	4,552.94 974,330,046	5,193.00 1,111,302,000	0.78

23	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	358,200	3,690.16 1,321,816,254	3,095.00 1,108,629,000	0.77
24	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	103,900	10,206.95 1,060,502,539	10,615.00 1,102,898,500	0.77
25	日立	日本	株式	電気機器	1,385,000	793.61 1,099,160,776	781.60 1,082,516,000	0.75
26	ダイキン工業	日本	株式	機械	78,800	11,396.10 898,013,426	13,270.00 1,045,676,000	0.73
27	武田薬品	日本	株式	医薬品	212,700	6,146.14 1,307,286,042	4,678.00 995,010,600	0.69
28	パナソニック	日本	株式	電気機器	658,400	1,647.12 1,084,470,328	1,493.50 983,320,400	0.69
29	信越化学	日本	株式	化学	99,500	10,178.31 1,012,742,556	9,873.00 982,363,500	0.69
30	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	567,300	1,471.65 834,868,755	1,689.00 958,169,700	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
株式	99.37%
合計	99.37%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.12%
鉱業	0.29%
建設業	3.16%
食料品	4.47%
繊維製品	0.66%
パルプ・紙	0.26%
化学	7.38%
医薬品	4.72%
石油・石炭製品	0.77%
ゴム製品	0.81%
ガラス・土石製品	0.99%
鉄鋼	1.02%
非鉄金属	0.84%

金属製品	0.62%
機械	5.12%
電気機器	13.58%
輸送用機器	8.55%
精密機器	1.71%
その他製品	2.07%
電気・ガス業	1.75%
陸運業	4.34%
海運業	0.18%
空運業	0.57%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	7.44%
卸売業	4.72%
小売業	5.00%
銀行業	6.62%
証券、商品先物取引業	0.92%
保険業	2.25%
その他金融業	1.21%
不動産業	2.43%
サービス業	4.61%
合計	99.37%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2018年9月	買建	52	929,268,080	899,860,000	0.63%

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

(注2) 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。

（参考情報）運用実績

●TOPIXインデックス

2018年6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



※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: 110円				設定来分配金合計額: 140円			
	第1期 17年6月	第2期 18年6月						
分配金	30円	110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。

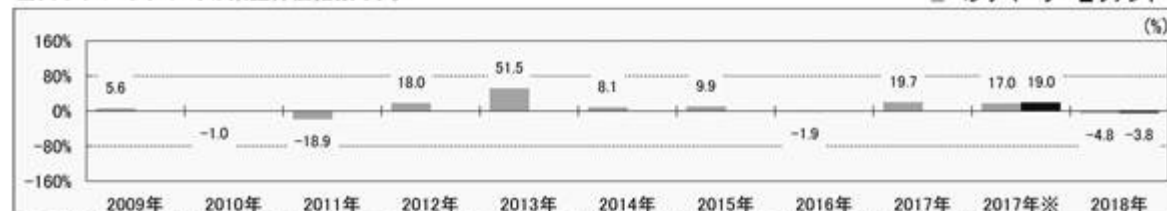
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,498	99.4%	電気機器	13.6%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.5%
国内株式先物	1	0.6%	輸送用機器	8.6%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.8%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.4%	ソニー	電気機器	1.5%
コール・ローン、その他	-	0.6%	化学	7.4%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.4%
合計	1,499	-	銀行業	6.6%	日本電信電話	情報・通信業	1.4%
株式市場・上場別構成			機械	5.1%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.3%
一部(東証・名証)		99.4%	小売業	5.0%	キーエンス	電気機器	1.2%
二部(東証・名証)		-	医薬品	4.7%	本田技研	輸送用機器	1.2%
新興市場他		-	卸売業	4.7%	KDDI	情報・通信業	1.1%
その他		-	その他	36.2%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.0%
合計		99.4%	合計	99.4%	合計		15.4%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■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※は設定日(2月16日)から年末、2018年は6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。

【ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】（平成30年6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	26,614,451	99.98
内 日本	26,614,451	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,551	0.02
純資産総額	26,619,002	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30年6月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ストックインデックス225・マザーファン ド	日本	親投資 信託受 益証券	9,747,812	2.7937 27,232,467	2.7303 26,614,451	99.98

(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	99.98%
合計	99.98%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月15日)	1,020,073	1,027,073	1.0201	1.0271
平成29年6月末日	1,031,610	-	1.0316	-
7月末日	1,025,734	-	1.0257	-
8月末日	1,011,723	-	1.0117	-
9月末日	1,054,591	-	1.0546	-
10月末日	1,140,440	-	1.1404	-
11月末日	1,177,317	-	1.1773	-
12月末日	1,180,635	-	1.1806	-
平成30年1月末日	27,533,136	-	1.1978	-
2月末日	26,322,403	-	1.1451	-
3月末日	25,773,407	-	1.1212	-
4月末日	26,993,181	-	1.1743	-
5月末日	26,671,229	-	1.1603	-
第2計算期間末 (平成30年6月15日)	27,240,569	27,447,452	1.1850	1.1940
6月末日	26,619,002	-	1.1580	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0070
第2計算期間	0.0090

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	17.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0

第2計算期間	21,987,038	0
--------	------------	---

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ストックインデックス225・マザーファンド

(1) 投資状況（平成30年6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	151,478,840,520	98.61
内 日本	151,478,840,520	98.61
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,128,392,875	1.39
純資産総額	153,607,233,395	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2,139,840,000	1.39
内 日本	2,139,840,000	1.39

(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30年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	252,000	34,543.12 8,704,867,926	50,910.00 12,829,320,000	8.35
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	756,000	8,839.50 6,682,668,059	7,973.00 6,027,588,000	3.92
3	ファナック	日本	株式	電気機器	252,000	23,287.19 5,868,373,120	22,005.00 5,545,260,000	3.61

4	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	252,000	17,650.84 4,448,014,003	19,020.00 4,793,040,000	3.12
5	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,512,000	2,946.22 4,454,690,922	3,031.00 4,582,872,000	2.98
6	ダイキン工業	日本	株式	機械	252,000	11,481.44 2,893,324,189	13,270.00 3,344,040,000	2.18
7	テルモ	日本	株式	精密機器	504,000	4,688.98 2,363,246,435	6,350.00 3,200,400,000	2.08
8	京セラ	日本	株式	電気機器	504,000	6,874.45 3,464,726,215	6,247.00 3,148,488,000	2.05
9	ユニー・ファミリーマートHD	日本	株式	小売業	252,000	6,180.96 1,557,604,008	11,660.00 2,938,320,000	1.91
10	T D K	日本	株式	電気機器	252,000	7,852.99 1,978,955,390	11,320.00 2,852,640,000	1.86
11	信越化学	日本	株式	化学	252,000	10,302.57 2,596,248,877	9,873.00 2,487,996,000	1.62
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	756,000	2,486.74 1,879,976,063	3,066.00 2,317,896,000	1.51
13	資生堂	日本	株式	化学	252,000	4,906.43 1,236,421,229	8,798.00 2,217,096,000	1.44
14	セコム	日本	株式	サービス業	252,000	8,269.06 2,083,804,584	8,507.00 2,143,764,000	1.40
15	花王	日本	株式	化学	252,000	7,003.65 1,764,920,284	8,450.00 2,129,400,000	1.39
16	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	1,260,000	1,478.64 1,863,090,187	1,689.00 2,128,140,000	1.39
17	日東電工	日本	株式	化学	252,000	9,577.75 2,413,595,073	8,383.00 2,112,516,000	1.38
18	エーザイ	日本	株式	医薬品	252,000	5,961.78 1,502,369,353	7,804.00 1,966,608,000	1.28
19	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	252,000	6,787.58 1,710,472,372	7,170.00 1,806,840,000	1.18
20	本田技研	日本	株式	輸送用機器	504,000	3,351.08 1,688,947,024	3,253.00 1,639,512,000	1.07
21	NTTデータ	日本	株式	情報・通信業	1,260,000	1,195.11 1,505,847,395	1,276.00 1,607,760,000	1.05
22	トレンドマイクロ	日本	株式	情報・通信業	252,000	5,654.74 1,424,994,541	6,320.00 1,592,640,000	1.04
23	スズキ	日本	株式	輸送用機器	252,000	6,103.39 1,538,054,431	6,118.00 1,541,736,000	1.00

24	中外製薬	日本	株式	医薬品	252,000	4,795.96 1,208,582,015	5,810.00 1,464,120,000	0.95
25	ヤマハ	日本	株式	その他製 品	252,000	4,038.25 1,017,639,355	5,760.00 1,451,520,000	0.94
26	塩野義製薬	日本	株式	医薬品	252,000	5,904.42 1,487,915,087	5,691.00 1,434,132,000	0.93
27	アサヒグループホール ディン	日本	株式	食料品	252,000	4,729.89 1,191,933,994	5,672.00 1,429,344,000	0.93
28	ソニー	日本	株式	電 気 機 器	252,000	4,446.12 1,120,424,193	5,664.00 1,427,328,000	0.93
29	コナミホールディングス	日本	株式	情報・通 信業	252,000	5,616.58 1,415,380,068	5,640.00 1,421,280,000	0.93
30	キッコーマン	日本	株式	食料品	252,000	3,659.92 922,300,546	5,590.00 1,408,680,000	0.92

(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	98.61%
合計	98.61%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.16%
鉱業	0.08%
建設業	2.72%
食料品	4.81%
繊維製品	0.25%
パルプ・紙	0.14%
化学	8.85%
医薬品	7.65%
石油・石炭製品	0.40%
ゴム製品	0.90%
ガラス・土石製品	1.53%
鉄鋼	0.18%
非鉄金属	1.17%
金属製品	0.36%
機械	4.92%

電気機器	18.22%
輸送用機器	5.75%
精密機器	3.17%
その他製品	1.29%
電気・ガス業	0.23%
陸運業	2.30%
海運業	0.11%
空運業	0.07%
倉庫・運輸関連業	0.20%
情報・通信業	10.22%
卸売業	2.19%
小売業	12.35%
銀行業	0.86%
証券、商品先物取引業	0.37%
保険業	0.94%
その他金融業	0.29%
不動産業	1.68%
サービス業	4.27%
合計	98.61%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	日経平均先物 2018年9月	買建	96	2,164,041,840	2,139,840,000	1.39%

(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。

(参考情報) 運用実績

●日経225インデックス

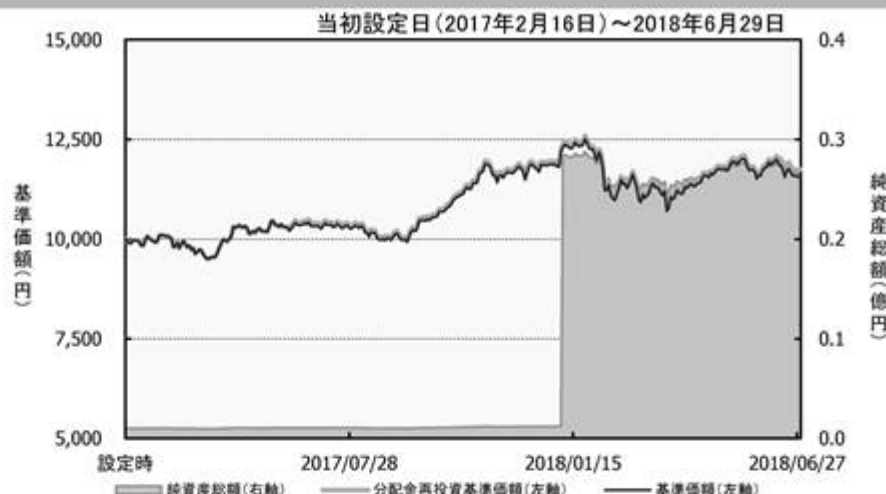
2018年6月29日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	11,580円
純資産総額	26百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.6%
3カ月間	4.1%
6カ月間	-1.2%
1年間	13.1%
3年間	-
5年間	-
設定来	17.5%



※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: 90円		設定来分配金合計額: 160円	
	第1期 17年6月	第2期 18年6月		
分配金	70円	90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。

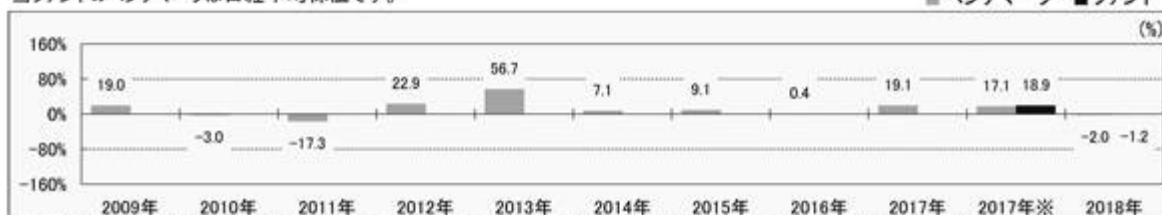
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	225	98.6%	電気機器	18.2%	ファーストリテイリング	小売業	8.4%
国内株式先物	1	1.4%	小売業	12.3%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.9%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	10.2%	ファナック	電気機器	3.6%
コール・ローン、その他	-	1.4%	化学	8.8%	東京エレクトロン	電気機器	3.1%
合計	226	-	医薬品	7.6%	KDDI	情報・通信業	3.0%
株式市場・上場別構成			輸送用機器	5.7%	ダイキン工業	機械	2.2%
一部(東証・名証)		98.6%	機械	4.9%	テルモ	精密機器	2.1%
二部(東証・名証)		-	食料品	4.8%	京セラ	電気機器	2.0%
新興市場他		-	サービス業	4.3%	ユニー・ファミリーマートHD	小売業	1.9%
その他		-	その他	21.6%	T D K	電気機器	1.9%
合計		98.6%	合計	98.6%	合計		32.1%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは日経平均株価です。

■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※は設定日(2月16日)から年末、2018年は6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。

【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】(平成30年6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	578,146,735	99.99
内 日本	578,146,735	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	69,117	0.01
純資産総額	578,215,852	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30年6月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	外国株式インデックス為替ヘッジ型 マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	313,358,664	1.8935 593,357,349	1.8450 578,146,735	99.99

(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	99.99%
合計	99.99%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月15日)	3,609,633	3,630,431	1.0413	1.0473
平成29年6月末日	3,577,382	-	1.0320	-
7月末日	3,625,619	-	1.0459	-
8月末日	3,604,549	-	1.0398	-
9月末日	3,687,351	-	1.0637	-
10月末日	3,775,666	-	1.0892	-
11月末日	3,821,259	-	1.1024	-
12月末日	3,888,240	-	1.1217	-
平成30年1月末日	25,973,605	-	1.1597	-
2月末日	218,984,238	-	1.1289	-
3月末日	318,749,966	-	1.0908	-
4月末日	715,209,034	-	1.1109	-
5月末日	982,933,486	-	1.1305	-
第2計算期間末 (平成30年6月15日)	1,333,520,140	1,345,180,653	1.1436	1.1536
6月末日	578,215,852	-	1.1140	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0060
第2計算期間	0.0100

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.7
第2計算期間	10.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,466,456	0
第2計算期間	1,162,584,923	0

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

(1) 投資状況（平成30年6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	33,530,760,215	97.04
内 香港	471,810,713	1.37
内 シンガポール	156,645,426	0.45
内 イスラエル	73,576,143	0.21
内 ノルウェー	100,348,021	0.29
内 スウェーデン	347,925,501	1.01
内 デンマーク	228,396,675	0.66
内 イギリス	2,370,132,452	6.86
内 アイルランド	73,265,518	0.21
内 オランダ	473,134,167	1.37
内 ベルギー	146,269,443	0.42
内 フランス	1,383,164,481	4.00
内 ドイツ	1,244,557,578	3.60
内 スイス	1,012,544,322	2.93
内 ボルトガル	18,858,007	0.05
内 スペイン	401,818,835	1.16
内 イタリア	322,285,092	0.93
内 フィンランド	141,746,680	0.41
内 オーストリア	31,003,534	0.09
内 カナダ	1,238,154,476	3.58
内 アメリカ	22,472,063,786	65.04
内 オーストラリア	795,096,808	2.30
内 ニューージーランド	27,766,004	0.08
内 非上場	196,553	0.00
投資証券	856,135,261	2.48
内 香港	28,362,043	0.08
内 シンガポール	15,351,716	0.04
内 イギリス	26,703,850	0.08
内 フランス	53,984,262	0.16
内 カナダ	6,205,551	0.02
内 アメリカ	638,179,659	1.85

内 オーストラリア	87,348,180	0.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	166,459,801	0.48
純資産総額	34,553,355,277	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)	689,187,313	1.99
内 イギリス	65,507,945	0.19
内 ドイツ	183,179,373	0.53
内 カナダ	79,779,213	0.23
内 アメリカ	285,582,854	0.83
内 オーストラリア	75,137,928	0.22
為替予約取引(売建)	34,841,700,793	100.83
内 日本	34,841,700,793	100.83

(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) 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30年6月29日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
					また は 額面金額			
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	44,142	19,219.47 848,389,727	20,505.17 905,139,214	2.62
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	63,672	9,871.77 628,561,768	10,902.56 694,187,813	2.01
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	3,578	144,295.48 516,289,489	188,078.28 672,944,097	1.95
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	20,818	20,525.61 427,303,169	21,691.26 451,568,738	1.31
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	29,728	12,134.41 360,734,570	11,598.96 344,813,948	1.00

6	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	36,852	9,403.19 346,528,032	9,060.96 333,914,638	0.97
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	2,656	122,119.17 324,348,673	123,165.87 327,128,574	0.95
8	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	2,561	122,495.89 313,712,021	124,554.26 318,983,463	0.92
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	22,984	15,659.42 359,916,358	13,485.88 309,959,466	0.90
10	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	85,090	3,353.00 285,308,912	3,169.18 269,665,679	0.78
11	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	40,806	6,762.06 275,934,164	5,928.26 241,908,586	0.70
12	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	16,661	13,926.05 232,022,200	13,890.45 231,428,894	0.67
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	11,020	22,471.78 247,639,426	20,680.92 227,903,833	0.66
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	15,517	13,208.75 204,960,990	14,673.07 227,682,176	0.66
15	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	63,461	3,981.31 252,660,956	3,558.28 225,812,172	0.65
16	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	8,266	25,046.81 207,037,207	27,071.24 223,770,919	0.65
17	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	40,199	4,950.20 198,997,488	5,444.09 218,847,175	0.63
18	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	25,666	9,210.02 236,386,929	8,460.14 217,138,056	0.63
19	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	10,009	21,197.92 212,170,089	21,578.51 215,979,341	0.63
20	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	51,016	4,009.61 204,559,379	4,019.23 205,045,262	0.59
21	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	42,366	4,449.23 188,496,859	4,746.58 201,093,930	0.58
22	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	35,473	5,655.33 200,612,348	5,622.06 199,431,490	0.58
23	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	21,656	9,834.30 212,973,347	8,627.64 186,840,323	0.54

24	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・サービス	4,977	35,829.44 178,323,234	36,992.21 184,110,234	0.53
25	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	8,011	17,953.46 143,825,625	21,787.43 174,539,134	0.51
26	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	166,922	1,094.69 182,731,066	1,026.29 171,312,018	0.50
27	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	35,429	5,063.72 179,402,881	4,805.17 170,242,503	0.49
28	NETFLIX INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	3,786	25,288.78 95,743,602	43,709.72 165,485,026	0.48
29	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	22,328	8,290.38 185,110,173	7,392.91 165,069,011	0.48
30	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	23,614	6,277.01 148,225,855	6,665.56 157,400,581	0.46

(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	97.04%
投資証券	2.48%
合計	99.52%

(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	7.30%
素材	4.76%
資本財・サービス	10.08%
一般消費財・サービス	12.01%
生活必需品	8.17%
ヘルスケア	12.53%
金融	16.99%
情報技術	19.23%
電気通信サービス	2.36%
公益事業	3.03%
不動産	0.57%
合計	97.04%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2018年9月	買建	19	290,310,428	285,582,854	0.83%
	イギリス	FT 100 2018年9月	買建	6	65,893,495	65,507,945	0.19%
	オーストラリア	SPI 200 INDEX 2018年9 月	買建	6	73,460,107	75,137,928	0.22%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX 2018 年9月	買建	5	79,853,472	79,779,213	0.23%
	ドイツ	SMI 2018年9月	買建	4	38,105,132	37,446,394	0.11%
		EURO STOXX 50 2018年9 月	買建	34	150,205,864	145,732,979	0.42%
為替予約取引	日本	香港ドル売/円買 2018年 7月	売建	35,027,100	485,773,336	493,181,568	1.43%
		イスラエル・シケル 売/円買 2018年7月	売建	1,467,100	44,994,753	44,321,091	0.13%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2018年7月	売建	7,557,200	100,547,790	101,946,628	0.30%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2018年7月	売建	437,000	33,350,565	32,569,610	0.09%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2018年7月	売建	30,661,600	378,456,128	375,297,984	1.09%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2018年7月	売建	2,379,200	193,378,996	192,144,192	0.56%
		英ポンド売/円買 2018年 7月	売建	16,967,900	2,455,205,325	2,452,879,624	7.10%
		ユーロ売/円買 2018年7 月	売建	34,255,800	4,363,264,013	4,381,316,820	12.68%
		米ドル売/円買 2018年7 月	売建	211,210,400	22,953,035,124	23,334,524,992	67.53%
		スイス・フラン売/円買 2018年7月	売建	9,426,900	1,042,667,312	1,045,254,672	3.03%

カナダ・ドル売/円買 2018年7月	売建	14,955,300	1,256,951,090	1,246,524,255	3.61%
豪ドル売/円買 2018年7 月	売建	10,935,100	899,183,431	886,945,961	2.57%
デンマーク・クローネ 売/円買 2018年7月	売建	14,848,100	254,151,958	254,793,396	0.74%

(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。

(参考情報) 運用実績

●外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

2018年6月29日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,140円
純資産総額	5.7億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.6%
3カ月間	3.0%
6カ月間	0.2%
1年間	8.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	13.0%

基準価額(円)



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 100円 設定来分配金合計額: 160円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月							
分配金	60円	100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	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,256	99.0%	日本円	100.2%	情報技術	19.2%	APPLE INC	アメリカ	2.6%
外国リート	61	2.3%	豪ドル	0.1%	金融	17.0%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.0%
外国投資証券	6	0.1%	米ドル	0.1%	ヘルスケア	12.5%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.9%
			カナダドル	0.0%	一般消費財・サービス	12.0%	FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.3%
コール・ローン、その他		0.5%	ニュージーランドドル	0.0%	資本財・サービス	10.1%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.0%
合計	1,323	-	ノルウェー・クローネ	0.0%	生活必需品	8.2%	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	1.0%
国・地域別構成			イスラエル・シケル	0.0%	エネルギー	7.3%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.9%
アメリカ		67.7%	スウェーデン・クローネ	-0.0%	素材	4.8%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.9%
イギリス		7.1%	デンマーク・クローネ	-0.0%	公益事業	3.0%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
その他		26.7%	その他	-0.4%	電気通信サービス、他	2.9%	S&P500 E-MINI FUTURE 201809	アメリカ	0.8%
合計		101.5%	合計	100.0%	合計	97.0%	合計		13.4%

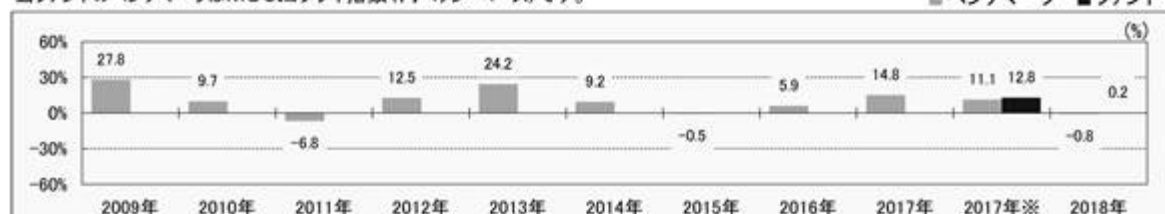
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)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※は設定日(2月16日)から年末、2018年は6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。

【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)】

(1) 【投資状況】(平成30年6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	1,095,832	99.99
内 日本	1,095,832	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	131	0.01
純資産総額	1,095,963	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30年6月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	454,589	2.4790 1,126,971	2.4106 1,095,832	99.99

(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	99.99%
合計	99.99%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月15日)	1,009,377	1,019,377	1.0094	1.0194
平成29年6月末日	1,027,899	-	1.0279	-
7月末日	1,035,269	-	1.0353	-
8月末日	1,031,046	-	1.0310	-
9月末日	1,078,621	-	1.0786	-
10月末日	1,103,099	-	1.1031	-
11月末日	1,110,344	-	1.1103	-
12月末日	1,144,595	-	1.1446	-
平成30年1月末日	1,157,028	-	1.1570	-
2月末日	1,104,537	-	1.1045	-
3月末日	1,057,298	-	1.0573	-
4月末日	1,104,054	-	1.1041	-
5月末日	1,108,954	-	1.1090	-
第2計算期間末 (平成30年6月15日)	1,127,308	1,149,308	1.1273	1.1493
6月末日	1,095,963	-	1.0960	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0100
第2計算期間	0.0220

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.9
第2計算期間	13.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	0	0

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成30年6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	96,796,395,401	95.65
内 香港	1,351,841,880	1.34
内 シンガポール	460,335,637	0.45
内 イスラエル	204,203,786	0.20
内 ノルウェー	289,668,989	0.29
内 スウェーデン	991,138,517	0.98
内 デンマーク	651,489,268	0.64
内 イギリス	6,961,742,900	6.88
内 アイルランド	213,411,632	0.21
内 オランダ	1,397,093,384	1.38
内 ベルギー	418,510,391	0.41
内 フランス	4,140,291,537	4.09
内 ドイツ	3,707,337,798	3.66
内 スイス	3,026,738,692	2.99
内 ポルトガル	58,801,283	0.06
内 スペイン	1,191,315,698	1.18
内 イタリア	940,648,231	0.93
内 フィンランド	403,374,545	0.40
内 オーストリア	90,963,452	0.09
内 カナダ	3,769,542,407	3.72
内 アメリカ	63,989,641,166	63.23
内 オーストラリア	2,454,895,140	2.43
内 ニュージーランド	82,772,280	0.08
内 非上場	636,788	0.00
投資証券	2,545,765,273	2.52
内 香港	75,500,490	0.07
内 シンガポール	40,567,972	0.04
内 イギリス	86,895,883	0.09
内 フランス	146,686,805	0.14
内 カナダ	17,953,033	0.02
内 アメリカ	1,886,506,115	1.86

内 オーストラリア	291,654,975	0.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,856,190,589	1.83
純資産総額	101,198,351,263	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2,059,202,681	2.03
内 アメリカ	2,059,202,681	2.03
為替予約取引(買建)	894,888,000	0.88
内 日本	894,888,000	0.88

(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30年6月29日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	125,000	18,761.06 2,345,147,000	20,505.17 2,563,146,250	2.53
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	179,400	9,284.36 1,665,620,224	10,902.56 1,955,919,300	1.93
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	10,070	130,791.14 1,317,066,922	188,078.28 1,893,948,310	1.87
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	58,600	19,382.63 1,135,823,648	21,691.26 1,271,108,082	1.26
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	84,520	11,507.65 972,633,324	11,598.96 980,344,285	0.97
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,687	113,493.96 872,428,645	123,165.87 946,776,110	0.94
7	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	103,855	9,072.68 942,252,969	9,060.96 941,026,395	0.93

8	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	7,260	115,050.03 835,263,995	124,554.26 904,263,936	0.89
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	65,750	15,389.59 1,011,867,905	13,485.88 886,696,610	0.88
10	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	241,301	3,142.98 758,419,605	3,169.18 764,726,738	0.76
11	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	113,972	6,271.04 714,731,153	5,928.26 675,655,672	0.67
12	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	77,800	9,362.04 728,369,078	8,460.14 658,199,203	0.65
13	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	46,768	12,984.24 607,249,997	13,890.45 649,628,865	0.64
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	44,200	12,219.86 540,121,311	14,673.07 648,550,118	0.64
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	31,300	21,097.22 660,345,201	20,680.92 647,313,065	0.64
16	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	23,626	24,667.99 582,807,545	27,071.24 639,585,258	0.63
17	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	176,891	3,914.55 692,461,207	3,558.28 629,428,167	0.62
18	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	114,000	4,893.38 557,851,053	5,444.09 620,626,830	0.61
19	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	28,450	19,629.25 558,453,386	21,578.51 613,908,706	0.61
20	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	145,163	4,001.54 580,889,439	4,019.23 583,444,123	0.58
21	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	120,400	4,174.54 502,625,667	4,746.58 571,489,147	0.56
22	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	100,454	5,513.95 553,901,249	5,622.06 564,758,857	0.56
23	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	61,817	9,822.14 607,181,481	8,627.64 533,335,255	0.53
24	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	497,700	1,072.56 533,880,102	1,026.29 510,789,420	0.50
25	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・サービス	13,790	30,293.48 417,747,937	36,992.21 510,122,590	0.50

26	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	22,900	16,574.36 379,553,460	21,787.43 498,932,239	0.49
27	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	64,473	8,292.60 534,648,969	7,392.91 476,643,422	0.47
28	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	98,600	5,022.60 495,231,680	4,805.17 473,790,137	0.47
29	NETFLIX INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	10,650	21,620.40 230,258,026	43,709.72 465,508,590	0.46
30	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	55,350	9,249.27 511,950,427	8,029.92 444,456,603	0.44

(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	95.65%
投資証券	2.52%
合計	98.17%

(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	7.15%
素材	4.77%
資本財・サービス	9.95%
一般消費財・サービス	11.83%
生活必需品	8.12%
ヘルスケア	12.34%
金融	16.90%
情報技術	18.72%
電気通信サービス	2.33%
公益事業	3.00%
不動産	0.55%
合計	95.65%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2018年9月	買建	137	2,089,253,422	2,059,202,681	2.03%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年7 月	買建	8,100,000	890,630,840	894,888,000	0.88%

(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。

(参考情報) 運用実績

●外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

2018年6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	10,960円
純資産総額	1百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.8%
3カ月間	5.7%
6カ月間	-2.4%
1年間	8.7%
3年間	-
5年間	-
設定来	12.8%

基準価額(円)



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 220円

設定来分配金合計額: 320円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月							
分配金	100円	220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	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,254	97.7%	米ドル	67.2%	情報技術	18.7%	APPLE INC	アメリカ	2.5%
外国リート	62	2.4%	ユーロ	12.5%	金融	16.9%	S&P500 E-MINI FUTURE 201809	アメリカ	2.0%
外国投資証券	6	0.1%	英ポンド	7.1%	ヘルスケア	12.3%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.9%
			カナダ・ドル	3.8%	一般消費財・サービス	11.8%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.9%
コール・ローン、その他		1.8%	スイス・フラン	3.0%	資本財・サービス	10.0%	FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.3%
合計	1,322	-	豪ドル	2.8%	生活必需品	8.1%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.0%
			香港ドル	1.3%	エネルギー	7.1%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.9%
国・地域別構成			スウェーデン・クローネ	1.0%	素材	4.8%	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	0.9%
アメリカ		67.1%	デンマーク・クローネ	0.7%	公益事業	3.0%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.9%
イギリス		7.0%	その他	0.8%	電気通信サービス、他	2.9%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
その他		26.1%	合計	100.0%	合計	95.6%	合計		14.2%
合計		100.2%							

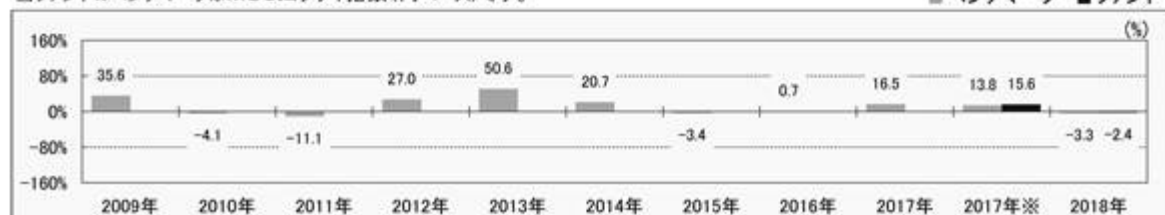
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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MSCIコクサイ指数(円ベース)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※は設定日(2月16日)から年末、2018年は6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。

【ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】(平成30年6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	2,274,956,241	99.90
内 日本	2,274,956,241	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,236,185	0.10
純資産総額	2,277,192,426	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30年6月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	日本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	1,621,956,539	1.4026 2,274,999,018	1.4026 2,274,956,241	99.90

(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	99.90%
合計	99.90%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月15日)	24,087,488	24,087,488	1.0065	1.0065
平成29年6月末日	24,013,371	-	1.0034	-
7月末日	24,015,521	-	1.0035	-
8月末日	24,138,700	-	1.0087	-
9月末日	24,045,904	-	1.0048	-
10月末日	24,044,476	-	1.0047	-
11月末日	24,102,050	-	1.0071	-
12月末日	24,114,728	-	1.0077	-
平成30年1月末日	48,237,915	-	1.0059	-
2月末日	48,419,251	-	1.0097	-
3月末日	71,775,517	-	1.0111	-
4月末日	152,783,369	-	1.0102	-
5月末日	207,073,226	-	1.0123	-
第2計算期間末 (平成30年6月15日)	279,326,560	279,326,560	1.0124	1.0124
6月末日	2,277,192,426	-	1.0127	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.7
第2計算期間	0.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	22,931,206	0
第2計算期間	251,969,341	0

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成30年6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		64,500,645,640	84.58
	内 日本	64,500,645,640	84.58
地方債証券		4,409,707,700	5.78
	内 日本	4,409,707,700	5.78
特殊債券		3,339,762,500	4.38
	内 日本	3,339,762,500	4.38
社債券		3,403,763,000	4.46
	内 日本	3,403,763,000	4.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		605,165,204	0.79
純資産総額		76,259,044,044	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30年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	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 (%)
				また は 額面金額				
1	130 5年国債	日本	国債証券	980,000,000	100.87 988,563,200	100.76 987,506,800	0.100000 2021/12/20	1.29
2	124 5年国債	日本	国債証券	980,000,000	100.57 985,668,000	100.44 984,341,400	0.100000 2020/06/20	1.29
3	131 5年国債	日本	国債証券	920,000,000	100.94 928,700,300	100.82 927,544,000	0.100000 2022/03/20	1.22
4	126 5年国債	日本	国債証券	890,000,000	100.71 896,404,200	100.55 894,957,300	0.100000 2020/12/20	1.17
5	129 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.87 887,669,300	100.71 886,248,000	0.100000 2021/09/20	1.16
6	125 5年国債	日本	国債証券	860,000,000	100.65 865,643,600	100.50 864,300,000	0.100000 2020/09/20	1.13

7	349 10年国債	日本	国債証券	850,000,000	100.51 854,384,600	100.80 856,825,500	0.100000 2027/12/20	1.12
8	334 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	104.36 834,906,000	104.10 832,864,000	0.600000 2024/06/20	1.09
9	343 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.94 807,564,850	101.11 808,944,000	0.100000 2026/06/20	1.06
10	335 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	103.91 810,572,800	103.62 808,275,000	0.500000 2024/09/20	1.06
11	339 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	103.33 806,013,000	103.25 805,381,200	0.400000 2025/06/20	1.06
12	340 10年国債	日本	国債証券	770,000,000	103.43 796,471,800	103.33 795,679,500	0.400000 2025/09/20	1.04
13	342 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.02 787,966,700	101.16 789,055,800	0.100000 2026/03/20	1.03
14	127 5年国債	日本	国債証券	780,000,000	100.77 786,049,800	100.61 784,773,600	0.100000 2021/03/20	1.03
15	128 5年国債	日本	国債証券	755,000,000	100.80 761,088,400	100.67 760,058,500	0.100000 2021/06/20	1.00
16	346 10年国債	日本	国債証券	750,000,000	100.80 756,052,000	100.95 757,192,500	0.100000 2027/03/20	0.99
17	123 5年国債	日本	国債証券	730,000,000	100.55 734,052,900	100.38 732,817,800	0.100000 2020/03/20	0.96
18	312 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	103.74 726,191,000	103.28 722,960,000	1.200000 2020/12/20	0.95
19	333 10年国債	日本	国債証券	640,000,000	104.28 667,448,600	103.96 665,363,200	0.600000 2024/03/20	0.87
20	350 10年国債	日本	国債証券	650,000,000	100.67 654,359,800	100.72 654,719,000	0.100000 2028/03/20	0.86
21	344 10年国債	日本	国債証券	640,000,000	100.92 645,932,200	101.07 646,854,400	0.100000 2026/09/20	0.85
22	122 5年国債	日本	国債証券	630,000,000	100.50 633,162,600	100.33 632,129,400	0.100000 2019/12/20	0.83
23	348 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	100.62 603,768,800	100.87 605,250,000	0.100000 2027/09/20	0.79
24	345 10年国債	日本	国債証券	590,000,000	100.86 595,083,000	101.01 596,000,300	0.100000 2026/12/20	0.78
25	132 5年国債	日本	国債証券	580,000,000	100.98 585,728,700	100.85 584,964,800	0.100000 2022/06/20	0.77
26	328 10年国債	日本	国債証券	550,000,000	103.64 570,073,200	103.36 568,507,500	0.600000 2023/03/20	0.75

27	135 5年国債	日本	国債証券	550,000,000	101.06 555,843,200	101.01 555,604,500	0.100000 2023/03/20	0.73
28	133 5年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.97 555,344,000	100.91 555,010,500	0.100000 2022/09/20	0.73
29	121 5年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.44 552,469,500	100.28 551,540,000	0.100000 2019/09/20	0.72
30	383 2年国債	日本	国債証券	530,000,000	100.46 532,465,500	100.34 531,812,600	0.100000 2019/12/15	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
国債証券	84.58%
地方債証券	5.78%
特殊債券	4.38%
社債券	4.46%
合計	99.21%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考情報) 運用実績

●日本債券インデックス

2018年6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。

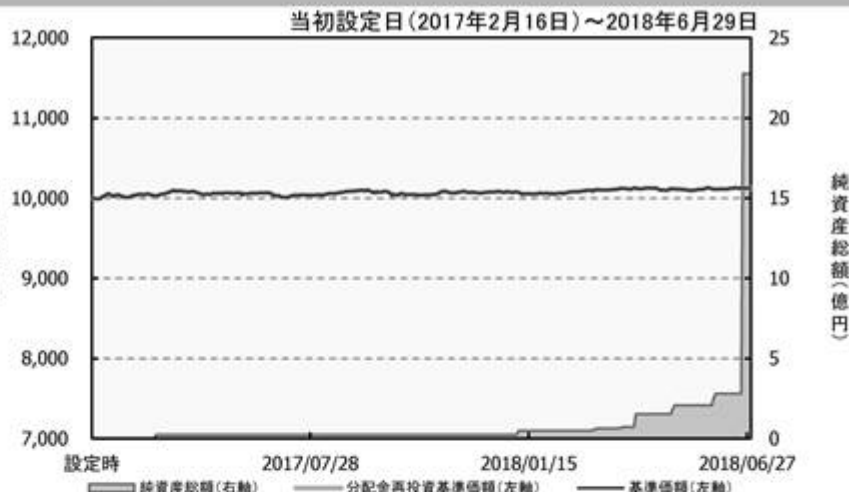
基準価額・純資産の推移

基準価額	10,127円
純資産総額	22億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	0.0%
3か月間	0.2%
6か月間	0.5%
1年間	0.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	1.3%

基準価額(円)



※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 17年6月	第2期 18年6月		
分配金	0円	0円		

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の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	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率	
国内債券	359	99.1%	直接利回り(%)	130 5年国債	0.100	2021/12/20	1.3%	
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	124 5年国債	0.100	2020/06/20	1.3%	
コール・ローン、その他		0.9%	修正デュレーション	131 5年国債	0.100	2022/03/20	1.2%	
合計	359	100.0%	残存年数	126 5年国債	0.100	2020/12/20	1.2%	
債券種別構成		比率	格付別構成	比率	129 5年国債	0.100	2021/09/20	1.2%
国債		84.4%	AAA	88.2%	125 5年国債	0.100	2020/09/20	1.1%
地方債		7.2%	AA	5.6%	349 10年国債	0.100	2027/12/20	1.1%
事業債		4.5%	A	2.9%	334 10年国債	0.600	2024/06/20	1.1%
政府保証債		2.4%	BBB	0.3%	343 10年国債	0.100	2026/06/20	1.1%
その他		0.7%	BB以下・無格付	3.0%	335 10年国債	0.500	2024/09/20	1.1%
合計		99.1%	合計	100.0%	合計			11.6%

※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3.0%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。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数です。

■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※は設定日(2月16日)から年末、2018年は6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。

【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】(平成30年6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	2,003,817,776	99.91
内 日本	2,003,817,776	99.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,852,728	0.09
純資産総額	2,005,670,504	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30年6月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	2,090,358,623	0.9548 1,995,912,498	0.9586 2,003,817,776	99.91

(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	99.91%
合計	99.91%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月15日)	20,274,657	20,274,657	1.0212	1.0212
平成29年6月末日	20,073,413	-	1.0111	-
7月末日	20,047,472	-	1.0098	-
8月末日	20,221,267	-	1.0186	-
9月末日	20,039,895	-	1.0094	-
10月末日	20,107,352	-	1.0128	-
11月末日	20,125,384	-	1.0137	-
12月末日	20,089,661	-	1.0119	-
平成30年1月末日	47,110,389	-	1.0005	-
2月末日	739,563,697	-	0.9965	-
3月末日	816,731,361	-	1.0097	-
4月末日	1,040,246,281	-	0.9996	-
5月末日	1,193,480,994	-	0.9982	-
第2計算期間末 (平成30年6月15日)	1,398,757,675	1,398,757,675	0.9966	0.9966
6月末日	2,005,670,504	-	1.0012	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.1
第2計算期間	2.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	18,852,947	0
第2計算期間	1,383,614,307	0

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国債券インデックス(為替ヘッジあり) マザーファンド

(1) 投資状況(平成30年6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	62,956,330,289	93.81
内 ユーロ	25,795,009,862	38.44
内 シンガポール	217,883,687	0.32
内 マレーシア	276,798,566	0.41
内 ノルウェー	134,821,830	0.20
内 スウェーデン	219,683,723	0.33
内 デンマーク	350,632,099	0.52
内 イギリス	4,450,795,568	6.63
内 スイス	75,840,223	0.11
内 ポーランド	395,658,443	0.59
内 カナダ	1,401,823,681	2.09
内 アメリカ	27,525,298,357	41.01
内 メキシコ	464,311,279	0.69
内 南アフリカ	307,305,216	0.46
内 オーストラリア	1,340,467,755	2.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,154,176,353	6.19
純資産総額	67,110,506,642	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(%)
債券先物取引(買建)	2,655,881,797	3.96
内 イギリス	124,755,144	0.19
内 ドイツ	916,919,637	1.37
内 アメリカ	1,614,207,016	2.41
為替予約取引(売建)	63,636,878,570	94.82
内 日本	63,636,878,570	94.82

(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) 債券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30年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	25,370,000	99.95 2,803,193,908	100.12 2,807,989,431	2.625000 2020/11/15	4.18
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	16,720,000	95.77 1,770,104,168	96.19 1,777,903,694	1.750000 2022/09/30	2.65
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	13,150,000	96.43 1,401,809,196	96.79 1,407,027,623	1.750000 2022/02/28	2.10
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	12,440,000	98.66 1,356,787,282	98.76 1,358,079,892	1.500000 2019/10/31	2.02
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	11,946,000	97.60 1,288,831,784	97.92 1,293,110,240	2.000000 2021/11/15	1.93
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	12,320,000	94.08 1,281,299,206	94.75 1,290,450,857	2.000000 2025/08/15	1.92
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	11,020,000	95.10 1,158,571,044	95.54 1,163,894,363	1.750000 2023/05/15	1.73
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	10,580,000	97.95 1,145,573,264	98.46 1,151,596,257	2.500000 2024/05/15	1.72
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	10,040,000	102.46 1,137,167,604	102.60 1,138,688,059	3.625000 2021/02/15	1.70
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	10,500,000	97.92 1,136,586,097	98.05 1,138,036,935	1.000000 2019/11/15	1.70
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	9,810,000	96.21 1,043,385,490	96.78 1,049,490,647	2.250000 2024/11/15	1.56
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	8,210,000	96.78 878,319,899	98.32 892,286,838	2.875000 2043/05/15	1.33
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	7,950,000	97.89 860,285,619	98.03 861,489,565	1.125000 2019/12/31	1.28
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	7,540,000	98.59 821,744,654	98.73 822,919,849	1.875000 2020/06/30	1.23
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,700,000	95.14 704,653,589	95.54 707,630,874	1.625000 2022/11/15	1.05

16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,310,000	93.86 654,729,271	95.50 666,168,392	2.750000 2047/08/15	0.99
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,905,000	99.53 649,677,355	100.00 652,738,700	2.750000 2023/11/15	0.97
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	98.41 598,303,277	98.53 599,063,239	1.625000 2020/03/15	0.89
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,270,000	107.08 584,883,171	107.07 584,834,016	2.500000 2020/10/25	0.87
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,990,000	98.32 542,371,938	98.59 543,833,663	2.125000 2021/06/30	0.81
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,120,000	94.71 536,025,262	95.42 540,094,548	2.250000 2027/02/15	0.80
22	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	5,820,000	102.96 499,729,535	103.05 500,146,918	3.500000 2020/06/01	0.75
23	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	3,470,000	104.47 463,705,446	104.24 462,675,719	4.250000 2019/09/01	0.69
24	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,440,000	102.00 448,845,808	102.11 449,312,219	0.250000 2020/10/16	0.67
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,000,000	132.87 440,640,075	133.98 444,317,740	6.250000 2030/05/15	0.66
26	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,893,000	161.16 441,109,214	162.01 443,435,740	4.250000 2049/12/07	0.66
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,415,000	141.99 438,613,961	142.37 439,784,702	6.000000 2025/10/25	0.66
28	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	3,050,000	106.74 416,431,662	106.44 415,257,384	4.000000 2020/09/01	0.62
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,900,000	95.50 411,736,407	96.20 414,736,905	2.250000 2025/11/15	0.62
30	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	2,770,000	115.76 410,157,152	115.19 408,155,297	5.500000 2022/11/01	0.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	93.81%
合計	93.81%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
債券先物取引	アメリカ	T-BOND 2018年9月	買建	5	79,191,547	80,124,228	0.12%
		T-NOTE(10YR) 2018年9月	買建	13	171,843,429	172,711,841	0.26%
		T-NOTE(5YR) 2018年9月	買建	10	125,091,552	125,618,352	0.19%
		T-NOTE(2YR) 2018年9月	買建	49	1,146,444,842	1,147,527,857	1.71%
		T-BOND(ULTRA LONG) 2018年9月	買建	5	87,134,200	88,224,738	0.13%
	イギリス	GILT 10YR 2018年9月	買建	7	124,230,860	124,755,144	0.19%
	ドイツ	BOBL(5YR) 2018年9月	買建	13	219,040,042	219,842,754	0.33%
		SCHATZ(2YR) 2018年9月	買建	17	243,602,932	243,768,959	0.36%
		BUXL(30YR) 2018年9月	買建	8	177,335,959	180,854,507	0.27%
		BTP 10YR 2018年9月	買建	12	194,627,447	193,599,460	0.29%
OAT 10YR 2018年9月		買建	4	78,731,112	78,853,957	0.12%	
為替予約取引	日本	シンガポール・ドル売/ 円買 2018年7月	売建	3,086,000	253,360,600	249,225,360	0.37%
		米ドル売/円買 2018年7 月	売建	251,303,000	27,771,494,530	27,763,955,440	41.37%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2018年7月	売建	20,339,000	257,084,960	248,949,360	0.37%
		ポーランド・ズロチ売/ 円買 2018年7月	売建	13,903,000	414,309,400	407,218,870	0.61%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2018年7月	売建	14,345,000	194,805,100	193,514,050	0.29%
		マレーシア・リンギット 売/円買 2018年8月	売建	10,234,000	279,587,763	278,671,820	0.42%
		メキシコ・ペソ売/円買 2018年7月	売建	89,528,000	471,812,560	500,461,520	0.75%
		英ポンド売/円買 2018年 7月	売建	31,173,000	4,569,338,340	4,506,368,880	6.71%

ユーロ売/円買 2018年7月	売建	202,791,000	25,936,968,900	25,936,968,900	38.65%
デンマーク・クローネ 売/円買 2018年7月	売建	20,708,000	355,556,360	355,349,280	0.53%
スイス・フラン売/円買 2018年7月	売建	837,000	92,865,150	92,806,560	0.14%
南アフリカ・ランド売/ 円買 2018年7月	売建	43,063,000	352,255,340	344,504,000	0.51%
豪ドル売/円買 2018年7月	売建	16,633,000	1,370,891,860	1,349,102,630	2.01%
カナダ・ドル売/円買 2018年7月	売建	16,914,000	1,424,666,220	1,409,781,900	2.10%

(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) 債券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。

(参考情報) 運用実績

●外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

2018年6月29日現在

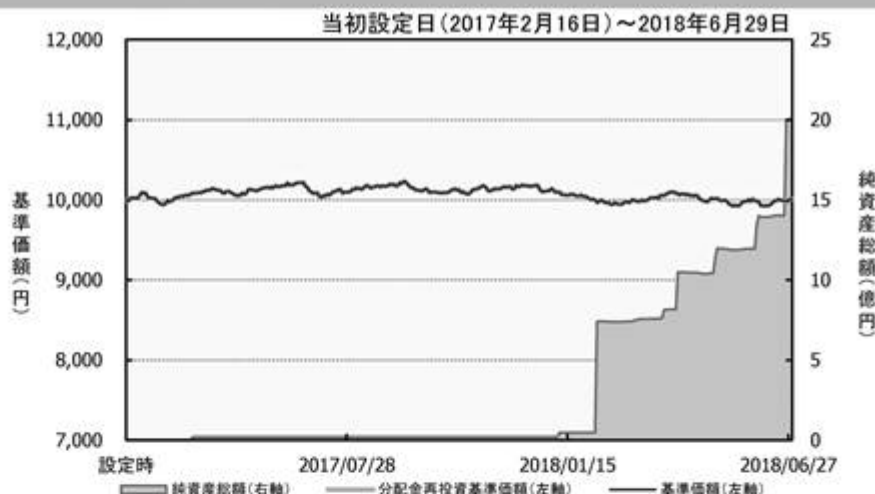
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,012円
純資産総額	20億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.3%
3カ月間	-0.8%
6カ月間	-1.1%
1年間	-1.0%
3年間	-
5年間	-
設定来	0.1%



※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 17年6月	第2期 18年6月		
分配金	0円	0円		

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の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10銘柄	償還日	比率
外国債券・先物	390	97.7%	日本円	99.7%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2020/11/15	4.2%
			ユーロ	0.3%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2022/09/30	2.6%
コール・ローン、その他		6.3%	カナダ・ドル	0.0%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2022/02/28	2.1%
合計	390	-	英ポンド	0.0%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2019/10/31	2.0%
債券種別構成			豪ドル	0.0%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2021/11/15	1.9%
国債		93.7%	デンマーク・クローネ	0.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2025/08/15	1.9%
			マレーシア・リンギット	0.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2023/05/15	1.7%
			シンガポール・ドル	0.0%	A	United States Treasury Note/Bond	2024/05/15	1.7%
			スウェーデン・クローネ	0.0%	BBB	T-NOTE(2YR) 201809	-	1.7%
			その他	-0.1%	BB	United States Treasury Note/Bond	2021/02/15	1.7%
合計		93.7%	合計	100.0%	合計	合計		21.6%

※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。

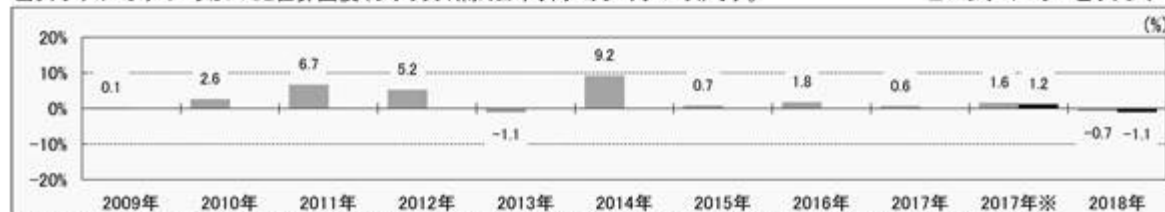
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)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※は設定日(2月16日)から年末、2018年は6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。

【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)】

(1) 【投資状況】(平成30年6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	1,004,721	99.93
内 日本	1,004,721	99.93
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	751	0.07
純資産総額	1,005,472	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30年6月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	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	369,220	2.7134 1,001,841	2.7212 1,004,721	99.93

(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	99.93%
合計	99.93%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月15日)	1,006,543	1,009,043	1.0065	1.0090
平成29年6月末日	1,027,526	-	1.0275	-
7月末日	1,026,629	-	1.0266	-
8月末日	1,040,891	-	1.0409	-
9月末日	1,052,156	-	1.0522	-
10月末日	1,051,847	-	1.0518	-
11月末日	1,052,347	-	1.0523	-
12月末日	1,065,140	-	1.0651	-
平成30年1月末日	1,038,451	-	1.0385	-
2月末日	1,011,491	-	1.0115	-
3月末日	1,017,864	-	1.0179	-
4月末日	1,029,836	-	1.0298	-
5月末日	1,002,999	-	1.0030	-
第2計算期間末 (平成30年6月15日)	1,002,760	1,014,760	1.0028	1.0148
6月末日	1,005,472	-	1.0055	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0025
第2計算期間	0.0120

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.9
第2計算期間	0.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	0	0

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成30年6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	162,028,014,264	98.26
内 ユーロ	64,913,160,853	39.37
内 シンガポール	655,767,736	0.40
内 マレーシア	790,570,080	0.48
内 ノルウェー	383,003,836	0.23
内 スウェーデン	614,866,295	0.37
内 デンマーク	966,531,331	0.59
内 イギリス	11,299,484,341	6.85
内 スイス	213,161,873	0.13
内 ポーランド	1,009,390,658	0.61
内 カナダ	3,370,434,671	2.04
内 アメリカ	72,179,290,615	43.77
内 メキシコ	1,282,777,702	0.78
内 南アフリカ	911,665,167	0.55
内 オーストラリア	3,437,909,106	2.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,869,188,092	1.74
純資産総額	164,897,202,356	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)	1,582,898,110	0.96
内 日本	1,582,898,110	0.96

(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30年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	99.21 690,928,611	99.14 690,468,654	2.750000 2028/02/15	0.42
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	99.30 690,142,108	97.07 674,658,103	2.000000 2022/11/30	0.41
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,084,000	161.87 638,540,593	161.38 636,602,851	4.500000 2041/04/25	0.39
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	98.95 647,657,639	96.78 633,438,748	2.250000 2024/11/15	0.38
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	99.47 642,170,899	96.20 621,041,929	2.250000 2025/11/15	0.38
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	98.80 644,385,855	95.17 620,691,938	2.250000 2027/08/15	0.38
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	98.87 632,607,707	95.71 612,357,863	2.125000 2025/05/15	0.37
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,029,000	94.47 629,631,201	91.50 609,844,430	1.625000 2026/05/15	0.37
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	99.92 629,630,644	96.32 606,891,129	2.375000 2027/05/15	0.37
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	98.14 623,023,359	95.12 603,883,198	2.000000 2025/02/15	0.37
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	97.81 620,941,112	94.75 601,547,019	2.000000 2025/08/15	0.36
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,807,000	165.97 595,904,281	164.84 591,861,452	5.750000 2032/10/25	0.36
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,697,000	125.56 593,752,233	123.25 582,847,545	4.250000 2023/10/25	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	97.55 593,090,100	95.07 577,997,079	2.250000 2027/11/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	103.05 595,666,197	99.91 577,516,568	2.750000 2024/02/15	0.35
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	97.03 589,968,008	93.73 569,874,599	2.000000 2026/11/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,340,000	97.83 577,496,060	95.42 563,301,736	2.250000 2027/02/15	0.34
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	93.28 577,431,777	90.32 559,102,476	1.500000 2026/08/15	0.34

19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,162,000	100.73 574,795,738	97.64 557,186,792	2.375000 2024/08/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	103.16 572,582,215	100.00 555,021,340	2.750000 2023/11/15	0.34
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,025,000	144.56 559,352,380	142.37 550,869,037	6.000000 2025/10/25	0.33
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	94.68 561,643,174	91.77 544,358,560	1.625000 2026/02/15	0.33
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,824,000	149.31 539,352,417	149.32 539,374,090	4.000000 2038/10/25	0.33
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,499,000	120.81 540,729,524	120.31 538,460,410	2.750000 2027/10/25	0.33
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,630,000	114.53 531,805,881	112.85 523,977,559	3.000000 2022/04/25	0.32
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,550,000	114.21 518,623,502	112.26 509,768,932	3.250000 2021/10/25	0.31
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	152.28 510,921,541	150.46 504,818,651	5.500000 2029/04/25	0.31
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	126.42 508,756,440	125.08 503,336,046	3.500000 2026/04/25	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	102.19 509,345,348	100.12 499,062,843	2.625000 2020/11/15	0.30
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	97.96 507,315,150	95.54 494,813,529	1.750000 2023/05/15	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.26%
合計	98.26%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2018年7月	買建	238,000	19,401,670	19,308,940	0.01%
		豪ドル買/円売 2018年8月	買建	182,000	14,736,358	14,731,080	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2018年7月	買建	207,000	17,226,951	17,257,590	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2018年8月	買建	177,000	14,734,683	14,731,710	0.01%
		ユーロ買/円売 2018年7月	買建	3,202,000	408,782,127	409,535,800	0.25%
		ユーロ買/円売 2018年8月	買建	2,026,000	259,204,211	259,125,400	0.16%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2018年7月	買建	1,536,000	12,873,526	12,303,360	0.01%
		英ポンド買/円売 2018年 7月	買建	217,000	31,532,877	31,371,690	0.02%
		メキシコ・ペソ買/円売 2018年8月	買建	1,169,000	6,494,496	6,487,950	0.00%
		メキシコ・ペソ買/円売 2018年7月	買建	2,944,000	15,871,398	16,456,960	0.01%
		米ドル買/円売 2018年8月	買建	2,551,000	281,292,647	281,247,750	0.17%
		米ドル買/円売 2018年7月	買建	4,018,000	439,755,329	443,989,000	0.27%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2018年8月	買建	946,000	7,534,322	7,530,160	0.00%
英ポンド買/円売 2018年 8月	買建	338,000	48,835,963	48,820,720	0.03%		

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

2018年6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	10,055円
純資産総額	1百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	1.4%
3か月間	-0.0%
6か月間	-4.5%
1年間	-1.0%
3年間	-
5年間	-
設定来	2.0%



※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)

直近1年間分配金合計額: 120円 設定来分配金合計額: 145円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月							
分配金	25円	120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10銘柄	償還日	比率
外国債券	772	98.2%	米ドル	44.5%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2028/02/15	0.4%
			ユーロ	40.3%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2022/11/30	0.4%
コール・ローン、その他		1.8%	英ポンド	7.0%	修正デュレーション	FRENCH GOVERNMENT BOND	2041/04/25	0.4%
合計	772	100.0%	豪ドル	2.1%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2024/11/15	0.4%
			カナダドル	2.1%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2025/11/15	0.4%
債券種別構成			メキシコ・ペソ	0.8%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	0.4%
国債		98.2%	ポーランド・ズロチ	0.8%	AA	United States Treasury Note/Bond	2025/05/15	0.4%
			デンマーク・クローネ	0.6%	A	United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.4%
			南アフリカ・ランド	0.6%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2027/05/15	0.4%
			その他	1.4%	BB	United States Treasury Note/Bond	2025/02/15	0.4%
合計		98.2%	合計	100.0%	合計	合計		3.8%

※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。

※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。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)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※は設定日(2月16日)から年末、2018年は6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。

【ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】(平成30年6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	152,379,955	99.80
内 日本	152,379,955	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	301,987	0.20
純資産総額	152,681,942	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30年6月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	59,490,886	2.5223 150,053,865	2.5614 152,379,955	99.80

(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	99.80%
合計	99.80%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月15日)	3,456,480	3,474,147	0.9782	0.9832
平成29年6月末日	3,356,745	-	0.9500	-
7月末日	3,397,496	-	0.9615	-
8月末日	3,363,439	-	0.9519	-
9月末日	3,311,167	-	0.9371	-
10月末日	3,267,897	-	0.9248	-
11月末日	3,361,833	-	0.9514	-
12月末日	3,360,349	-	0.9510	-
平成30年1月末日	3,535,284	-	1.0005	-
2月末日	3,465,369	-	0.9807	-
3月末日	3,447,256	-	0.9756	-
4月末日	3,535,115	-	1.0005	-
5月末日	221,123,860	-	1.0067	-
第2計算期間末 (平成30年6月15日)	321,051,059	322,484,783	1.0077	1.0122
6月末日	152,681,942	-	1.0231	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0050
第2計算期間	0.0045

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	3.5

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,533,441	0
第2計算期間	315,071,967	0

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況（平成30年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	212,032,251,100	98.07
内 日本	212,032,251,100	98.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,181,256,408	1.93
純資産総額	216,213,507,508	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	3,146,400,000	1.46
内 日本	3,146,400,000	1.46

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

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

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

(2) 投資資産（平成30年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	24,803	579,265.78 14,367,529,173	639,000.00 15,849,117,000	7.33
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	25,485	550,297.04 14,024,320,219	586,000.00 14,934,210,000	6.91
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	75,797	144,956.04 10,987,233,507	156,300.00 11,847,071,100	5.48
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	56,491	168,111.15 9,496,767,357	171,900.00 9,710,802,900	4.49
5	日本リテールファンド	日本	投資証券	48,365	203,384.63 9,836,697,926	199,600.00 9,653,654,000	4.46

6	オリックス不動産投資	日本	投資証券	50,820	165,841.78 8,428,079,401	176,900.00 8,990,058,000	4.16
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	34,138	232,574.51 7,939,628,625	229,800.00 7,844,912,400	3.63
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	29,802	249,141.84 7,424,925,258	262,900.00 7,834,945,800	3.62
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	23,714	278,628.82 6,607,404,027	283,800.00 6,730,033,200	3.11
10	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	16,171	373,159.13 6,034,356,431	402,500.00 6,508,827,500	3.01
11	GLP投資法人	日本	投資証券	53,172	116,911.39 6,216,412,708	117,600.00 6,253,027,200	2.89
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	73,926	77,228.88 5,709,222,704	83,000.00 6,135,858,000	2.84
13	API投資法人	日本	投資証券	11,587	469,656.55 5,441,910,484	508,000.00 5,886,196,000	2.72
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	7,903	662,788.94 5,238,021,057	688,000.00 5,437,264,000	2.51
15	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	64,172.4	71,978.41 4,619,027,654	72,600.00 4,658,916,240	2.15
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	8,511	475,612.59 4,047,938,821	504,000.00 4,289,544,000	1.98
17	森ヒルズリート	日本	投資証券	27,515	135,233.79 3,720,957,828	142,100.00 3,909,881,500	1.81
18	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	8,713	438,051.11 3,816,739,397	445,000.00 3,877,285,000	1.79
19	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	17,063	218,540.10 3,728,949,826	225,700.00 3,851,119,100	1.78
20	産業ファンド	日本	投資証券	29,747	119,612.80 3,558,122,129	123,400.00 3,670,779,800	1.70
21	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	70,247	49,151.71 3,452,760,869	49,900.00 3,505,325,300	1.62
22	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	5,510	620,077.91 3,416,629,325	636,000.00 3,504,360,000	1.62
23	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	22,936	142,407.25 3,266,252,732	142,700.00 3,272,967,200	1.51
24	イオンリート投資	日本	投資証券	24,323	113,154.00 2,752,244,768	127,700.00 3,106,047,100	1.44
25	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	17,395	161,257.01 2,805,065,736	171,600.00 2,984,982,000	1.38

26	森トラスト総合リート	日本	投資証券	18,306	159,511.43 2,920,016,331	158,700.00 2,905,162,200	1.34
27	プレミア投資法人	日本	投資証券	23,135	110,988.40 2,567,716,689	112,400.00 2,600,374,000	1.20
28	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	28,810	83,027.47 2,392,021,655	89,100.00 2,566,971,000	1.19
29	東急リアル・エステート	日本	投資証券	17,173	143,335.87 2,461,506,961	149,000.00 2,558,777,000	1.18
30	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	9,709	245,978.28 2,388,203,183	261,000.00 2,534,049,000	1.17

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.07%
合計	98.07%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2018 年9月	買建	1,800	3,079,814,400	3,146,400,000	1.46%

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

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

（参考情報）運用実績

●J-REITインデックス

2018年6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	10,231円
純資産総額	1.5億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	2.1%
3か月間	5.3%
6か月間	8.1%
1年間	8.2%
3年間	-
5年間	-
設定来	3.3%



※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： 45円		設定来分配金合計額： 95円	
	第1期 17年6月	第2期 18年6月		
分配金	50円	45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。

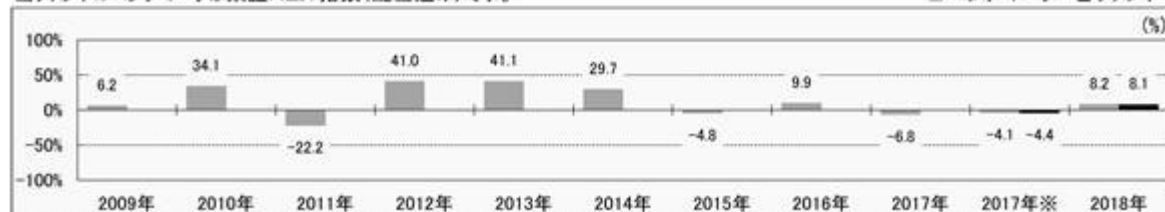
資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	59	97.9%	オフィス不動産	32.1%	日本ビルファンド	オフィス不動産	7.3%
国内リート先物	1	1.5%	各種不動産	28.5%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	6.9%
			工業用不動産	12.1%	野村不動産マスターF	各種不動産	5.5%
			店舗用不動産	9.8%	ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	4.5%
			住宅用不動産	8.7%	日本リテールファンド	店舗用不動産	4.5%
			ホテル・リゾート不動産	6.3%	オリックス不動産投資	オフィス不動産	4.1%
			ヘルスケア不動産	0.3%	日本プロロジスリート	工業用不動産	3.6%
					大和ハウスリート投資法人	各種不動産	3.6%
					アドバンス・レジデンス	住宅用不動産	3.1%
コール・ローン、その他		2.1%			日本プライムリアルティ	オフィス不動産	3.0%
合計	60	-	合計	97.9%	合計		46.1%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。 ※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東証REIT指数(配当込み)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※は設定日(2月16日)から年末、2018年は6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。

【ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】

(1) 【投資状況】（平成30年6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	161,715,656	101.24
内 日本	161,715,656	101.24
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,974,878	1.24
純資産総額	159,740,778	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(売建)	157,066,606	98.33
内 日本	157,066,606	98.33

(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30年6月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	72,278,384	2.2016 159,128,091	2.2374 161,715,656	101.24

(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	101.24%
合計	101.24%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル売/円買 2018年7月	売建	154,000	12,691,140	12,487,860	7.82%
		カナダ・ドル売/円買 2018年7月	売建	33,700	2,838,214	2,808,558	1.76%
		ユーロ売/円買 2018年7月	売建	89,800	11,485,420	11,485,420	7.19%
		英ポンド売/円買 2018年7月	売建	62,900	9,219,253	9,091,566	5.69%
		米ドル売/円買 2018年7月	売建	1,011,900	111,804,831	111,764,355	69.97%
		イスラエル・シケル 売/円買 2018年7月	売建	4,100	125,501	123,861	0.08%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2018年7月	売建	9,200	706,468	685,584	0.43%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2018年7月	売建	64,100	5,261,328	5,175,434	3.24%
		香港ドル売/円買 2018年7月	売建	244,600	3,441,522	3,443,968	2.16%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月15日)	10,195,310	10,275,310	1.0195	1.0275
平成29年6月末日	10,040,710	-	1.0041	-
7月末日	10,086,775	-	1.0087	-
8月末日	10,007,338	-	1.0007	-
9月末日	10,013,872	-	1.0014	-
10月末日	9,964,842	-	0.9965	-

11月末日	10,214,493	-	1.0214	-
12月末日	10,290,221	-	1.0290	-
平成30年1月末日	9,761,063	-	0.9761	-
2月末日	9,262,163	-	0.9262	-
3月末日	36,489,734	-	0.9505	-
4月末日	129,797,953	-	0.9471	-
5月末日	199,081,056	-	0.9912	-
第2計算期間末 (平成30年6月15日)	279,933,693	283,060,364	0.9848	0.9958
6月末日	159,740,778	-	1.0041	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0080
第2計算期間	0.0110

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.8
第2計算期間	2.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	275,571,977	1,329,127

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成30年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	95,202,575	0.56
内 アメリカ	95,202,575	0.56
投資証券	16,775,994,250	98.12

内 ガーンジー	10,213,346	0.06
内 マン島	8,655,350	0.05
内 香港	349,497,660	2.04
内 シンガポール	564,698,410	3.30
内 イスラエル	4,091,340	0.02
内 イギリス	937,771,753	5.49
内 アイルランド	40,728,163	0.24
内 オランダ	73,294,303	0.43
内 ベルギー	123,121,305	0.72
内 フランス	835,783,959	4.89
内 ドイツ	44,680,293	0.26
内 スペイン	173,220,123	1.01
内 イタリア	17,599,009	0.10
内 カナダ	292,889,868	1.71
内 アメリカ	12,080,749,726	70.66
内 オーストラリア	1,147,949,521	6.71
内 ニュージーランド	71,050,121	0.42
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	225,590,623	1.32
純資産総額	17,096,787,448	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	167,036,262	0.98
内 ドイツ	22,460,996	0.13
内 アメリカ	144,575,266	0.85
為替予約取引(買建)	76,098,700	0.45
内 日本	76,098,700	0.45

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

(注2) 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30年6月29日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

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

1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	41,547	17,543.69 728,892,283	18,925.55 786,299,967	4.60
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	71,546	7,231.85 517,414,524	7,201.68 515,251,469	3.01
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	20,100	22,952.52 461,346,538	25,305.92 508,649,036	2.98
4	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	フランス	投資証券	18,170	26,360.07 478,963,165	23,931.96 434,843,731	2.54
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	18,400	19,703.31 362,542,239	18,947.66 348,636,970	2.04
6	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	49,200	7,223.78 355,413,846	6,997.18 344,261,354	2.01
7	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	49,700	7,186.31 357,164,689	6,893.27 342,595,738	2.00
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	27,678	12,659.48 350,389,495	12,202.51 337,741,088	1.98
9	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	47,579	6,818.65 324,425,894	6,349.41 302,098,940	1.77
10	LINK REIT	香港	投資証券	296,000	987.22 292,221,821	1,000.39 296,115,440	1.73
11	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	20,700	13,732.93 284,272,291	13,810.86 285,884,959	1.67
12	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	722,520	339.49 245,331,034	356.29 257,428,385	1.51
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	8,867	26,997.84 239,390,018	26,042.11 230,915,466	1.35
14	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	38,217	6,045.21 231,033,463	6,002.32 229,390,740	1.34
15	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	99,100	2,183.60 216,397,506	2,305.86 228,511,162	1.34
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	13,800	13,980.76 192,935,521	13,965.62 192,725,606	1.13
17	GGP INC	アメリカ	投資証券	84,877	2,543.52 215,894,189	2,264.96 192,243,400	1.12
18	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	23,064	8,329.74 192,119,351	8,144.58 187,846,759	1.10
19	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	16,900	9,443.54 159,596,878	11,065.05 186,999,413	1.09
20	HCP INC	アメリカ	投資証券	62,700	2,890.73 181,254,176	2,840.87 178,123,051	1.04

21	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	217,510	701.54 152,609,316	782.38 170,175,996	1.00
22	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	15,128	11,031.11 166,880,027	11,192.17 169,315,223	0.99
23	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	47,900	3,115.68 149,241,967	3,203.44 153,445,217	0.90
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	35,600	4,263.08 151,767,109	4,150.77 147,767,661	0.86
25	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	37,400	4,307.85 161,117,879	3,830.21 143,249,891	0.84
26	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	101,931	1,353.94 138,021,333	1,386.61 141,339,370	0.83
27	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	19,820	7,335.21 145,384,308	6,904.32 136,843,789	0.80
28	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	9,700	14,270.16 138,420,841	13,946.83 135,284,268	0.79
29	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	12,000	11,216.16 134,594,952	11,142.43 133,709,184	0.78
30	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	137,330	811.87 111,512,750	960.36 131,887,170	0.77

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	0.56%
投資証券	98.12%
合計	98.68%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DJ US REIT IDXFRS 2018年9月	買建	41	141,618,045	144,575,266	0.85%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFTR 2018年9月	買建	20	22,716,816	22,460,996	0.13%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年7 月	買建	560,000	61,585,276	61,874,800	0.36%
		英ポンド買/円売 2018年 7月	買建	20,000	2,891,644	2,891,400	0.02%
		カナダ・ドル買/円売 2018年7月	買建	10,000	833,728	833,700	0.00%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2018年7月	買建	130,000	10,543,460	10,498,800	0.06%

(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

●外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2018年6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	10,041円
純資産総額	1.5億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.4%
3カ月間	6.8%
6カ月間	-1.3%
1年間	1.1%
3年間	-
5年間	-
設定来	2.3%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 110円 設定来分配金合計額: 190円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月							
分配金	80円	110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。

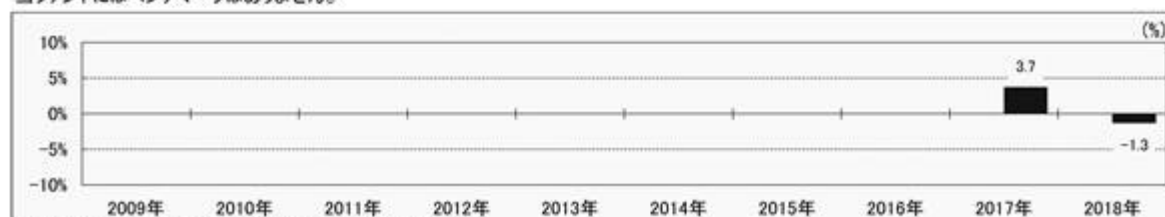
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	313	100.3%	日本円	97.2%	商業施設	25.8%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	4.7%
外国投資信託	1	0.6%	米ドル	3.0%	オフィス	13.3%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	3.1%
コール・ローン、その他		0.1%	ユーロ	0.6%	住宅	13.0%	PUBLIC STORAGE	貨倉庫	アメリカ	3.0%
合計	314	-	香港ドル	0.1%	各種不動産	11.7%	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	商業施設	フランス	2.6%
国・地域別構成		比率	英ポンド	0.0%	産業施設	9.8%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.1%
アメリカ		73.0%	カナダ・ドル	0.0%	ヘルスケア	9.1%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	2.0%
オーストラリア		6.8%	ニュージーランド・ドル	0.0%	貨倉庫	6.4%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.0%
イギリス		5.6%	シンガポール・ドル	-0.0%	ホテル/リゾート	5.4%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.0%
フランス		4.9%	イスラエル・シケル	-0.1%	特殊用途施設	4.9%	VENTAS INC	ヘルスケア	アメリカ	1.8%
その他		10.6%	豪ドル	-0.9%			LINK REIT	商業施設	香港	1.8%
合計		100.9%	合計		合計	99.3%	合計			25.0%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017年は設定日(2月16日)から年末、2018年は6月29日までの騰落率を表しています。

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

【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】(平成30年6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	9,848,374	99.99
内 日本	9,848,374	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,403	0.01
純資産総額	9,849,777	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30年6月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	4,401,705	2.2016 9,690,794	2.2374 9,848,374	99.99

(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	99.99%
合計	99.99%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月15日)	9,896,754	9,996,754	0.9897	0.9997
平成29年6月末日	9,989,631	-	0.9990	-
7月末日	9,964,986	-	0.9965	-
8月末日	9,894,218	-	0.9894	-
9月末日	10,129,676	-	1.0130	-
10月末日	10,089,363	-	1.0089	-
11月末日	10,267,872	-	1.0268	-
12月末日	10,486,530	-	1.0487	-
平成30年1月末日	9,686,343	-	0.9686	-
2月末日	9,014,006	-	0.9014	-
3月末日	9,171,672	-	0.9172	-
4月末日	9,442,414	-	0.9442	-
5月末日	9,797,894	-	0.9798	-
第2計算期間末 (平成30年6月15日)	9,693,791	10,023,791	0.9694	1.0024
6月末日	9,849,777	-	0.9850	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0100
第2計算期間	0.0330

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.0
第2計算期間	1.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	0	0

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

2018年6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	9,850円
純資産総額	9百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.0%
3カ月間	11.0%
6カ月間	-2.9%
1年間	2.0%
3年間	-
5年間	-
設定来	2.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 330円 設定来分配金合計額: 430円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月								
分配金	100円	330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。

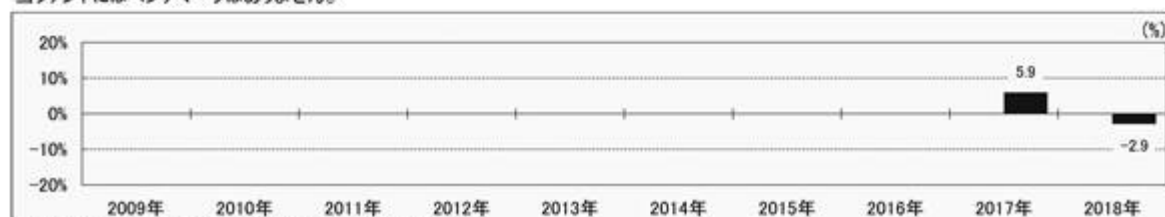
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	313	99.1%	米ドル	72.1%	商業施設	25.5%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	4.6%
外国投資信託	1	0.6%	ユーロ	7.7%	オフィス	13.1%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	3.0%
コール・ローン、その他		1.3%	豪ドル	6.8%	住宅	12.9%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	3.0%
合計	314	-	英ポンド	5.6%	各種不動産	11.6%	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	商業施設	フランス	2.5%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.2%	産業施設	9.6%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.0%
アメリカ		72.1%	香港ドル	2.2%	ヘルスケア	9.0%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	2.0%
オーストラリア		6.7%	カナダ・ドル	1.7%	貸倉庫	6.3%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.0%
イギリス		5.5%	ニュージーランド・ドル	0.4%	ホテル/リゾート	5.3%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.0%
フランス		4.9%	日本円	0.1%	特殊用途施設	4.9%	VENTAS INC	ヘルスケア	アメリカ	1.8%
その他		10.5%	イスラエル・シユケル	0.0%			LINK REIT	商業施設	香港	1.7%
合計		99.6%	合計	100.0%	合計	98.1%	合計			24.7%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2017年は設定日(2月16日)から年末、2018年は6月29日までの騰落率を表しています。

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

ただし、販売会社は、後掲の別表Aに掲げる各ファンドについて、後掲の別表Aに掲げる該当日のいずれかと同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

お買付価額（1万口当たり）は、各ファンドについて後掲の別表Bに掲げる価額です。

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。

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

2 【換金(解約)手続等】

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

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

<一部解約>

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

ただし、後掲の別表Aに掲げる各ファンドについて、後掲の別表Aに掲げる該当日のいずれかと同じ日付の日を請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けは行いません。

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

解約価額は、各ファンドについて後掲の別表Bに掲げる価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212
(営業日の9:00~17:00)

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止(「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。)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付けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、各ファンドにつ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次の日から受益者に支払います。

ファンド名	解約代金支払開始日
TOPIXインデックス 日経225インデックス 日本債券インデックス	4営業日目
外国株式インデックス(為替ヘッジあり) 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) J-REITインデックス 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	5営業日目

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

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

「1 申込(販売)手続等」「2 換金(解約)手続等」中の別表AおよびBは、次のものとします。

[別表A]

ファンド名	該当日
外国株式インデックス(為替ヘッジあり) 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	ニューヨーク証券取引所の休業日
外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、シカゴ商品取引所における米国債先物取引の休業日
外国REITインデックス(為替ヘッジあり) 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	ニューヨーク証券取引所または オーストラリア証券取引所の休業日

[別表B]

ファンド名	価額
TOPIXインデックス 日経225インデックス 日本債券インデックス J-REITインデックス	申込受付日の基準価額
外国株式インデックス(為替ヘッジあり) 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	申込受付日の翌営業日の基準価額

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。

*「J-REITインデックス」を除きます。

(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

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・外国の金融商品取引所上場の投資信託証券：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・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
- ・不動産投資信託証券：原則として金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算時において知り得る直近の日の最終相場で評価します。

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（「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。）。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年6月16日から翌年6月15日までとします。ただし、第1計算期間は、2017年2月16日から2017年6月15日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

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

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」)をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書)を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・ 委託会社のホームページアドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金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。

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。

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】

【ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成29年6月16日から平成30年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,393
コール・ローン	3,200	126,792
親投資信託受益証券	4,168,175	100,612,054
未収入金	-	1,800
流動資産合計	4,171,375	100,742,039
資産合計	4,171,375	100,742,039
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	12,135	938,926
未払受託者報酬	168	7,845
未払委託者報酬	2,901	114,094
その他未払費用	119	1,918
流動負債合計	15,323	1,062,783
負債合計	15,323	1,062,783
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,045,067	1 85,356,999
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	110,985	14,322,257
（分配準備積立金）	156,052	194,063
元本等合計	4,156,052	99,679,256
純資産合計	4,156,052	99,679,256
負債純資産合計	4,171,375	100,742,039

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自	平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		171,375		2,696,521
営業収益合計		171,375		2,696,521
営業費用				
受託者報酬		168		8,250
委託者報酬		2,901		120,998
その他費用		119		2,101
営業費用合計		3,188		131,349
営業利益又は営業損失（ ）		168,187		2,827,870
経常利益又は経常損失（ ）		168,187		2,827,870
当期純利益又は当期純損失（ ）		168,187		2,827,870
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		110,985
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		17,978,068
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		17,978,068
剰余金減少額又は欠損金増加額		45,067		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		45,067		-
分配金		1 12,135		1 938,926
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		110,985		14,322,257

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	4,045,067円
期中追加設定元本額	3,045,067円	81,311,932円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,045,067口	85,356,999口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,312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（155,875円）、投資信託約款に規定される収益調整金（397円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は168,584円（1万口当たり416.76円）であり、うち12,135円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（891,581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（14,213,550円）及び分配準備積立金（156,052円）より分配対象額は15,261,183円（1万口当たり1,787.92円）であり、うち938,926円（1万口当たり110円）を分配金額としております。</p>
------------	---	--

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期
	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15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	171,333	2,691,032
合計	171,333	2,691,032

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期	第2期
平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期
自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0274円 (10,274円)	1.1678円 (11,678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	89,512,504	100,612,054	
親投資信託受益証券 合計			100,612,054	
合計			100,612,054	

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」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	120,882,976
コール・ローン	11,830,414,455	11,006,764,790
株式	3 4 129,347,079,200	144,768,159,960
派生商品評価勘定	-	265,140
未収入金	331,920,978	5,045,609
未収配当金	875,286,638	948,984,720
未収利息	319,472	368,056
前払金	245,000	7,485,000
その他未収収益	5 17,048,452	17,292,950
流動資産合計	142,402,314,195	156,875,249,201
資産合計	142,402,314,195	156,875,249,201
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,516,300	49,680
未払金	-	693,489,959
未払解約金	132,523,100	129,332,800
受入担保金	11,400,474,434	9,421,551,195
その他未払費用	-	145,460
流動負債合計	11,536,513,834	10,244,569,094
負債合計	11,536,513,834	10,244,569,094
純資産の部		
元本等		
元本	1 134,029,657,083	130,458,954,190
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 3,163,856,722	16,171,725,917
元本等合計	130,865,800,361	146,630,680,107
純資産合計	130,865,800,361	146,630,680,107
負債純資産合計	142,402,314,195	156,875,249,201

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首	平成29年2月16日	平成29年6月16日
期首元本額	135,201,014,146円	134,029,657,083円
期中追加設定元本額	6,209,053,469円	16,293,172,951円
期中一部解約元本額	7,380,410,532円	19,863,875,844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	5,055,231,359円	4,153,396,880円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	12,522,408,705円	9,718,686,101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	65,631,796円	61,521,904円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	104,147,960円	71,040,156円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,731,066,718円	1,168,663,058円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	82,994,802円	59,978,575円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	2,618,789,300円	1,610,026,616円
D-I's TOPIXイン デックス	33,134,673円	27,076,578円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	27,298,782円	21,422,329円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	573,610円	637,974円
iFree TOPIXイン デックス	201,775,854円	501,844,025円
iFree 8資産バランス	413,913,003円	876,329,679円
DCダイワ日本株式インデッ クス	60,941,949,427円	62,933,028,590円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,268,713,269円	2,334,930,943円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,301,710,216円	2,510,392,046円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,140,823,423円	2,438,475,706円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,898,761,117円	4,407,980,880円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	21,842,506円	14,753,126円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	58,490,475円	48,545,108円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	13,562,238円	14,282,313円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	404,752円	334,996円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	400,556円	343,410円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	788,422円	684,622円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	14,765,532円	2,185,320円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	97,143,655円	4,842,830円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	35,417,495円	10,343,078円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	944,660,579円	234,779,386円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	204,092,937円	164,962,864円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	12,457,193,725円	9,950,968,666円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	332,322,209円	50,169,076円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	516,570,023円	44,279,094円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,054,630,854円	858,675,952円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	158,236,001円	129,181,252円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	266,976,479円	225,110,840円
ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	54,920,318円	102,672,198円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	5,079,147,734円	7,617,246,603円

	ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	4,268,922円	89,512,504円
	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	489,697,996円	1,719,661,688円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,147,646,790円	1,348,424,482円
	ダイワライフスタイル25	190,814,036円	174,040,116円
	ダイワライフスタイル50	640,205,929円	615,588,461円
	ダイワライフスタイル75	509,632,026円	519,964,237円
	DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	15,326,900,880円	13,621,969,928円
	計	134,029,657,083円	130,458,954,190円
2.	期末日における受益権の総数	134,029,657,083口	130,458,954,190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3,163,856,722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 10,828,223,800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 8,912,218,000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 579,400,000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 756,200,000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16,335,197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16,490,162円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
----	------------------------------

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年6月15日現在	平成30年6月15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	21,743,143,204	9,379,912,312
合計	21,743,143,204	9,379,912,312

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成28年9月21日から平成29年6月15日まで、及び平成29年9月20日から平成30年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成29年6月15日 現在				平成30年6月15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								
株値指数 先物取引								
買 建	1,511,115,000	-	1,507,650,000	3,465,000	1,804,600,000	-	1,804,870,000	270,000
合計	1,511,115,000	-	1,507,650,000	3,465,000	1,804,600,000	-	1,804,870,000	270,000

(注) 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額	0.9764円	1.1240円
(1万口当たり純資産額)	(9,764円)	(11,240円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,800	3,760.00	14,288,000	貸付株式数 1,000株
日本水産	71,300	545.00	38,858,500	
マルハニチロ	12,100	4,355.00	52,695,500	
カネコ種苗	5,400	1,590.00	8,586,000	
サカタのタネ	9,500	4,220.00	40,090,000	貸付株式数 2,600株
ホクト	6,500	1,994.00	12,961,000	
ショーボンドHD	6,000	7,640.00	45,840,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ミライト・ホールディングス	18,900	1,785.00	33,736,500	貸付株式数 5,200株 (5,200株)
タマホーム	10,300	1,056.00	10,876,800	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
TATERU	6,400	2,158.00	13,811,200	貸付株式数 1,700株
日鉄鉱業	2,100	5,540.00	11,634,000	
三井松島	5,000	1,603.00	8,015,000	
国際石油開発帝石	305,900	1,174.50	359,279,550	
石油資源開発	9,100	2,804.00	25,516,400	
K&Oエナジーグループ	4,000	1,871.00	7,484,000	
安藤・間	49,900	975.00	48,652,500	貸付株式数 13,700株
東急建設	25,500	1,083.00	27,616,500	
コムシスホールディングス	21,900	2,953.00	64,670,700	貸付株式数 6,000株
ミサワホーム	7,500	979.00	7,342,500	
高松コンストラクションGP	4,200	3,290.00	13,818,000	
東建コーポレーション	2,500	9,820.00	24,550,000	
ヤマウラ	8,400	904.00	7,593,600	貸付株式数 2,300株
大成建設	63,500	6,170.00	391,795,000	
大林組	189,500	1,142.00	216,409,000	
清水建設	194,600	1,109.00	215,811,400	
飛鳥建設	77,100	194.00	14,957,400	
長谷工コーポレーション	74,200	1,609.00	119,387,800	
松井建設	10,500	952.00	9,996,000	
鹿島建設	280,000	899.00	251,720,000	
不動テトラ	55,000	199.00	10,945,000	

鉄建建設	4,100	2,981.00	12,222,100	
西松建設	14,200	3,170.00	45,014,000	
三井住友建設	45,200	766.00	34,623,200	
大豊建設	25,000	646.00	16,150,000	
前田建設	45,400	1,286.00	58,384,400	
奥村組	9,800	3,785.00	37,093,000	
東鉄工業	7,900	3,395.00	26,820,500	貸付株式数 1,200株
浅沼組	27,000	390.00	10,530,000	
戸田建設	72,000	988.00	71,136,000	
熊谷組	10,500	3,850.00	40,425,000	貸付株式数 2,700株
北野建設	19,000	377.00	7,163,000	
三井ホーム	11,000	713.00	7,843,000	
矢作建設	10,800	900.00	9,720,000	
ピーエス三菱	12,500	589.00	7,362,500	
日本ハウスHLDGS	17,500	551.00	9,642,500	貸付株式数 4,500株
大東建託	22,800	18,190.00	414,732,000	
新日本建設	8,600	1,330.00	11,438,000	
NIPPO	15,100	2,078.00	31,377,800	
東亜道路	1,700	3,850.00	6,545,000	貸付株式数 400株
前田道路	18,500	2,208.00	40,848,000	貸付株式数 5,100株
日本道路	1,800	6,000.00	10,800,000	
東亜建設	5,800	2,873.00	16,663,400	
若築建設	5,300	1,681.00	8,909,300	貸付株式数 1,400株
東洋建設	22,400	506.00	11,334,400	
五洋建設	74,100	735.00	54,463,500	
世紀東急	12,600	750.00	9,450,000	
福田組	2,400	6,950.00	16,680,000	
住友林業	38,400	1,660.00	63,744,000	
日本基礎技術	19,000	374.00	7,106,000	
日成ビルド工業	11,000	1,185.00	13,035,000	
バコーポレーション	21,900	503.00	11,015,700	
大和ハウス	187,600	3,963.00	743,458,800	
ライト工業	12,300	1,120.00	13,776,000	貸付株式数 3,400株
積水ハウス	203,900	1,927.50	393,017,250	
日特建設	10,300	624.00	6,427,200	
ユアテック	9,900	917.00	9,078,300	貸付株式数 2,700株
中電工	7,900	2,918.00	23,052,200	貸付株式数 500株
関電工	24,500	1,237.00	30,306,500	貸付株式数 6,800株
きんでん	41,100	1,818.00	74,719,800	
東京エネシス	8,200	1,265.00	10,373,000	

トーエネック	1,900	3,355.00	6,374,500	
住友電設	5,000	1,999.00	9,995,000	貸付株式数 1,400株
日本電設工業	9,400	2,459.00	23,114,600	
協和エクシオ	22,600	2,974.00	67,212,400	
日本工営	4,100	3,090.00	12,669,000	貸付株式数 1,100株
九電工	12,600	5,490.00	69,174,000	
三機工業	13,900	1,099.00	15,276,100	
日 揮	54,300	2,181.00	118,428,300	貸付株式数 1,600株
中外炉工業	3,700	2,839.00	10,504,300	
太平電業	4,500	3,040.00	13,680,000	貸付株式数 1,200株
高砂熱学	17,000	2,063.00	35,071,000	
NEC ネットエスアイ	5,800	2,522.00	14,627,600	
明星工業	12,600	842.00	10,609,200	
大 気 社	7,400	3,315.00	24,531,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
ダイダン	5,000	2,699.00	13,495,000	
日比谷総合設備	7,700	2,216.00	17,063,200	貸付株式数 500株
東芝プラントシステム	13,300	2,594.00	34,500,200	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
日本製粉	18,400	1,913.00	35,199,200	
日清製粉G本社	68,300	2,396.00	163,646,800	
昭和産業	5,200	2,996.00	15,579,200	貸付株式数 1,400株
中部飼料	7,600	2,064.00	15,686,400	貸付株式数 700株
フィード・ワン	44,000	236.00	10,384,000	
東洋精糖	8,600	1,236.00	10,629,600	
三井製糖	4,800	3,560.00	17,088,000	貸付株式数 1,300株
塩水港精糖	32,500	263.00	8,547,500	
日新製糖	3,800	2,130.00	8,094,000	
L I F U L L	20,100	739.00	14,853,900	
ジェイエイシーリクルート メント	4,900	2,193.00	10,745,700	貸付株式数 1,300株
日本M&Aセンター	38,100	3,530.00	134,493,000	
タケエイ	8,300	1,214.00	10,076,200	貸付株式数 2,100株
トラスト・テック	3,000	3,935.00	11,805,000	貸付株式数 800株 (700株)
コシダカホールディングス	14,700	1,681.00	24,710,700	
パソナグループ	5,700	1,757.00	10,014,900	貸付株式数 1,000株
C D S	6,600	1,445.00	9,537,000	貸付株式数 100株
リンクアンドモチベーショ ン	11,100	1,426.00	15,828,600	貸付株式数 2,900株

G C A	8,600	923.00	7,937,800	
エス・エム・エス	11,000	4,260.00	46,860,000	貸付株式数 2,900株
パーソルホールディングス	50,500	2,468.00	124,634,000	
リニカル	5,300	2,238.00	11,861,400	
クックパッド	19,100	572.00	10,925,200	貸付株式数 5,300株
森永製菓	13,500	5,360.00	72,360,000	貸付株式数 2,100株
江崎グリコ	16,000	5,560.00	88,960,000	貸付株式数 1,900株
不二家	4,300	2,561.00	11,012,300	
山崎製パン	46,400	2,813.00	130,523,200	
モロゾフ	1,700	6,690.00	11,373,000	
亀田製菓	3,800	6,110.00	23,218,000	貸付株式数 1,000株
寿スピリッツ	5,700	6,180.00	35,226,000	
カルビー	26,100	3,885.00	101,398,500	貸付株式数 7,200株
森永乳業	11,500	4,295.00	49,392,500	
六甲バター	4,200	2,431.00	10,210,200	
ヤクルト	33,500	7,450.00	249,575,000	貸付株式数 9,300株 (9,300株)
明治ホールディングス	37,600	9,630.00	362,088,000	
雪印メグミルク	13,800	2,994.00	41,317,200	
プリマハム	41,000	645.00	26,445,000	
日本ハム	24,500	4,535.00	111,107,500	
丸大食品	32,000	492.00	15,744,000	
S Foods	4,300	4,455.00	19,156,500	
伊藤ハム米久HLDGS	36,000	962.00	34,632,000	
スタジオアリス	3,300	2,634.00	8,692,200	
シミックホールディングス	4,800	2,343.00	11,246,400	
システナ	19,200	1,254.00	24,076,800	
デジタルアーツ	3,100	5,940.00	18,414,000	貸付株式数 800株 (800株)
新日鉄住金SOL	8,700	3,055.00	26,578,500	
総合警備保障	21,600	5,290.00	114,264,000	
キューブシステム	8,500	1,021.00	8,678,500	
いちご	81,000	539.00	43,659,000	
日本駐車場開発	82,900	183.00	15,170,700	
コア	4,900	1,429.00	7,002,100	
カカクコム	41,300	2,540.00	104,902,000	貸付株式数 8,200株
ディップ	7,900	2,832.00	22,372,800	
オプトホールディング	5,800	2,233.00	12,951,400	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ツクイ	14,700	936.00	13,759,200	貸付株式数 3,700株

エムスリー	57,400	4,645.00	266,623,000		
アウトソーシング	17,100	2,139.00	36,576,900	貸付株式数	4,100株
ウェルネット	7,700	1,206.00	9,286,200	貸付株式数	1,600株
ワールドホールディングス	2,100	3,455.00	7,255,500		
ディー・エヌ・エー	29,400	2,134.00	62,739,600	貸付株式数	8,200株
博報堂D Y H L D G S	74,800	1,820.00	136,136,000	貸付株式数	20,900株
ぐるなび	10,400	954.00	9,921,600		
ファンコミュニケーションズ	18,300	752.00	13,761,600	貸付株式数	4,900株
W D Bホールディングス	3,000	3,240.00	9,720,000		
ティア	10,300	1,086.00	11,185,800	貸付株式数	2,200株
バリューコマース	7,600	1,473.00	11,194,800	貸付株式数	1,500株
インフォマート	28,900	1,553.00	44,881,700	貸付株式数	7,900株
サッポロホールディングス	20,900	2,860.00	59,774,000	貸付株式数	5,700株
アサヒグループホールディングン	119,400	5,702.00	680,818,800		
キリンHD	273,000	3,009.00	821,457,000		
宝ホールディングス	44,200	1,460.00	64,532,000	貸付株式数	11,700株
オエノンホールディングス	31,100	437.00	13,590,700	貸付株式数	6,600株
コカ・コーラボトラーズJHD	40,300	4,510.00	181,753,000		
サントリー食品インター	43,500	4,900.00	213,150,000		
ダイドーグループHD	3,100	6,420.00	19,902,000		
伊藤園	19,100	5,240.00	100,084,000	貸付株式数	5,200株
キーコーヒー	7,000	2,196.00	15,372,000	貸付株式数	1,900株
日清オイリオグループ	6,600	3,310.00	21,846,000		
不二製油グループ	15,400	4,050.00	62,370,000		
J - オイルミルズ	3,200	3,990.00	12,768,000		
ローソン	14,000	6,940.00	97,160,000	貸付株式数	4,800株
サンエー	4,300	5,710.00	24,553,000	貸付株式数	1,200株
カワチ薬品	4,800	2,427.00	11,649,600	貸付株式数	1,300株
エービーシー・マート	10,200	6,420.00	65,484,000		
ハードオフコーポレーション	6,700	1,068.00	7,155,600	貸付株式数	300株
アスクル	5,800	3,450.00	20,010,000	貸付株式数	1,600株
ゲオホールディングス	10,800	1,563.00	16,880,400	貸付株式数	2,900株
アダストリア	9,000	1,471.00	13,239,000	貸付株式数	2,500株
くらコーポレーション	3,400	7,700.00	26,180,000	貸付株式数	200株
エレマテック	2,900	2,629.00	7,624,100	貸付株式数	800株
パルグループH L D G S	3,100	2,808.00	8,704,800		

JALUX	2,600	3,120.00	8,112,000	貸付株式数	700株
エディオン	21,100	1,142.00	24,096,200	貸付株式数	8,800株
あらた	3,100	6,850.00	21,235,000		
サーラコーポレーション	11,600	702.00	8,143,200		
ワッツ	6,700	1,127.00	7,550,900	貸付株式数	1,800株
ハローズ	3,000	2,580.00	7,740,000		
J Pホールディングス	21,500	396.00	8,514,000	貸付株式数	6,100株 (2,000株)
あみやき亭	2,200	5,030.00	11,066,000		
東京エレクトロニクス	4,100	2,075.00	8,507,500	貸付株式数	400株
ひらまつ	16,800	525.00	8,820,000	貸付株式数	4,200株
フィールズ	5,900	1,019.00	6,012,100	貸付株式数	1,500株
双日	325,000	412.00	133,900,000	貸付株式数	90,300株
アルフレッサホールディングス	60,300	2,753.00	166,005,900		
大黒天物産	1,700	5,470.00	9,299,000	貸付株式数	400株
ハニーズホールディングス	7,800	1,005.00	7,839,000		
キッコーマン	43,100	5,540.00	238,774,000		
味の素	129,700	2,157.50	279,827,750		
キューピー	31,700	2,797.00	88,664,900	貸付株式数	4,900株
ハウス食品G本社	22,100	3,995.00	88,289,500	貸付株式数	6,100株
カゴメ	22,900	3,790.00	86,791,000	貸付株式数	6,400株
アリアケジャパン	5,300	9,780.00	51,834,000		
ニチレイ	27,200	2,902.00	78,934,400		
横浜冷凍	15,400	1,052.00	16,200,800	貸付株式数	4,300株
東洋水産	30,600	4,065.00	124,389,000		
日清食品HD	24,400	8,280.00	202,032,000	貸付株式数	6,200株
永谷園ホールディングス	8,000	1,500.00	12,000,000		
フジッコ	6,400	2,934.00	18,777,600	貸付株式数	1,700株
ロックフィールド	6,900	1,988.00	13,717,200		
日本たばこ産業	350,700	3,165.00	1,109,965,500		
ケンコーマヨネーズ	4,300	4,235.00	18,210,500		
わらべや日洋HD	4,100	2,701.00	11,074,100	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
北の達人コーポ	17,700	859.00	15,204,300		
ユーグレナ	23,200	909.00	21,088,800	貸付株式数	6,300株 (5,800株)
片倉工業	8,200	1,336.00	10,955,200		
ゲンゼ	4,700	7,210.00	33,887,000		
ヒューリック	117,200	1,194.00	139,936,800		

アルペン	4,500	2,475.00	11,137,500		
クオール	6,500	2,299.00	14,943,500	貸付株式数	1,800株
アルコニックス	6,600	1,802.00	11,893,200	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
神戸物産	3,800	5,280.00	20,064,000		
ジンス	4,000	6,810.00	27,240,000	貸付株式数	1,000株
ビックカメラ	33,500	1,757.00	58,859,500	貸付株式数	8,900株 (8,900株)
D C Mホールディングス	27,900	1,065.00	29,713,500	貸付株式数	9,100株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	4,100	5,080.00	20,828,000	貸付株式数	800株
M o n o t a R O	20,100	4,835.00	97,183,500	貸付株式数	5,600株
あい ホールディングス	9,400	2,595.00	24,393,000		
ディーブイエックス	4,800	1,398.00	6,710,400		
アークランドサービスHD	5,200	2,489.00	12,942,800	貸付株式数	1,400株
J . フロント リテイリング	66,100	1,819.00	120,235,900		
ドトール・日レスHD	9,900	2,268.00	22,453,200	貸付株式数	2,700株
マツモトキヨシH L D G S	23,200	5,250.00	121,800,000	貸付株式数	4,100株
ブロンコビリー	3,500	4,660.00	16,310,000		
スタートトゥデイ	55,300	4,380.00	242,214,000	貸付株式数	15,300株
物語コーポレーション	1,800	11,220.00	20,196,000	貸付株式数	500株
ココカラファイン	5,900	7,480.00	44,132,000		
三越伊勢丹HD	103,800	1,425.00	147,915,000		
東洋紡	21,800	1,843.00	40,177,400	貸付株式数	6,100株
ユニチカ	18,600	660.00	12,276,000		
富士紡ホールディングス	3,600	3,895.00	14,022,000		
日清紡ホールディングス	34,400	1,252.00	43,068,800	貸付株式数	9,400株
倉敷紡績	59,000	362.00	21,358,000		
ダイワボウHD	4,900	6,290.00	30,821,000		
シキボウ	6,400	1,316.00	8,422,400		
日東紡績	8,700	2,622.00	22,811,400	貸付株式数	2,400株
トヨタ紡織	16,500	2,134.00	35,211,000	貸付株式数	3,500株
マクニカ・富士エレH L D G S	11,000	1,878.00	20,658,000		
ウエルシアHD	15,000	6,030.00	90,450,000		
クリエイトS D H	8,500	3,345.00	28,432,500	貸付株式数	2,300株
バイタルK S K H D	10,300	1,164.00	11,989,200		
U K Cホールディングス	4,500	2,292.00	10,314,000		

ＴＯＫＡＩホールディングス	30,300	1,133.00	34,329,900		
三洋貿易	4,100	2,198.00	9,011,800		
ウイン・パートナーズ	5,500	1,414.00	7,777,000		
ジョイフル本田	8,800	3,770.00	33,176,000	貸付株式数	2,300株
鳥貴族	2,700	2,742.00	7,403,400	貸付株式数	700株
ホットランド	5,300	1,413.00	7,488,900	貸付株式数	1,400株 (1,300株)
すかいらーく	35,000	1,699.00	59,465,000	貸付株式数	9,400株 (2,800株)
綿半ホールディングス	3,200	3,465.00	11,088,000		
日本毛織	16,300	1,097.00	17,881,100		
ユナイテッド・スーパー マケ	18,100	1,453.00	26,299,300		
三栄建築設計	3,000	1,924.00	5,772,000		
野村不動産HLDGS	37,600	2,548.00	95,804,800		
三重交通グループHD	14,600	509.00	7,431,400		
サムティ	5,800	2,275.00	13,195,000	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本商業開発	4,600	1,950.00	8,970,000	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
プレサンスコーポレーショ ン	8,400	1,801.00	15,128,400		
ユニゾホールディングス	7,300	2,178.00	15,899,400	貸付株式数	1,700株
日本管理センター	5,400	1,377.00	7,435,800	貸付株式数	1,500株 (900株)
フージャースHD	17,100	821.00	14,039,100	貸付株式数	4,200株
オープンハウス	9,400	6,830.00	64,202,000		
東急不動産HD	134,000	801.00	107,334,000		
飯田GHD	46,200	2,185.00	100,947,000		
帝国繊維	6,900	2,367.00	16,332,300		
日本コークス工業	62,000	118.00	7,316,000		
あさひ	5,400	1,454.00	7,851,600	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本調剤	2,300	3,000.00	6,900,000	貸付株式数	400株 (100株)
コスモス薬品	2,900	23,950.00	69,455,000	貸付株式数	700株
シップヘルスケアHD	11,200	4,240.00	47,488,000		
ソフトクリエイトHD	5,500	1,783.00	9,806,500	貸付株式数	700株
セブン&アイ・HLDGS	233,500	4,946.00	1,154,891,000	貸付株式数	64,000株
薬王堂	2,700	3,895.00	10,516,500	貸付株式数	800株

クリエイト・レストランツ・ホール	16,300	1,607.00	26,194,100	貸付株式数	4,400株
ツルハホールディングス	12,200	16,120.00	196,664,000	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
サンマルクホールディングス	4,100	2,887.00	11,836,700	貸付株式数	1,100株
トリドールホールディングス	7,100	2,917.00	20,710,700	貸付株式数	1,900株
帝人	46,200	2,086.00	96,373,200	貸付株式数	13,000株 (13,000株)
東レ	431,000	887.80	382,641,800		
クラレ	97,400	1,653.00	161,002,200		
旭化成	369,200	1,446.00	533,863,200		
サカイオーベックス	3,200	2,310.00	7,392,000		
TOKYO BASE	5,900	1,034.00	6,100,600		
宮地エンジニアリングG	2,700	2,132.00	5,756,400		
トーカロ	16,500	1,315.00	21,697,500		
アルファCO	2,900	1,672.00	4,848,800		
SUMCO	52,400	2,349.00	123,087,600		
川田テクノロジーズ	1,400	7,780.00	10,892,000	貸付株式数	300株
住江織物	2,100	2,853.00	5,991,300		
アツギ	9,800	1,206.00	11,818,800		
コメダホールディングス	10,800	2,165.00	23,382,000		
ダイユー・リックHLDGS	9,100	1,138.00	10,355,800		
クスリのアオキHLDGS	4,600	7,890.00	36,294,000		
ダイニク	7,400	1,061.00	7,851,400		
共和レザー	7,800	1,039.00	8,104,200		
スシローグローバルHLDGS	5,900	6,890.00	40,651,000		
LIXILピバ	6,600	1,864.00	12,302,400		
セーレン	13,900	1,899.00	26,396,100		
ソトー	9,600	1,044.00	10,022,400	貸付株式数	1,500株
東海染工	5,500	1,452.00	7,986,000		
小松精練	11,300	1,008.00	11,390,400		
ワコールホールディングス	15,400	3,405.00	52,437,000		
ホギメディカル	7,500	5,000.00	37,500,000	貸付株式数	2,100株
TSIホールディングス	22,300	818.00	18,241,400		
TIS	18,600	5,240.00	97,464,000		
電算システム	5,500	2,144.00	11,792,000	貸付株式数	1,200株

グリー	34,500	633.00	21,838,500	貸付株式数	8,600株
コーエーテクモHD	8,700	2,231.00	19,409,700	貸付株式数	2,400株
三菱総合研究所	2,900	4,975.00	14,427,500		
K L a b	11,100	1,647.00	18,281,700	貸付株式数	300株
ポルトゥウィン・ピット クル	5,100	2,446.00	12,474,600		
ネクソン	125,100	1,764.00	220,676,400		
アイスタイル	15,000	1,222.00	18,330,000	貸付株式数	4,100株
エイチーム	4,500	2,647.00	11,911,500	貸付株式数	1,200株
テクノスジャパン	8,900	1,036.00	9,220,400	貸付株式数	800株
コロプラ	19,000	772.00	14,668,000	貸付株式数	4,700株 (4,500株)
ブロードリーフ	30,300	602.00	18,240,600	貸付株式数	3,700株
ハーツユナイテッドグルー プ	4,500	1,699.00	7,645,500		
メディアドゥHLDGS	3,000	2,378.00	7,134,000		
特種東海製紙	3,400	4,640.00	15,776,000		
ティーガイア	5,600	3,115.00	17,444,000	貸付株式数	1,500株
豆蔵ホールディングス	7,100	1,047.00	7,433,700	貸付株式数	1,700株
ガンホー・オンライン・エ ンター	153,000	283.00	43,299,000	貸付株式数	42,600株
GMOペイメントゲート ウェイ	4,600	11,850.00	54,510,000	貸付株式数	1,300株
インターネットイニシア ティブ	9,700	2,349.00	22,785,300	貸付株式数	2,700株
さくらインターネット	9,700	863.00	8,371,100		
S R Aホールディングス	3,700	2,971.00	10,992,700		
システムインテグレータ	7,500	1,096.00	8,220,000		
朝日ネット	17,200	532.00	9,150,400		
コムチュア	4,100	3,070.00	12,587,000	貸付株式数	800株
王子ホールディングス	245,000	715.00	175,175,000		
日本製紙	22,800	1,867.00	42,567,600		
三菱製紙	14,600	649.00	9,475,400	貸付株式数	4,000株
北越紀州製紙	31,300	591.00	18,498,300		
中越パルプ	4,000	1,799.00	7,196,000		
大王製紙	23,000	1,590.00	36,570,000	貸付株式数	6,400株 (6,200株)
g u m i	8,100	826.00	6,690,600	貸付株式数	2,100株
アカツキ	1,600	4,535.00	7,256,000	貸付株式数	300株
L I N E	17,200	4,325.00	74,390,000	貸付株式数	4,800株

レンゴー	56,100	1,019.00	57,165,900	貸付株式数 15,700株 (15,700株)
トーモク	4,200	2,195.00	9,219,000	
ザ・バック	4,400	3,800.00	16,720,000	貸付株式数 500株
AOI TYO HOLD INGS	6,400	1,456.00	9,318,400	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
マクロミル	7,500	2,500.00	18,750,000	貸付株式数 2,000株
昭和電工	39,700	4,960.00	196,912,000	
住友化学	432,000	644.00	278,208,000	
住友精化	2,500	5,790.00	14,475,000	
日産化学	34,300	5,150.00	176,645,000	
ラサ工業	4,000	3,105.00	12,420,000	貸付株式数 1,100株
クレハ	5,100	7,410.00	37,791,000	貸付株式数 1,400株
テイカ	5,100	2,546.00	12,984,600	
石原産業	11,800	1,120.00	13,216,000	貸付株式数 500株
日本曹達	40,000	608.00	24,320,000	
東ソー	85,200	1,807.00	153,956,400	
トクヤマ	17,400	3,715.00	64,641,000	
セントラル硝子	11,700	2,378.00	27,822,600	貸付株式数 3,200株
東亜合成	33,700	1,303.00	43,911,100	貸付株式数 5,000株
大阪ソーダ	5,900	3,100.00	18,290,000	貸付株式数 1,600株
関東電化	15,100	1,064.00	16,066,400	貸付株式数 4,100株
デンカ	21,300	3,885.00	82,750,500	
イビデン	34,300	1,820.00	62,426,000	貸付株式数 9,500株
信越化学	98,100	10,430.00	1,023,183,000	
日本カ-バイド	3,500	2,023.00	7,080,500	
堺化学	4,400	2,906.00	12,786,400	
エア・ウォーター	48,000	2,110.00	101,280,000	
大陽日酸	45,500	1,686.00	76,713,000	貸付株式数 12,700株
日本化学工業	3,400	4,165.00	14,161,000	
日本パ-カラijing	29,700	1,691.00	50,222,700	
高压ガス	11,100	1,010.00	11,211,000	
四国化成	9,200	1,540.00	14,168,000	貸付株式数 100株
戸田工業	2,100	2,901.00	6,092,100	
ステラ ケミファ	3,500	3,900.00	13,650,000	貸付株式数 900株
保土谷化学	2,400	3,620.00	8,688,000	
日本触媒	9,000	8,290.00	74,610,000	貸付株式数 2,500株
大日精化	4,800	3,595.00	17,256,000	
カネカ	79,000	1,064.00	84,056,000	
協和発酵キリン	70,600	2,357.00	166,404,200	

三菱瓦斯化学	49,100	2,712.00	133,159,200	
三井化学	53,400	3,045.00	162,603,000	
J S R	59,500	1,921.00	114,299,500	
東京応化工業	10,300	4,230.00	43,569,000	貸付株式数 2,800株
大阪有機化学	6,200	1,540.00	9,548,000	
三菱ケミカルH L D G S	395,600	970.20	383,811,120	
K H ネオケム	9,400	3,290.00	30,926,000	
ダイセル	78,200	1,225.00	95,795,000	
住友ベ - クライト	47,000	1,070.00	50,290,000	
積水化学	121,300	1,856.00	225,132,800	
日本ゼオン	49,400	1,387.00	68,517,800	
アイカ工業	16,000	4,050.00	64,800,000	
宇部興産	29,700	3,085.00	91,624,500	
積水樹脂	9,300	2,418.00	22,487,400	
タキロンシーアイ	14,800	663.00	9,812,400	
旭有機材	5,600	2,247.00	12,583,200	
日立化成	28,600	2,373.00	67,867,800	貸付株式数 7,900株
ニチバン	3,400	3,000.00	10,200,000	貸付株式数 900株
リケンテクノス	16,400	576.00	9,446,400	貸付株式数 4,500株
大倉工業	16,000	531.00	8,496,000	
積水化成成品	9,200	1,221.00	11,233,200	貸付株式数 2,300株
群栄化学	2,300	3,630.00	8,349,000	
ダイキョーニシカワ	11,800	1,728.00	20,390,400	
竹本容器	3,500	3,115.00	10,902,500	
日本化薬	36,900	1,198.00	44,206,200	
カーリットホールディングス	12,500	1,025.00	12,812,500	貸付株式数 4,000株
E P S ホールディングス	8,900	2,465.00	21,938,500	貸付株式数 2,400株
プレステージ・インター	12,600	1,626.00	20,487,600	
アミューズ	4,000	3,055.00	12,220,000	貸付株式数 1,000株
野村総合研究所	35,900	5,740.00	206,066,000	
ドリームインキュベータ	3,000	2,394.00	7,182,000	
クイック	4,300	1,853.00	7,967,900	
T A C	23,500	343.00	8,060,500	
ケネディクス	74,300	685.00	50,895,500	貸付株式数 20,300株
電通	66,300	5,260.00	348,738,000	貸付株式数 400株 (400株)
インテージホールディングス	8,500	1,173.00	9,970,500	
ぴあ	2,100	6,420.00	13,482,000	

イオンファンタジー	2,000	6,890.00	13,780,000	
ネクシーズグループ	2,800	1,691.00	4,734,800	
日本精化	9,200	1,240.00	11,408,000	貸付株式数 200株
扶桑化学工業	5,800	2,868.00	16,634,400	貸付株式数 1,200株
A D E K A	24,500	1,904.00	46,648,000	
日油	22,700	3,455.00	78,428,500	
ハリマ化成グループ	6,900	912.00	6,292,800	
花 王	139,300	8,647.00	1,204,527,100	
第一工業製薬	14,000	766.00	10,724,000	
三洋化成	3,600	5,070.00	18,252,000	貸付株式数 1,000株
武田薬品	208,400	4,365.00	909,666,000	貸付株式数 58,300株
アステラス製薬	579,100	1,768.00	1,023,848,800	
大日本住友製薬	41,500	2,365.00	98,147,500	貸付株式数 11,700株
塩野義製薬	79,100	5,786.00	457,672,600	貸付株式数 22,200株
田辺三菱製薬	68,000	1,915.00	130,220,000	貸付株式数 19,000株
あすか製薬	7,200	1,302.00	9,374,400	
日本新薬	14,900	7,530.00	112,197,000	
中外製薬	59,100	6,020.00	355,782,000	
科研製薬	10,000	5,850.00	58,500,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
エーザイ	68,000	8,174.00	555,832,000	
理研ビタミン	2,300	4,525.00	10,407,500	
ロート製薬	30,800	3,540.00	109,032,000	
小野薬品	134,800	2,673.00	360,320,400	
久光製薬	16,600	9,590.00	159,194,000	貸付株式数 3,200株
持田製薬	3,800	8,160.00	31,008,000	貸付株式数 300株
参天製薬	107,000	2,059.00	220,313,000	
扶桑薬品	3,700	2,974.00	11,003,800	
日本ケミファ	1,700	4,680.00	7,956,000	
ツムラ	20,000	3,905.00	78,100,000	
日医工	14,300	1,698.00	24,281,400	貸付株式数 4,000株
テ ル モ	86,800	6,720.00	583,296,000	
みらかホールディングス	15,600	3,265.00	50,934,000	貸付株式数 4,300株
キッセイ薬品工業	10,100	3,105.00	31,360,500	貸付株式数 2,700株
生化学工業	11,900	1,570.00	18,683,000	貸付株式数 1,400株
栄研化学	9,400	2,549.00	23,960,600	
鳥居薬品	3,700	2,841.00	10,511,700	貸付株式数 1,000株
J C R ファーマ	4,100	7,130.00	29,233,000	貸付株式数 1,100株
東和薬品	2,700	6,390.00	17,253,000	
富士製薬工業	2,200	4,140.00	9,108,000	

沢井製薬	11,300	5,000.00	56,500,000	貸付株式数	3,100株
ゼリア新薬工業	12,200	2,295.00	27,999,000	貸付株式数	3,400株
第一三共	162,100	4,017.00	651,155,700		
キョーリン製薬HD	14,700	2,344.00	34,456,800	貸付株式数	4,100株
大幸薬品	4,200	2,152.00	9,038,400		
ダイト	3,900	3,720.00	14,508,000		
大塚ホールディングス	117,500	5,474.00	643,195,000		
大正製薬HD	12,500	12,370.00	154,625,000	貸付株式数	3,500株
ペプチドリーム	26,100	4,865.00	126,976,500	貸付株式数	7,200株
大日本塗料	8,700	1,538.00	13,380,600		
日本ペイントHOLD	46,100	4,700.00	216,670,000	貸付株式数	12,800株
関西ペイント	62,400	2,271.00	141,710,400	貸付株式数	17,300株
中国塗料	17,800	1,067.00	18,992,600	貸付株式数	4,900株
日本特殊塗料	4,700	2,418.00	11,364,600	貸付株式数	900株
藤倉化成	12,400	685.00	8,494,000		
太陽ホールディングス	4,400	4,660.00	20,504,000	貸付株式数	1,200株
D I C	22,700	3,625.00	82,287,500		
サカティンクス	13,700	1,524.00	20,878,800	貸付株式数	3,500株
東洋インキSCホールディングン	54,000	606.00	32,724,000		
T & K TOKA	5,700	1,228.00	6,999,600		
アルプス技研	5,700	2,462.00	14,033,400	貸付株式数	1,500株
オリエンタルランド	64,100	11,960.00	766,636,000	貸付株式数	17,800株
ダスキン	14,200	2,786.00	39,561,200		
パーク24	32,300	2,994.00	96,706,200	貸付株式数	8,700株
明光ネットワークジャパン	7,800	1,270.00	9,906,000	貸付株式数	2,100株
ファルコホールディングス	7,100	1,899.00	13,482,900	貸付株式数	1,300株
クレスコ	1,900	3,385.00	6,431,500		
フジ・メディア・HD	57,900	1,892.00	109,546,800		
ラウンドワン	17,400	1,845.00	32,103,000	貸付株式数	4,700株
リゾートトラスト	22,800	2,064.00	47,059,200	貸付株式数	6,200株
オービック	17,700	9,630.00	170,451,000		
ジャストシステム	9,600	2,352.00	22,579,200		
ヤフー	409,100	381.00	155,867,100	貸付株式数	113,300株
ビー・エム・エル	7,500	2,919.00	21,892,500		
トレンドマイクロ	27,300	6,470.00	176,631,000	貸付株式数	100株
りらいあコミュニケーション	9,600	1,637.00	15,715,200	貸付株式数	1,000株
リソー教育	10,600	826.00	8,755,600		
日本オラクル	9,300	8,820.00	82,026,000		
フューチャー	9,700	1,445.00	14,016,500		

CAC HOLDINGS	7,600	1,096.00	8,329,600	貸付株式数	1,100株
ユー・エス・エス	65,700	2,149.00	141,189,300	貸付株式数	18,300株
オービックビジネスC	3,000	8,490.00	25,470,000		
伊藤忠テクノソリュー	26,000	2,013.00	52,338,000	貸付株式数	1,800株
アイティフォー	13,700	1,347.00	18,453,900	貸付株式数	2,800株
サイバーエージェント	34,700	6,630.00	230,061,000		
楽天	278,900	727.60	202,927,640		
テー・オー・ダブリュー	10,200	884.00	9,016,800		
大塚商会	33,800	4,610.00	155,818,000		
総合メディカル	5,300	2,448.00	12,974,400		
サイボウズ	15,400	544.00	8,377,600	貸付株式数	2,300株
セントラルスポーツ	2,400	4,065.00	9,756,000	貸付株式数	600株
パラカ	3,000	2,525.00	7,575,000	貸付株式数	800株
電通国際情報S	4,100	3,570.00	14,637,000		
デジタルガレージ	10,400	4,765.00	49,556,000	貸付株式数	2,100株
イーエムシステムズ	6,400	1,107.00	7,084,800		
ウェザーニューズ	2,700	3,355.00	9,058,500	貸付株式数	700株 (700株)
C I J	13,800	704.00	9,715,200		
WOWOW	3,000	3,420.00	10,260,000	貸付株式数	800株
フルキャストホールディングス	5,500	2,825.00	15,537,500		
富士フイルムHLDGS	116,700	4,312.00	503,210,400		
コニカミノルタ	129,500	1,062.00	137,529,000		
資生堂	105,800	8,993.00	951,459,400		
ライオン	79,300	2,131.00	168,988,300		
高砂香料	3,500	3,765.00	13,177,500		
マンダム	10,600	3,570.00	37,842,000	貸付株式数	2,900株 (2,900株)
ミルボン	7,700	5,070.00	39,039,000	貸付株式数	2,100株
ファンケル	13,800	5,720.00	78,936,000	貸付株式数	3,800株
コーセー	9,700	25,760.00	249,872,000	貸付株式数	2,600株
シーズ・ホールディングス	7,500	4,990.00	37,425,000		
ポーラ・オルビスHD	24,500	5,220.00	127,890,000	貸付株式数	6,700株
ノエビアホールディングス	3,800	8,250.00	31,350,000		
エステー	4,700	3,020.00	14,194,000	貸付株式数	800株
コニシ	9,900	1,874.00	18,552,600		
長谷川香料	7,900	2,202.00	17,395,800	貸付株式数	2,000株
小林製薬	15,800	9,950.00	157,210,000	貸付株式数	4,300株 (4,300株)

荒川化学工業	6,300	1,930.00	12,159,000	貸付株式数	800株
メック	4,900	2,060.00	10,094,000	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	4,100	2,465.00	10,106,500		
タカラバイオ	15,100	2,458.00	37,115,800		
J C U	7,200	2,658.00	19,137,600		
新田ゼラチン	10,300	842.00	8,672,600		
デクセリアルズ	14,700	1,102.00	16,199,400	貸付株式数	4,100株
アース製薬	4,300	5,710.00	24,553,000	貸付株式数	1,200株
北興化学	13,200	654.00	8,632,800		
クミアイ化学	26,600	854.00	22,716,400	貸付株式数	4,000株 (3,700株)
日本農薬	15,000	663.00	9,945,000	貸付株式数	4,100株 (4,100株)
昭和シエル石油	52,400	1,607.00	84,206,800		
ニチレキ	8,700	1,233.00	10,727,100		
ユシロ化学	5,300	1,652.00	8,755,600		
ビーピー・カストロール	3,300	1,683.00	5,553,900		
富士石油	16,700	387.00	6,462,900	貸付株式数	4,500株
M O R E S C O	4,500	1,892.00	8,514,000		
出光興産	47,600	3,780.00	179,928,000		
J X T Gホールディングス	896,800	764.00	685,155,200		
コスモエネルギーHLDG S	16,500	3,690.00	60,885,000		
横浜ゴム	31,300	2,412.00	75,495,600		
東洋ゴム	33,600	1,673.00	56,212,800		
ブリヂストン	187,100	4,424.00	827,730,400	貸付株式数	1,200株
住友ゴム	57,900	1,858.00	107,578,200	貸付株式数	16,100株
藤倉ゴム	10,500	691.00	7,255,500		
オカモト	20,000	1,256.00	25,120,000		
アキレス	5,300	2,319.00	12,290,700	貸付株式数	1,200株
ニッタ	5,600	4,325.00	24,220,000	貸付株式数	1,000株
住友理工	9,600	1,169.00	11,222,400	貸付株式数	2,600株
三ツ星ベルト	14,000	1,412.00	19,768,000		
バンドー化学	11,100	1,348.00	14,962,800		
旭硝子	56,900	4,535.00	258,041,500		
日本板硝子	28,600	1,106.00	31,631,600	貸付株式数	7,800株
有沢製作所	11,200	1,223.00	13,697,600	貸付株式数	2,900株
日本山村硝子	55,000	184.00	10,120,000		
日本電気硝子	24,200	3,180.00	76,956,000	貸付株式数	3,200株

住友大阪セメント	110,000	530.00	58,300,000	
太平洋セメント	35,700	4,055.00	144,763,500	
日本ヒュ-ム	11,800	901.00	10,631,800	
日本コンクリ-ト	25,600	364.00	9,318,400	
アジアパイルHD	10,700	745.00	7,971,500	貸付株式数 2,900株
東海カーボン	52,300	2,121.00	110,928,300	
日本カーボン	3,200	6,850.00	21,920,000	貸付株式数 800株
東洋炭素	4,100	3,440.00	14,104,000	
ノリタケ	3,400	5,240.00	17,816,000	
TOTO	43,700	5,630.00	246,031,000	
日本碍子	66,800	2,012.00	134,401,600	
日本特殊陶業	47,800	3,055.00	146,029,000	
MARUWA	2,100	9,060.00	19,026,000	
品川リフラクトリーズ	2,100	3,835.00	8,053,500	貸付株式数 500株
黒崎播磨	1,300	6,330.00	8,229,000	
ニッカトー	10,100	1,151.00	11,625,100	
フジミインコーポレーテッド	5,400	2,646.00	14,288,400	貸付株式数 1,500株
ニチアス	32,000	1,437.00	45,984,000	
新日鐵住金	251,700	2,255.00	567,583,500	
神戸製鋼所	102,800	1,142.00	117,397,600	
中山製鋼所	9,100	706.00	6,424,600	
合同製鐵	3,700	2,280.00	8,436,000	貸付株式数 1,000株
JFEホールディングス	149,600	2,281.00	341,237,600	
日新製鋼	16,100	1,581.00	25,454,100	
東京製鐵	30,800	1,007.00	31,015,600	貸付株式数 8,400株
共英製鋼	6,600	2,259.00	14,909,400	貸付株式数 1,700株
大和工業	11,600	3,575.00	41,470,000	
東京鐵鋼	4,500	1,672.00	7,524,000	貸付株式数 600株
大阪製鐵	3,800	2,194.00	8,337,200	
淀川製鋼所	7,300	2,908.00	21,228,400	
東洋鋼鈹	14,900	717.00	10,683,300	
丸一鋼管	19,300	3,765.00	72,664,500	貸付株式数 5,400株
大同特殊鋼	9,700	5,320.00	51,604,000	
日本高周波	7,500	833.00	6,247,500	貸付株式数 300株
日本冶金工	50,000	339.00	16,950,000	貸付株式数 13,400株
山陽特殊製鋼	6,900	2,764.00	19,071,600	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
愛知製鋼	2,800	4,375.00	12,250,000	
日立金属	60,700	1,208.00	73,325,600	貸付株式数 16,600株

日本金属	2,500	2,014.00	5,035,000		
大平洋金属	3,800	3,990.00	15,162,000	貸付株式数	1,000株
新日本電工	36,500	329.00	12,008,500	貸付株式数	9,600株
栗本鉄工所	3,900	1,971.00	7,686,900		
日本製鋼所	18,600	3,070.00	57,102,000		
三菱製鋼	5,800	2,286.00	13,258,800	貸付株式数	1,000株
日本精線	1,600	4,455.00	7,128,000		
大紀アルミニウム	11,900	732.00	8,710,800	貸付株式数	1,200株
日本軽金属HD	161,300	254.00	40,970,200		
三井金属	15,200	5,150.00	78,280,000		
東邦亜鉛	3,400	4,335.00	14,739,000	貸付株式数	800株
三菱マテリアル	36,100	3,145.00	113,534,500	貸付株式数	10,100株
住友鉱山	71,700	4,610.00	330,537,000		
DOWAホールディングス	14,000	3,645.00	51,030,000		
古河機金	9,600	1,635.00	15,696,000		
大阪チタニウム	6,600	1,699.00	11,213,400	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
東邦チタニウム	11,400	1,005.00	11,457,000		
UACJ	8,500	2,579.00	21,921,500	貸付株式数	2,300株
古河電工	18,800	4,040.00	75,952,000		
住友電工	207,700	1,692.50	351,532,250		
フジクラ	67,000	756.00	50,652,000		
昭和電線HLDGS	9,900	808.00	7,999,200		
タツタ電線	12,700	626.00	7,950,200	貸付株式数	3,400株
リョービ	6,900	3,635.00	25,081,500	貸付株式数	1,900株
アーレステイ	8,700	1,051.00	9,143,700		
アサヒHD	10,300	2,123.00	21,866,900	貸付株式数	2,700株
東洋製罐グループHD	36,900	1,870.00	69,003,000		
ホッカンホールディングス	19,000	370.00	7,030,000		
横河ブリッジHLDGS	10,800	2,657.00	28,695,600		
OSJBHD	33,700	290.00	9,773,000		
駒井ハルテック	3,100	2,378.00	7,371,800		
三和ホールディングス	52,700	1,209.00	63,714,300		
文化シャツタ-	17,600	1,017.00	17,899,200		
三協立山	8,200	1,473.00	12,078,600	貸付株式数	2,200株
アルインコ	8,000	1,080.00	8,640,000	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
LIXILグループ	82,100	2,313.00	189,897,300	貸付株式数	11,000株
日本ファイルコン	11,700	613.00	7,172,100	貸付株式数	500株
ノーリツ	12,600	1,888.00	23,788,800	貸付株式数	3,500株

長府製作所	6,600	2,372.00	15,655,200	
リンナイ	9,900	10,280.00	101,772,000	貸付株式数 2,700株
ユニプレス	10,800	2,355.00	25,434,000	貸付株式数 700株
岡 部	12,300	1,007.00	12,386,100	
ジーテクト	6,800	1,960.00	13,328,000	
東 プ レ	10,400	3,015.00	31,356,000	
高周波熱錬	11,400	1,032.00	11,764,800	
東京製綱	5,100	1,937.00	9,878,700	貸付株式数 1,300株
パイオラックス	8,700	2,723.00	23,690,100	
エイチワン	6,300	1,313.00	8,271,900	
日本発条	54,200	1,089.00	59,023,800	貸付株式数 15,100株
三浦工業	24,400	2,831.00	69,076,400	
タ ク マ	19,500	1,323.00	25,798,500	
テクノプロ・ホールディング	10,400	7,280.00	75,712,000	
イー・ガーディアン	3,300	3,355.00	11,071,500	貸付株式数 800株
ジャパンマテリアル	16,100	1,800.00	28,980,000	貸付株式数 4,200株 (1,800株)
ベクトル	7,100	2,315.00	16,436,500	貸付株式数 1,900株
アサンテ	4,300	2,174.00	9,348,200	貸付株式数 200株
N・フィールド	3,800	1,700.00	6,460,000	貸付株式数 1,000株
M&Aキャピタルパートナー	1,400	10,640.00	14,896,000	
エスクローA J	11,100	485.00	5,383,500	
日本ビューホテル	8,700	1,458.00	12,684,600	
リクルートホールディングス	418,500	3,182.00	1,331,667,000	
ツ ガ ミ	15,000	1,078.00	16,170,000	
オークマ	6,200	6,020.00	37,324,000	貸付株式数 1,700株
東芝機械	31,000	571.00	17,701,000	
アマダホールディングス	81,400	1,132.00	92,144,800	
アイダエンジニア	13,700	1,175.00	16,097,500	
滝澤鉄工所	4,800	1,864.00	8,947,200	
F U J I	16,400	2,048.00	33,587,200	貸付株式数 4,500株
牧野フライス	27,000	906.00	24,462,000	
オーエスジー	25,300	2,422.00	61,276,600	貸付株式数 7,600株 (7,600株)
旭ダイヤモンド	17,700	865.00	15,310,500	貸付株式数 4,800株
D M G 森精機	30,100	1,692.00	50,929,200	貸付株式数 8,200株

ソディック	12,800	1,077.00	13,785,600	貸付株式数 3,400株 (3,300株)
ディスコ	7,700	19,970.00	153,769,000	
日東工器	4,000	2,769.00	11,076,000	
パンチ工業	6,400	1,204.00	7,705,600	貸付株式数 1,700株
日本郵政	307,800	1,243.00	382,595,400	貸付株式数 84,800株
ベルシステム24HLDGS	10,000	1,932.00	19,320,000	
ソラスト	3,800	3,575.00	13,585,000	
豊田自動織機	45,700	6,490.00	296,593,000	
豊和工業	4,300	1,052.00	4,523,600	貸付株式数 900株 (900株)
OKK	5,500	1,248.00	6,864,000	
石川製作所	2,100	2,002.00	4,204,200	貸付株式数 400株
東洋機械金属	10,000	722.00	7,220,000	貸付株式数 2,100株
島精機製作所	7,200	5,470.00	39,384,000	貸付株式数 1,900株
オプトラン	5,200	4,095.00	21,294,000	
ヤマシンフィルタ	9,500	1,150.00	10,925,000	貸付株式数 2,500株 (1,700株)
日阪製作所	10,300	1,052.00	10,835,600	
やまびこ	10,900	1,449.00	15,794,100	貸付株式数 3,000株
平田機工	2,100	7,430.00	15,603,000	貸付株式数 400株 (400株)
ナプテスコ	30,600	3,425.00	104,805,000	貸付株式数 5,700株
三井海洋開発	5,800	2,903.00	16,837,400	貸付株式数 1,600株
レオン自動機	5,600	2,175.00	12,180,000	
SMC	17,800	39,150.00	696,870,000	
ホソカワミクロン	2,400	7,340.00	17,616,000	
ユニオンツール	3,000	3,800.00	11,400,000	貸付株式数 700株
オイレス工業	7,100	2,326.00	16,514,600	
日精エーエスビー	2,000	5,940.00	11,880,000	貸付株式数 400株
サト-ホールディングス	7,800	3,215.00	25,077,000	貸付株式数 2,100株
技研製作所	3,900	2,608.00	10,171,200	
日精樹脂工業	6,400	1,266.00	8,102,400	貸付株式数 1,600株
小松製作所	273,400	3,393.00	927,646,200	
住友重機械	31,500	3,840.00	120,960,000	
日立建機	26,400	3,720.00	98,208,000	
巴工業	4,500	2,272.00	10,224,000	
井関農機	6,100	2,043.00	12,462,300	貸付株式数 1,600株
TOWA	5,400	1,296.00	6,998,400	貸付株式数 1,400株

丸山製作所	5,000	1,827.00	9,135,000		
北川鉄工所	3,400	2,756.00	9,370,400	貸付株式数	400株
シンニッタン	19,400	485.00	9,409,000		
ローツェ	3,300	2,438.00	8,045,400	貸付株式数	800株 (200株)
クボタ	302,900	1,843.00	558,244,700	貸付株式数	84,200株 (83,400株)
東洋エンジニア	11,400	820.00	9,348,000	貸付株式数	2,800株 (700株)
三菱化工機	3,500	2,112.00	7,392,000	貸付株式数	100株
月島機械	11,800	1,739.00	20,520,200		
帝国電機製作所	6,300	1,425.00	8,977,500		
新東工業	14,300	1,019.00	14,571,700		
渋谷工業	5,200	3,515.00	18,278,000		
アイチ コーポレーション	9,900	715.00	7,078,500	貸付株式数	2,700株
小森コーポレーション	13,700	1,364.00	18,686,800	貸付株式数	3,800株
鶴見製作所	5,000	1,886.00	9,430,000	貸付株式数	1,400株
住友精密	27,000	374.00	10,098,000	貸付株式数	1,000株
酒井重工業	1,800	3,905.00	7,029,000		
荏原製作所	23,100	3,525.00	81,427,500		
西島製作所	8,000	1,032.00	8,256,000		
北越工業	7,700	1,076.00	8,285,200		
千代田化工建	42,100	915.00	38,521,500	貸付株式数	11,400株
ダイキン工業	77,400	13,295.00	1,029,033,000		
オルガノ	2,800	3,085.00	8,638,000	貸付株式数	100株
ト - ヨ - カネツ	2,700	3,765.00	10,165,500		
栗田工業	30,000	3,060.00	91,800,000		
椿本チエイン	31,000	881.00	27,311,000		
日 機 装	20,100	1,195.00	24,019,500	貸付株式数	5,500株
新興プランテック	13,000	1,011.00	13,143,000	貸付株式数	3,600株
アネスト岩田	10,300	1,136.00	11,700,800	貸付株式数	300株
ダイフク	29,000	5,170.00	149,930,000		
加藤製作所	3,200	2,885.00	9,232,000		
油研工業	3,500	2,800.00	9,800,000		
タダノ	27,200	1,447.00	39,358,400		
フジテック	17,300	1,438.00	24,877,400	貸付株式数	4,800株
C K D	16,000	2,027.00	32,432,000		
キトー	5,300	2,419.00	12,820,700		
平和	17,700	2,623.00	46,427,100	貸付株式数	4,700株 (4,700株)

理想科学工業	6,000	2,257.00	13,542,000	貸付株式数	1,600株
SANKYO	13,400	4,470.00	59,898,000	貸付株式数	3,700株
日本金銭機械	6,800	1,276.00	8,676,800		
マースエンジニアリング	4,100	2,642.00	10,832,200	貸付株式数	1,100株
福島工業	3,600	5,060.00	18,216,000		
ダイコク電機	4,200	1,920.00	8,064,000	貸付株式数	1,100株
竹内製作所	9,400	2,385.00	22,419,000	貸付株式数	700株
アマノ	17,800	2,688.00	47,846,400	貸付株式数	4,900株
JUKI	8,800	1,189.00	10,463,200		
サンデンホールディングス	8,100	1,549.00	12,546,900	貸付株式数	2,100株
ブラザー工業	69,000	2,297.00	158,493,000	貸付株式数	19,100株
マックス	8,800	1,476.00	12,988,800		
モリタホールディングス	9,200	2,282.00	20,994,400		
グローリー	16,700	3,210.00	53,607,000		
新晃工業	6,300	1,916.00	12,070,800		
大和冷機工業	10,100	1,295.00	13,079,500	貸付株式数	1,800株
セガサミーホールディングス	56,000	1,967.00	110,152,000	貸付株式数	15,600株
日本ピストンリング	4,000	2,339.00	9,356,000		
リケン	2,700	5,960.00	16,092,000		
TPR	6,300	2,844.00	17,917,200		
ツバキ・ナカシマ	6,000	2,656.00	15,936,000	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,900	11,510.00	206,029,000		
大豊工業	5,100	1,325.00	6,757,500	貸付株式数	1,400株
日本精工	115,100	1,190.00	136,969,000	貸付株式数	33,100株 (33,100株)
NTN	125,400	466.00	58,436,400		
ジェイテクト	58,200	1,577.00	91,781,400		
不二越	5,200	5,170.00	26,884,000		
ミネベアミツミ	105,100	1,955.00	205,470,500		
日本トムソン	19,800	924.00	18,295,200	貸付株式数	5,200株
THK	35,300	3,500.00	123,550,000		
ユーシン精機	5,900	1,414.00	8,342,600	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
イーグル工業	7,000	1,819.00	12,733,000		
日本ピラ - 工業	7,200	1,579.00	11,368,800		
キッツ	25,200	941.00	23,713,200		
日立	1,362,000	817.90	1,113,979,800		
三菱電機	567,300	1,521.00	862,863,300		

富士電機	170,000	857.00	145,690,000	
東洋電機製造	3,600	1,900.00	6,840,000	貸付株式数 400株
安川電機	66,000	4,195.00	276,870,000	
シンフォニア テクノロ ジー	40,000	406.00	16,240,000	貸付株式数 10,000株
明 電 舎	49,000	408.00	19,992,000	
オリジン電気	4,000	2,482.00	9,928,000	
山洋電気	2,800	8,930.00	25,004,000	
デンヨー	5,600	1,918.00	10,740,800	貸付株式数 600株
三桜工業	9,900	741.00	7,335,900	
マキタ	73,700	5,130.00	378,081,000	貸付株式数 4,900株
東芝テック	40,000	670.00	26,800,000	
マブチモーター	15,000	5,120.00	76,800,000	
日本電産	68,300	17,370.00	1,186,371,000	
東光高岳	3,900	1,949.00	7,601,100	貸付株式数 900株
ダブル・スコープ	8,900	1,889.00	16,812,100	貸付株式数 2,100株 (100株)
ダイヘン	31,000	728.00	22,568,000	
ヤーマン	8,600	1,990.00	17,114,000	
J V C ケンウッド	46,800	333.00	15,584,400	貸付株式数 13,000株 (200株)
第一精工	3,400	2,090.00	7,106,000	貸付株式数 900株
日新電機	13,600	1,141.00	15,517,600	貸付株式数 3,700株
大崎電気	14,100	865.00	12,196,500	
オムロン	59,900	5,530.00	331,247,000	
日東工業	10,100	2,045.00	20,654,500	
I D E C	7,500	2,819.00	21,142,500	貸付株式数 1,900株
ジーエス・ユアサ コーポ	102,000	506.00	51,612,000	貸付株式数 27,000株
メルコホールディングス	3,100	4,155.00	12,880,500	貸付株式数 1,000株
日本電気	72,800	3,125.00	227,500,000	
富 士 通	584,000	708.30	413,647,200	
沖 電 気	22,400	1,253.00	28,067,200	貸付株式数 6,100株
電気興業	3,900	3,385.00	13,201,500	貸付株式数 1,000株
サンケン電気	34,000	608.00	20,672,000	
アイホン	4,900	1,763.00	8,638,700	貸付株式数 100株
ルネサスエレクトロニクス	32,400	1,109.00	35,931,600	
セイコーエプソン	84,800	1,944.00	164,851,200	貸付株式数 21,800株
ワコム	45,300	634.00	28,720,200	貸付株式数 9,100株
アルバック	13,100	4,710.00	61,701,000	
E I Z O	5,400	4,680.00	25,272,000	

ジャパンディスプレイ	121,100	149.00	18,043,900	貸付株式数 30,400株 (30,400株)
日本信号	15,900	1,094.00	17,394,600	貸付株式数 4,400株
京三製作所	17,000	829.00	14,093,000	
能美防災	8,100	2,513.00	20,355,300	
ホーチキ	5,100	2,178.00	11,107,800	
エレコム	5,300	2,706.00	14,341,800	
パナソニック	646,500	1,566.00	1,012,419,000	
シャープ	53,200	2,803.00	149,119,600	貸付株式数 14,700株
アンリツ	41,600	1,550.00	64,480,000	貸付株式数 11,400株
富士通ゼネラル	17,800	1,680.00	29,904,000	貸付株式数 4,800株
ソニー	379,300	5,445.00	2,065,288,500	貸付株式数 105,900株
T D K	29,400	11,490.00	337,806,000	
帝国通信工業	7,100	1,325.00	9,407,500	
タムラ製作所	23,200	760.00	17,632,000	貸付株式数 6,200株
アルプス電気	48,500	2,802.00	135,897,000	
池上通信機	40,000	156.00	6,240,000	
パイオニア	100,200	161.00	16,132,200	貸付株式数 27,600株
日本電波工業	13,400	615.00	8,241,000	貸付株式数 2,800株
日本トリム	1,500	4,785.00	7,177,500	貸付株式数 400株 (200株)
ローランド ディー・ ジー	3,600	2,514.00	9,050,400	
フオスタ - 電機	7,000	1,679.00	11,753,000	貸付株式数 1,900株
クラリオン	33,000	288.00	9,504,000	
S M K	18,000	398.00	7,164,000	
ヨコオ	4,700	2,175.00	10,222,500	
ホシデン	14,500	1,017.00	14,746,500	貸付株式数 4,000株
ヒロセ電機	9,200	14,580.00	134,136,000	貸付株式数 2,500株
日本航空電子	14,000	1,795.00	25,130,000	
T O A	7,400	1,178.00	8,717,200	
マクセルホールディングス	11,200	1,785.00	19,992,000	
古野電気	9,600	948.00	9,100,800	貸付株式数 500株
ユニデンホールディングス	24,000	344.00	8,256,000	
アルパイン	13,400	2,089.00	27,992,600	
スミダコーポレーション	7,000	1,255.00	8,785,000	貸付株式数 1,800株 (1,700株)
アイコム	3,900	2,720.00	10,608,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
リオン	3,600	2,298.00	8,272,800	

本多通信工業	6,700	960.00	6,432,000	
船井電機	9,500	670.00	6,365,000	貸付株式数 2,200株 (1,800株)
横河電機	56,300	2,008.00	113,050,400	貸付株式数 3,600株
新電元工業	2,100	5,770.00	12,117,000	貸付株式数 500株
アズビル	16,600	5,330.00	88,478,000	
日本光電工業	24,100	3,055.00	73,625,500	貸付株式数 900株
共和電業	19,500	444.00	8,658,000	貸付株式数 3,500株
堀場製作所	11,300	8,250.00	93,225,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
アドバンテスト	32,200	2,322.00	74,768,400	
エスベック	5,400	2,201.00	11,885,400	
キーエンス	27,800	67,560.00	1,878,168,000	
日置電機	3,600	4,650.00	16,740,000	
シスメックス	44,100	10,390.00	458,199,000	
日本マイクロニクス	11,900	1,024.00	12,185,600	
メガチップス	4,900	2,977.00	14,587,300	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,300	6,240.00	20,592,000	貸付株式数 900株
デンソー	125,900	5,535.00	696,856,500	
コーセル	8,800	1,379.00	12,135,200	
イリソ電子工業	4,800	6,840.00	32,832,000	
オプテックスグループ	9,600	2,990.00	28,704,000	貸付株式数 2,500株
千代田インテグレ	3,000	2,365.00	7,095,000	貸付株式数 200株
レーザーテック	12,400	3,230.00	40,052,000	
スタンレー電気	43,000	3,945.00	169,635,000	
岩崎電気	5,100	1,667.00	8,501,700	貸付株式数 1,000株
ウシオ電機	32,300	1,408.00	45,478,400	貸付株式数 9,200株
ヘリオステクノH	8,700	733.00	6,377,100	
日本セラミック	5,900	3,015.00	17,788,500	
古河電池	6,300	917.00	5,777,100	貸付株式数 1,400株 (1,000株)
山一電機	4,800	1,667.00	8,001,600	貸付株式数 1,200株
図研	5,100	1,831.00	9,338,100	
日本電子	22,000	1,137.00	25,014,000	
カシオ	45,500	1,703.00	77,486,500	
ファナック	53,800	22,630.00	1,217,494,000	貸付株式数 14,900株
日本シイエムケイ	12,000	743.00	8,916,000	貸付株式数 300株
エンプラス	2,800	3,200.00	8,960,000	貸付株式数 700株 (700株)

大真空	4,100	1,452.00	5,953,200	
ローム	25,400	9,630.00	244,602,000	
浜松ホトニクス	40,100	4,710.00	188,871,000	
三井ハイテック	8,400	1,416.00	11,894,400	貸付株式数 2,100株 (100株)
新光電気工業	22,000	992.00	21,824,000	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
京セラ	93,000	6,540.00	608,220,000	
太陽誘電	24,700	2,935.00	72,494,500	貸付株式数 6,900株
村田製作所	59,300	18,240.00	1,081,632,000	
ユーシン	15,500	726.00	11,253,000	貸付株式数 3,900株 (3,500株)
双葉電子工業	8,800	2,011.00	17,696,800	
日東電工	42,600	8,706.00	370,875,600	
北陸電気工業	5,300	1,309.00	6,937,700	
東海理化電機	13,500	2,116.00	28,566,000	
ニチコン	17,100	1,425.00	24,367,500	
日本ケミコン	4,700	4,255.00	19,998,500	貸付株式数 1,300株
K O A	8,100	2,675.00	21,667,500	
三井E & S H D	20,100	1,479.00	29,727,900	貸付株式数 5,400株
日立造船	42,500	531.00	22,567,500	貸付株式数 1,200株
三菱重工業	94,000	4,156.00	390,664,000	
川崎重工業	43,500	3,415.00	148,552,500	
I H I	43,200	4,075.00	176,040,000	
名村造船所	19,500	491.00	9,574,500	貸付株式数 5,100株
日本車輛	26,000	283.00	7,358,000	貸付株式数 7,000株
三菱ロジスネクスト	7,200	1,239.00	8,920,800	貸付株式数 1,100株
F P G	20,800	1,526.00	31,740,800	貸付株式数 4,000株
じもとホールディングス	55,200	178.00	9,825,600	
全国保証	15,900	5,190.00	82,521,000	貸付株式数 4,300株
めぶきフィナンシャルG	286,300	393.00	112,515,900	貸付株式数 79,700株
東京きらぼしF G	7,600	2,619.00	19,904,400	
九州フィナンシャルG	89,000	543.00	48,327,000	貸付株式数 24,500株
かんぽ生命保険	21,700	2,459.00	53,360,300	貸付株式数 5,900株
ゆうちょ銀行	161,700	1,344.00	217,324,800	
富山第一銀行	19,100	502.00	9,588,200	
コンコルディア・フィナンシャル	333,900	641.00	214,029,900	
西日本フィナンシャルH D	36,000	1,312.00	47,232,000	貸付株式数 9,500株
アルヒ	6,100	2,245.00	13,694,500	

日産自動車	664,200	1,091.00	724,642,200		
いすゞ自動車	163,900	1,526.00	250,111,400		
トヨタ自動車	688,400	7,562.00	5,205,680,800		
日野自動車	80,900	1,211.00	97,969,900	貸付株式数	22,600株
三菱自動車工業	210,000	882.00	185,220,000	貸付株式数	58,300株
エフテック	5,400	1,493.00	8,062,200		
武蔵精密工業	6,300	4,040.00	25,452,000	貸付株式数	1,700株
日産車体	22,300	1,031.00	22,991,300	貸付株式数	6,200株
新明和工業	24,100	1,306.00	31,474,600	貸付株式数	6,700株
極東開発工業	10,300	1,693.00	17,437,900	貸付株式数	2,800株
日信工業	11,700	2,060.00	24,102,000		
トピー工業	4,800	3,200.00	15,360,000	貸付株式数	500株
ティラド	2,400	3,730.00	8,952,000		
曙ブレーキ	30,200	341.00	10,298,200	貸付株式数	8,400株 (100株)
タチエス	9,700	1,940.00	18,818,000		
N O K	27,800	2,090.00	58,102,000		
フタバ産業	19,200	782.00	15,014,400		
K Y B	5,900	5,270.00	31,093,000		
市光工業	9,600	1,488.00	14,284,800	貸付株式数	2,500株
大同メタル工業	8,100	1,155.00	9,355,500		
プレス工業	30,500	649.00	19,794,500		
太平洋工業	13,200	1,803.00	23,799,600		
ケーヒン	12,800	2,295.00	29,376,000	貸付株式数	3,500株
河西工業	8,100	1,485.00	12,028,500		
アイシン精機	46,800	5,590.00	261,612,000		
マ ッ ダ	176,800	1,425.00	251,940,000		
今仙電機製作所	7,600	1,260.00	9,576,000		
本田技研	508,900	3,533.00	1,797,943,700		
スズキ	112,400	6,428.00	722,507,200	貸付株式数	31,400株 (24,400株)
S U B A R U	176,100	3,389.00	596,802,900		
安永	3,300	2,079.00	6,860,700	貸付株式数	800株
ヤマハ発動機	79,500	3,020.00	240,090,000	貸付株式数	22,000株
ショーワ	15,200	2,066.00	31,403,200		
小糸製作所	34,300	7,820.00	268,226,000		
T B K	22,400	544.00	12,185,600	貸付株式数	1,800株
エクセディ	6,600	3,630.00	23,958,000		
ミツバ	11,600	1,077.00	12,493,200	貸付株式数	1,400株
豊田合成	19,900	2,891.00	57,530,900		

愛三工業	10,700	1,038.00	11,106,600		
ヨロズ	6,600	1,767.00	11,662,200	貸付株式数	1,800株
エフ・シー・シー	9,300	3,145.00	29,248,500		
シマノ	22,700	16,510.00	374,777,000		
テイ・エス テック	13,100	4,825.00	63,207,500	貸付株式数	3,600株
関西みらいFG	26,500	878.00	23,267,000		
33FG	7,500	2,276.00	17,070,000		
ジャムコ	3,100	2,388.00	7,402,800	貸付株式数	900株 (900株)
小野建	5,400	2,016.00	10,886,400	貸付株式数	1,500株 (1,400株)
ノジマ	10,200	2,634.00	26,866,800		
佐島電機	8,700	1,045.00	9,091,500	貸付株式数	1,500株
伯東	4,100	1,716.00	7,035,600		
コンドーテック	8,500	1,032.00	8,772,000		
ライトオン	7,300	1,020.00	7,446,000	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,200	2,926.00	23,993,200	貸付株式数	2,100株
三菱食品	5,300	3,015.00	15,979,500		
良品計画	7,400	40,500.00	299,700,000	貸付株式数	900株
松田産業	5,800	1,674.00	9,709,200		
第一興商	8,100	5,160.00	41,796,000		
メディパルHD	54,000	2,518.00	135,972,000	貸付株式数	15,200株
アドヴァン	6,900	958.00	6,610,200	貸付株式数	900株 (600株)
萩原電気HLDGS	2,800	3,340.00	9,352,000		
アルビス	2,500	3,355.00	8,387,500	貸付株式数	300株
アズワン	4,300	8,060.00	34,658,000		
ドウシシャ	6,300	2,494.00	15,712,200		
小津産業	4,900	2,145.00	10,510,500	貸付株式数	1,300株
コジマ	17,300	568.00	9,826,400		
コーナン商事	8,000	2,730.00	21,840,000		
ネットワンシステムズ	23,400	1,901.00	44,483,400		
ワタミ	8,500	1,457.00	12,384,500	貸付株式数	2,200株
ドンキホーテホールディング	36,300	5,810.00	210,903,000	貸付株式数	10,100株
丸文	7,300	908.00	6,628,400		
西松屋チェーン	12,500	1,338.00	16,725,000	貸付株式数	3,400株
ゼンショーホールディングス	29,400	2,845.00	83,643,000	貸付株式数	8,100株

ハピネット	4,700	1,410.00	6,627,000		
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,775.00	12,957,500	貸付株式数	1,900株 (1,600株)
日本ライフライン	16,300	2,666.00	43,455,800	貸付株式数	4,400株
サイゼリヤ	9,000	2,569.00	23,121,000		
エクセル	3,200	2,549.00	8,156,800	貸付株式数	800株
V Tホールディングス	20,700	567.00	11,736,900	貸付株式数	5,700株
マルカキカイ	4,000	2,011.00	8,044,000		
アルゴグラフィックス	3,200	3,635.00	11,632,000		
I D O M	18,200	685.00	12,467,000		
ポプラ	11,600	883.00	10,242,800	貸付株式数	3,200株
ユナイテッドアローズ	6,900	4,105.00	28,324,500	貸付株式数	1,900株 (1,900株)
進和	4,700	2,570.00	12,079,000		
ダイトロン	4,100	2,561.00	10,500,100		
ハイデイ日高	7,600	2,774.00	21,082,400		
シークス	7,000	2,192.00	15,344,000	貸付株式数	1,900株
コロワイド	19,000	3,070.00	58,330,000	貸付株式数	5,200株
ピーシーデポコーポ	9,700	575.00	5,577,500	貸付株式数	2,600株 (500株)
壱番屋	3,900	5,220.00	20,358,000		
スギホールディングス	12,200	6,690.00	81,618,000		
島津製作所	67,600	3,135.00	211,926,000		
長野計器	7,500	1,341.00	10,057,500		
ブイ・テクノロジー	1,400	22,550.00	31,570,000		
スター精密	9,300	1,799.00	16,730,700	貸付株式数	2,500株
東京計器	5,300	1,252.00	6,635,600	貸付株式数	1,400株 (1,300株)
東京精密	10,200	4,015.00	40,953,000		
マニー	6,900	5,230.00	36,087,000	貸付株式数	1,900株
ニコン	96,100	1,802.00	173,172,200		
トプコン	30,300	1,975.00	59,842,500		
オリンパス	84,100	4,130.00	347,333,000		
理研計器	5,900	2,589.00	15,275,100		
S C R E E Nホールディングス	10,900	8,620.00	93,958,000		
キヤノン電子	5,600	2,388.00	13,372,800		
タムロン	4,700	2,062.00	9,691,400		
H O Y A	113,900	6,433.00	732,718,700		
ノーリツ鋼機	6,200	1,987.00	12,319,400	貸付株式数	1,600株

エー・アンド・デイ	11,000	1,111.00	12,221,000	
キヤノン	303,400	3,752.00	1,138,356,800	
リコー	171,400	1,014.00	173,799,600	
シチズン時計	66,100	730.00	48,253,000	貸付株式数 5,900株
リズム時計	4,000	2,372.00	9,488,000	貸付株式数 100株
メニコン	8,400	3,010.00	25,284,000	
パラマウントベッドHD	6,000	4,825.00	28,950,000	
SHOBI	13,700	446.00	6,110,200	貸付株式数 3,000株
ニホンフラッシュ	4,400	2,883.00	12,685,200	
前田工織	7,000	1,958.00	13,706,000	
アートネイチャー	9,000	717.00	6,453,000	
バンダイナムコHLDGS	58,500	4,620.00	270,270,000	
SHOEI	2,800	4,030.00	11,284,000	
マーベラス	9,900	946.00	9,365,400	貸付株式数 2,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	9,900	6,400.00	63,360,000	
萩原工業	5,200	1,869.00	9,718,800	貸付株式数 1,400株
エイベックス	10,200	1,524.00	15,544,800	貸付株式数 2,800株
トッパン・フォームズ	12,200	1,129.00	13,773,800	貸付株式数 3,400株
フジシールインターナショナル	12,600	4,110.00	51,786,000	貸付株式数 1,400株
タカラトミー	24,800	956.00	23,708,800	
レック	3,600	4,610.00	16,596,000	貸付株式数 900株 (900株)
大建工業	5,200	2,616.00	13,603,200	貸付株式数 100株
凸版印刷	155,000	897.00	139,035,000	
大日本印刷	72,000	2,469.00	177,768,000	貸付株式数 20,200株
共同印刷	2,500	2,968.00	7,420,000	
NISSHA	12,000	2,250.00	27,000,000	貸付株式数 3,200株 (2,700株)
藤森工業	4,800	3,795.00	18,216,000	
ヴィア・ホールディングス	15,800	720.00	11,376,000	貸付株式数 3,200株
宝印刷	6,900	1,874.00	12,930,600	
アシックス	56,300	1,763.00	99,256,900	貸付株式数 15,600株
ジェイ エス ピー	3,500	3,445.00	12,057,500	貸付株式数 900株
ニチハ	8,800	4,365.00	38,412,000	
エフピコ	4,800	6,410.00	30,768,000	貸付株式数 1,300株
ヤマハ	38,400	5,940.00	228,096,000	
河合楽器	3,300	5,510.00	18,183,000	

クリナップ	8,300	849.00	7,046,700	貸付株式数	2,300株
ピジヨン	34,200	5,530.00	189,126,000		
天馬	4,700	2,013.00	9,461,100		
キングジム	10,100	1,102.00	11,130,200		
象印マホービン	10,300	1,589.00	16,366,700		
リンテック	12,500	3,210.00	40,125,000	貸付株式数	3,500株
信越ポリマー	11,800	1,128.00	13,310,400		
東リ	22,300	353.00	7,871,900	貸付株式数	6,200株
イトーキ	15,800	658.00	10,396,400	貸付株式数	4,000株
任天堂	34,900	37,760.00	1,317,824,000		
三菱鉛筆	9,300	2,251.00	20,934,300	貸付株式数	2,600株
タカラスタンダード	11,700	1,877.00	21,960,900	貸付株式数	1,200株
コクヨ	27,000	2,002.00	54,054,000		
ナカバヤシ	13,300	739.00	9,828,700		
ニフコ	20,500	3,805.00	78,002,500	貸付株式数	5,700株
立川ブラインド	5,200	1,448.00	7,529,600	貸付株式数	1,400株
グローブライド	4,100	4,295.00	17,609,500		
オカムラ	19,900	1,618.00	32,198,200	貸付株式数	5,500株
日本バルカー	4,900	3,295.00	16,145,500		
伊藤忠	409,900	2,134.50	874,931,550		
丸紅	455,200	876.10	398,800,720		
スクロール	18,200	609.00	11,083,800		
高島	3,300	2,184.00	7,207,200	貸付株式数	900株
ヨンドシーホールディングス	6,000	2,867.00	17,202,000	貸付株式数	400株
三陽商会	4,900	2,419.00	11,853,100	貸付株式数	1,200株
長瀬産業	31,300	1,871.00	58,562,300		
蝶理	4,100	1,923.00	7,884,300		
豊田通商	62,300	3,940.00	245,462,000		
オンワードホールディングス	35,000	895.00	31,325,000	貸付株式数	9,800株
兼松	23,300	1,640.00	38,212,000	貸付株式数	6,400株
美津濃	5,700	4,135.00	23,569,500		
ツカモトコーポレーション	6,800	1,254.00	8,527,200	貸付株式数	200株
ユニー・ファミリーマートHD	18,000	12,050.00	216,900,000	貸付株式数	4,900株
三井物産	459,700	1,920.00	882,624,000		
日本紙パルプ	2,900	5,190.00	15,051,000		
東京エレクトロン	37,900	19,080.00	723,132,000		
日立ハイテクノロジーズ	19,300	4,740.00	91,482,000	貸付株式数	3,400株

カメイ	7,200	1,738.00	12,513,600	貸付株式数	2,000株
スターゼン	2,500	6,510.00	16,275,000	貸付株式数	600株
セイコーHD	8,500	2,537.00	21,564,500		
山 善	20,900	1,167.00	24,390,300		
住友商事	351,100	1,910.00	670,601,000		
日本ユニシス	15,700	2,773.00	43,536,100		
内田洋行	3,500	3,295.00	11,532,500		
三菱商事	391,500	3,205.00	1,254,757,500		
第一実業	3,100	3,450.00	10,695,000		
キャノンマーケティングJ PN	16,100	2,339.00	37,657,900		
西華産業	4,000	2,670.00	10,680,000		
菱洋エレクトロ	6,900	1,811.00	12,495,900		
ユアサ商事	5,100	3,750.00	19,125,000		
神鋼商事	2,000	3,075.00	6,150,000		
阪和興業	10,300	4,440.00	45,732,000		
正栄食品	3,400	3,850.00	13,090,000	貸付株式数	900株
カナデン	8,400	1,518.00	12,751,200		
菱電商事	5,000	1,853.00	9,265,000		
ニプロ	39,000	1,318.00	51,402,000	貸付株式数	10,800株
岩谷産業	12,000	3,930.00	47,160,000	貸付株式数	3,300株
すてきナイスグループ	6,100	1,357.00	8,277,700	貸付株式数	300株
極東貿易	20,000	466.00	9,320,000		
イ ワ キ	14,000	436.00	6,104,000	貸付株式数	2,400株
兼松エレクトロニクス	3,700	3,975.00	14,707,500		
三愛石油	14,600	1,433.00	20,921,800		
稲畑産業	12,900	1,602.00	20,665,800	貸付株式数	3,600株
ゴ - ルドウィン	3,600	9,660.00	34,776,000	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
ユニ・チャ - ム	119,800	3,462.00	414,747,600	貸付株式数	33,600株 (33,600株)
デサント	14,000	2,066.00	28,924,000	貸付株式数	3,800株
ワ キ タ	12,300	1,209.00	14,870,700	貸付株式数	3,400株
東邦ホールディングス	15,400	2,762.00	42,534,800	貸付株式数	4,300株
サンゲツ	17,900	2,260.00	40,454,000	貸付株式数	1,500株
ミツウロコグループ	9,300	882.00	8,202,600		
シナネンホールディングス	3,200	2,810.00	8,992,000		
伊藤忠エネクス	11,500	1,105.00	12,707,500	貸付株式数	3,200株
サンリオ	15,500	2,095.00	32,472,500	貸付株式数	4,600株
サンワ テクノス	5,300	1,626.00	8,617,800		

リョーサン	7,000	3,810.00	26,670,000		
新光商事	6,900	1,785.00	12,316,500		
トーホー	4,300	2,584.00	11,111,200	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
三信電気	5,500	1,938.00	10,659,000	貸付株式数	1,500株
東陽テクニカ	10,000	900.00	9,000,000		
モスフード サービス	7,400	3,340.00	24,716,000	貸付株式数	2,000株
加賀電子	5,000	2,826.00	14,130,000		
三益半導体	5,500	1,812.00	9,966,000	貸付株式数	1,300株
木曾路	7,500	2,872.00	21,540,000		
千趣会	15,400	547.00	8,423,800	貸付株式数	4,200株
タカキユー	35,900	217.00	7,790,300	貸付株式数	4,400株
ケーヨー	14,400	559.00	8,049,600		
上新電機	6,800	3,880.00	26,384,000		
日本瓦斯	10,600	6,310.00	66,886,000	貸付株式数	2,900株
ロイヤルホールディングス	10,000	3,050.00	30,500,000		
いなげや	6,900	1,889.00	13,034,100	貸付株式数	1,900株
島忠	13,900	3,500.00	48,650,000	貸付株式数	3,500株
チヨダ	6,600	2,649.00	17,483,400	貸付株式数	1,800株
ライフコーポレーション	4,200	2,818.00	11,835,600		
リンガーハット	7,200	2,635.00	18,972,000	貸付株式数	2,000株 (1,700株)
MrMaxHD	9,900	695.00	6,880,500		
AOKIホールディングス	10,600	1,674.00	17,744,400	貸付株式数	2,900株
オークワ	9,000	1,132.00	10,188,000	貸付株式数	2,000株
コメリ	8,300	2,896.00	24,036,800	貸付株式数	2,300株
青山商事	10,400	3,960.00	41,184,000	貸付株式数	2,900株
しまむら	6,500	11,590.00	75,335,000	貸付株式数	1,800株
高島屋	86,000	945.00	81,270,000		
松屋	12,500	1,685.00	21,062,500	貸付株式数	3,300株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	25,700	1,842.00	47,339,400	貸付株式数	7,100株
丸井グループ	53,900	2,400.00	129,360,000		
クレディセゾン	41,400	1,774.00	73,443,600		
アクシアル リテイリング	5,200	4,165.00	21,658,000		
イオン	214,200	2,410.50	516,329,100	貸付株式数	58,800株
イズミ	10,100	7,070.00	71,407,000	貸付株式数	2,800株
平和堂	11,100	2,679.00	29,736,900	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
フジ	7,000	2,335.00	16,345,000	貸付株式数	1,800株

ヤオコー	6,500	6,150.00	39,975,000	
ゼビオホールディングス	7,500	1,835.00	13,762,500	貸付株式数 2,100株
ケースホールディングス	48,500	1,258.00	61,013,000	貸付株式数 13,000株 (13,000株)
PALTAC	7,900	6,220.00	49,138,000	
新生銀行	49,000	1,759.00	86,191,000	
あおぞら銀行	33,200	4,395.00	145,914,000	
三菱UFJフィナンシャルG	3,913,800	658.70	2,578,020,060	
りそなホールディングス	611,700	653.10	399,501,270	
三井住友トラストHD	109,700	4,615.00	506,265,500	
三井住友フィナンシャルG	422,100	4,528.00	1,911,268,800	貸付株式数 118,200株
第四銀行	6,500	4,770.00	31,005,000	
北越銀行	5,900	2,435.00	14,366,500	
千葉銀行	196,000	865.00	169,540,000	
群馬銀行	107,500	638.00	68,585,000	貸付株式数 30,100株
武蔵野銀行	8,400	3,625.00	30,450,000	貸付株式数 2,300株
千葉興業銀行	21,900	508.00	11,125,200	
筑波銀行	33,800	286.00	9,666,800	貸付株式数 9,400株
七十七銀行	16,300	2,596.00	42,314,800	
青森銀行	4,700	3,435.00	16,144,500	貸付株式数 1,300株
秋田銀行	3,700	3,215.00	11,895,500	
山形銀行	6,200	2,473.00	15,332,600	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
岩手銀行	3,600	4,415.00	15,894,000	貸付株式数 1,000株
東邦銀行	47,200	426.00	20,107,200	貸付株式数 13,200株
東北銀行	8,900	1,406.00	12,513,400	
ふくおかフィナンシャルG	224,000	604.00	135,296,000	貸付株式数 61,000株
静岡銀行	143,700	1,097.00	157,638,900	
十六銀行	6,800	3,050.00	20,740,000	貸付株式数 1,900株
スルガ銀行	58,400	1,056.00	61,670,400	貸付株式数 16,000株
八十二銀行	93,800	505.00	47,369,000	
山梨中央銀行	37,000	475.00	17,575,000	
大垣共立銀行	8,300	2,932.00	24,335,600	貸付株式数 2,300株
福井銀行	5,000	2,500.00	12,500,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
北國銀行	6,200	4,830.00	29,946,000	
清水銀行	3,000	2,206.00	6,618,000	貸付株式数 800株 (800株)
滋賀銀行	46,000	596.00	27,416,000	

南都銀行	6,300	2,984.00	18,799,200	
百五銀行	50,000	471.00	23,550,000	
京都銀行	21,000	5,540.00	116,340,000	
紀陽銀行	19,800	1,903.00	37,679,400	貸付株式数 5,500株
ほくほくフィナンシャルG	34,700	1,621.00	56,248,700	貸付株式数 9,600株
広島銀行	78,300	808.00	63,266,400	
山陰合同銀行	31,200	1,043.00	32,541,600	
中国銀行	36,800	1,272.00	46,809,600	
伊予銀行	76,000	796.00	60,496,000	
百十四銀行	58,000	380.00	22,040,000	
四国銀行	9,000	1,466.00	13,194,000	
阿波銀行	43,000	745.00	32,035,000	
大分銀行	3,400	3,915.00	13,311,000	貸付株式数 900株
宮崎銀行	3,900	3,655.00	14,254,500	貸付株式数 600株
佐賀銀行	3,800	2,530.00	9,614,000	貸付株式数 700株
十八銀行	38,000	305.00	11,590,000	
沖縄銀行	5,200	4,365.00	22,698,000	
琉球銀行	10,800	1,739.00	18,781,200	貸付株式数 1,500株
セブン銀行	208,000	348.00	72,384,000	貸付株式数 57,500株
みずほフィナンシャルG	7,581,800	191.90	1,454,947,420	
高知銀行	8,600	1,253.00	10,775,800	
山口フィナンシャルG	63,000	1,333.00	83,979,000	貸付株式数 13,000株
芙蓉総合リース	6,400	7,920.00	50,688,000	
興銀リース	10,500	3,005.00	31,552,500	
東京センチュリー	11,500	6,570.00	75,555,000	貸付株式数 3,100株
SBIホールディングス	64,100	3,040.00	194,864,000	貸付株式数 17,700株
日本証券金融	23,700	632.00	14,978,400	貸付株式数 6,600株
アイフル	97,500	353.00	34,417,500	貸付株式数 27,400株 (300株)
名古屋銀行	4,100	4,070.00	16,687,000	貸付株式数 1,200株
北洋銀行	78,500	389.00	30,536,500	貸付株式数 21,900株
愛知銀行	2,300	5,310.00	12,213,000	
中京銀行	3,100	2,344.00	7,266,400	
大光銀行	3,800	2,285.00	8,683,000	
愛媛銀行	9,100	1,290.00	11,739,000	貸付株式数 2,500株
トマト銀行	8,300	1,565.00	12,989,500	
京葉銀行	45,000	501.00	22,545,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
栃木銀行	29,100	412.00	11,989,200	
北日本銀行	3,400	2,805.00	9,537,000	

東和銀行	10,900	1,222.00	13,319,800		
福島銀行	13,500	752.00	10,152,000	貸付株式数	1,600株
大東銀行	8,300	1,320.00	10,956,000		
リコーリース	4,300	3,725.00	16,017,500	貸付株式数	1,200株
イオンフィナンシャルサー ビス	39,300	2,513.00	98,760,900	貸付株式数	11,000株
アコム	116,500	438.00	51,027,000	貸付株式数	32,300株
ジャックス	7,200	2,437.00	17,546,400		
オリコ	123,900	154.00	19,080,600	貸付株式数	32,200株
日立キャピタル	15,000	2,920.00	43,800,000		
アプラスフィナンシャル	66,600	110.00	7,326,000	貸付株式数	16,300株
オリックス	372,400	1,863.00	693,781,200		
三菱UFJリース	139,700	709.00	99,047,300		
ジャフコ	7,900	4,780.00	37,762,000		
トモニホールディングス	45,400	508.00	23,063,200	貸付株式数	12,700株
大和証券G本社	470,700	648.90	305,437,230		
野村ホールディングス	959,000	566.20	542,985,800		
岡三証券グループ	46,000	564.00	25,944,000	貸付株式数	12,000株
丸三証券	19,400	1,018.00	19,749,200	貸付株式数	5,300株
東洋証券	38,000	262.00	9,956,000	貸付株式数	4,000株
東海東京HD	58,700	743.00	43,614,100	貸付株式数	15,900株
水戸証券	26,200	403.00	10,558,600	貸付株式数	5,200株
いちよし証券	13,600	1,267.00	17,231,200		
松井証券	24,500	1,056.00	25,872,000	貸付株式数	6,800株
SOMPOホールディング ス	109,700	4,613.00	506,046,100		
日本取引所グループ	161,500	2,179.00	351,908,500	貸付株式数	32,500株
マネックスG	60,400	595.00	35,938,000	貸付株式数	16,400株
カブドットコム証券	35,600	385.00	13,706,000	貸付株式数	9,600株
極東証券	8,200	1,492.00	12,234,400		
岩井コスモホールディング	7,900	1,473.00	11,636,700		
藍澤証券	14,100	801.00	11,294,100		
フィデアホール	63,500	174.00	11,049,000		
池田泉州HD	52,100	395.00	20,579,500		
アニコムホールディング ス	4,100	4,405.00	18,060,500	貸付株式数	700株
MS&AD	145,300	3,559.00	517,122,700		
SONY FH	45,300	2,130.00	96,489,000	貸付株式数	5,500株
第一生命HLDGS	315,100	2,070.00	652,257,000		
東京海上HD	209,900	5,574.00	1,169,982,600		

イー・ギャランティ	4,800	2,275.00	10,920,000	
NECキャピタルソリューション	3,500	2,020.00	7,070,000	
T&Dホールディングス	170,400	1,757.50	299,478,000	
アドバンスクリエイト	4,300	2,165.00	9,309,500	
三井不動産	280,000	2,742.50	767,900,000	
三菱地所	416,600	2,043.00	851,113,800	
平和不動産	10,100	2,242.00	22,644,200	
東京建物	61,000	1,544.00	94,184,000	
ダイビル	14,600	1,163.00	16,979,800	貸付株式数 1,900株
京阪神ビルディング	12,200	1,000.00	12,200,000	
住友不動産	135,000	4,280.00	577,800,000	
大京	9,000	2,503.00	22,527,000	貸付株式数 2,500株
テーオーシー	20,600	852.00	17,551,200	
レオパレス21	67,500	668.00	45,090,000	
スターツコーポレーション	7,800	2,748.00	21,434,400	
フジ住宅	11,700	987.00	11,547,900	
空港施設	11,100	635.00	7,048,500	
ゴールドクレスト	5,000	1,909.00	9,545,000	
リログループ	30,300	2,946.00	89,263,800	
日本エスリード	3,400	2,006.00	6,820,400	
日神不動産	9,600	724.00	6,950,400	
日本エスコン	11,800	676.00	7,976,800	
タカラレーベン	28,000	420.00	11,760,000	貸付株式数 7,700株
サンヨーハウジ 名古屋	8,000	1,226.00	9,808,000	
イオンモール	36,100	2,076.00	74,943,600	
カチタス	7,400	4,525.00	33,485,000	
東祥	3,700	4,240.00	15,688,000	貸付株式数 1,000株
トーセイ	8,400	1,373.00	11,533,200	
エヌ・ティ・ティ都市開発	34,900	1,221.00	42,612,900	貸付株式数 9,500株 (9,500株)
サンフロンティア不動産	9,100	1,345.00	12,239,500	貸付株式数 2,100株
エフ・ジェー・ネクスト	7,600	1,081.00	8,215,600	
グランディハウス	19,200	513.00	9,849,600	貸付株式数 5,300株
東武鉄道	59,000	3,605.00	212,695,000	貸付株式数 16,600株
相鉄ホールディングス	17,500	3,510.00	61,425,000	
東京急行	153,200	2,029.00	310,842,800	
京浜急行	78,400	1,956.00	153,350,400	貸付株式数 21,700株
小田急電鉄	83,200	2,475.00	205,920,000	
京王電鉄	31,400	5,460.00	171,444,000	貸付株式数 8,800株

京成電鉄	39,100	3,955.00	154,640,500	
富士急行	8,200	3,510.00	28,782,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
東日本旅客鉄道	102,200	11,080.00	1,132,376,000	
西日本旅客鉄道	51,100	8,202.00	419,122,200	
東海旅客鉄道	50,800	24,020.00	1,220,216,000	
西武ホールディングス	71,700	1,948.00	139,671,600	貸付株式数 13,400株
鴻池運輸	8,200	1,765.00	14,473,000	
西日本鉄道	15,300	3,125.00	47,812,500	貸付株式数 4,200株
ハマキョウレックス	4,500	3,575.00	16,087,500	
サカイ引越センター	3,200	5,770.00	18,464,000	貸付株式数 100株 (100株)
近鉄グループHLDGS	52,200	4,740.00	247,428,000	
阪急阪神HLDGS	71,300	4,755.00	339,031,500	
南海電鉄	25,200	3,245.00	81,774,000	貸付株式数 7,000株
京阪ホールディングス	23,700	4,015.00	95,155,500	貸付株式数 2,300株
名古屋鉄道	42,400	3,035.00	128,684,000	貸付株式数 11,800株
山陽電鉄	5,000	2,754.00	13,770,000	
トランコム	1,700	8,340.00	14,178,000	
日本通運	20,900	8,960.00	187,264,000	
ヤマトホールディングス	94,500	3,420.00	323,190,000	
山 九	13,700	6,280.00	86,036,000	
日 新	4,900	2,467.00	12,088,300	貸付株式数 800株
丸全昭和運輸	22,000	526.00	11,572,000	
センコーグループHLDGS	32,600	924.00	30,122,400	貸付株式数 9,000株
トナミホールディングス	1,600	7,360.00	11,776,000	貸付株式数 400株
ニッコンホールディングス	18,800	3,080.00	57,904,000	
福山通運	8,200	5,880.00	48,216,000	貸付株式数 2,200株
セイノーホールディングス	40,000	2,142.00	85,680,000	
日立物流	12,000	3,010.00	36,120,000	
丸和運輸機関	3,200	4,020.00	12,864,000	貸付株式数 800株 (800株)
日本郵船	44,300	2,340.00	103,662,000	
商船三井	33,800	2,940.00	99,372,000	
川崎汽船	24,700	2,271.00	56,093,700	貸付株式数 6,800株
N Sユニテッド海運	2,600	2,175.00	5,655,000	
飯野海運	28,900	514.00	14,854,600	
九州旅客鉄道	44,900	3,590.00	161,191,000	
S Gホールディングス	50,900	2,489.00	126,690,100	貸付株式数 14,100株

日本航空	99,400	4,294.00	426,823,600		
ANAホールディングス	104,500	4,450.00	465,025,000		
ヤマシタヘルスケアHLDGS	5,700	1,502.00	8,561,400	貸付株式数	1,500株
GENKY DRUG STORES	2,500	4,485.00	11,212,500	貸付株式数	100株
三菱倉庫	17,500	2,380.00	41,650,000	貸付株式数	3,600株
三井倉庫HOLD	37,000	357.00	13,209,000		
住友倉庫	34,000	695.00	23,630,000		
渋沢倉庫	6,700	1,848.00	12,381,600		
ヤマタネ	5,600	2,203.00	12,336,800		
東陽倉庫	29,200	369.00	10,774,800		
日本トランスシティ	19,000	542.00	10,298,000		
東洋埠頭	6,500	1,736.00	11,284,000		
上組	32,300	2,465.00	79,619,500		
キューソー流通システム	3,000	2,760.00	8,280,000		
近鉄エクスプレス	10,100	2,403.00	24,270,300	貸付株式数	2,800株
内外トランスライン	5,500	1,608.00	8,844,000	貸付株式数	1,500株
東京放送HD	31,200	2,524.00	78,748,800		
日本テレビHLDS	50,200	1,891.00	94,928,200	貸付株式数	2,300株
テレビ朝日HD	15,100	2,431.00	36,708,100	貸付株式数	100株 (100株)
スカパーJSA THD	40,700	519.00	21,123,300	貸付株式数	11,300株
テレビ東京HD	4,900	3,365.00	16,488,500	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本BS放送	5,500	1,400.00	7,700,000		
ワイヤレスゲート	4,900	1,461.00	7,158,900	貸付株式数	1,300株 (1,000株)
コネクシオ	4,300	1,995.00	8,578,500		
日本通信	79,200	203.00	16,077,600	貸付株式数	22,100株 (1,000株)
日本電信電話	397,700	5,236.00	2,082,357,200		
KDDI	497,300	3,038.00	1,510,797,400		
光通信	6,900	20,340.00	140,346,000	貸付株式数	1,400株
NTTドコモ	394,900	2,858.50	1,128,821,650		
エムティーアイ	10,200	628.00	6,405,600	貸付株式数	2,800株
GMOインターネット	21,000	2,852.00	59,892,000	貸付株式数	5,700株
カドカワ	16,800	1,260.00	21,168,000	貸付株式数	4,700株
ゼンリン	10,300	2,616.00	26,944,800	貸付株式数	2,800株
東京電力HD	452,700	507.00	229,518,900		

中部電力	174,400	1,695.50	295,695,200	
関西電力	231,700	1,625.00	376,512,500	
中国電力	73,700	1,460.00	107,602,000	貸付株式数 20,900株
北陸電力	55,900	1,159.00	64,788,100	貸付株式数 15,200株 (100株)
東北電力	134,100	1,374.00	184,253,400	
四国電力	50,900	1,590.00	80,931,000	
九州電力	124,400	1,262.00	156,992,800	貸付株式数 34,800株
北海道電力	56,700	770.00	43,659,000	
沖縄電力	11,800	2,294.00	27,069,200	
電源開発	44,600	2,898.00	129,250,800	
イーレックス	10,700	1,178.00	12,604,600	貸付株式数 2,700株
東京瓦斯	120,900	2,994.50	362,035,050	
大阪瓦斯	108,900	2,353.50	256,296,150	
東邦瓦斯	28,200	3,795.00	107,019,000	貸付株式数 7,800株
北海道瓦斯	39,000	309.00	12,051,000	貸付株式数 5,000株
西部瓦斯	6,800	3,030.00	20,604,000	
静岡ガス	16,600	1,081.00	17,944,600	
メタウォーター	3,200	3,135.00	10,032,000	
松竹	3,600	16,410.00	59,076,000	貸付株式数 100株
東宝	36,300	3,770.00	136,851,000	
エイチ・アイ・エス	8,400	3,630.00	30,492,000	貸付株式数 2,300株
東映	2,000	11,690.00	23,380,000	
NTTデータ	174,900	1,287.00	225,096,300	
共立メンテナンス	9,700	6,220.00	60,334,000	貸付株式数 2,700株
イチネンホールディングス	7,700	1,444.00	11,118,800	貸付株式数 1,900株
建設技術研究所	7,900	1,429.00	11,289,100	
アインホールディングス	7,800	8,310.00	64,818,000	貸付株式数 2,100株
スバル興業	1,100	6,540.00	7,194,000	
東京テアトル	5,600	1,447.00	8,103,200	
よみうりランド	1,600	4,765.00	7,624,000	
東京都競馬	4,400	4,735.00	20,834,000	貸付株式数 1,100株
常磐興産	6,500	1,862.00	12,103,000	
カナモト	8,300	3,565.00	29,589,500	
東京ドーム	22,400	996.00	22,310,400	貸付株式数 6,200株
DTS	6,200	4,475.00	27,745,000	
スクウェア・エニックス・HD	25,900	5,550.00	143,745,000	
シーイーシー	3,800	4,430.00	16,834,000	
カプコン	24,100	2,541.00	61,238,100	

西尾レントオール	5,700	3,640.00	20,748,000	
日本空港ビルデング	16,200	5,620.00	91,044,000	
トランス・コスモス	6,500	2,687.00	17,465,500	貸付株式数 1,300株
乃村工藝社	13,000	2,494.00	32,422,000	
ジャステック	7,000	1,184.00	8,288,000	貸付株式数 1,900株
S C S K	13,300	5,370.00	71,421,000	貸付株式数 3,500株
藤田観光	2,800	3,475.00	9,730,000	貸付株式数 700株
K N T - C Tホールディングス	4,300	1,638.00	7,043,400	
日本管財	6,100	2,299.00	14,023,900	
トーカイ	5,400	2,409.00	13,008,600	
セコム	57,300	8,270.00	473,871,000	
セントラル警備保障	3,500	4,720.00	16,520,000	貸付株式数 800株
アイネス	10,800	1,175.00	12,690,000	貸付株式数 1,000株
丹青社	12,400	1,520.00	18,848,000	
メイテック	6,300	5,060.00	31,878,000	
T K C	5,600	4,390.00	24,584,000	
富士ソフト	7,900	4,755.00	37,564,500	貸付株式数 2,100株
応用地質	6,900	1,495.00	10,315,500	
船井総研ホールディング	11,900	2,692.00	32,034,800	
N S D	9,300	2,545.00	23,668,500	貸付株式数 2,600株
オ オ バ	18,800	638.00	11,994,400	貸付株式数 3,800株
コナミホールディングス	22,700	5,530.00	125,531,000	貸付株式数 6,300株
学 究 社	5,500	1,852.00	10,186,000	
ベネッセホールディングス	19,500	4,160.00	81,120,000	
イオンディライト	6,800	3,975.00	27,030,000	
ニチイ学館	11,700	1,301.00	15,221,700	
ダイセキ	9,400	3,370.00	31,678,000	
日鉄住金物産	4,400	5,740.00	25,256,000	
元気寿司	3,500	3,505.00	12,267,500	
トラスコ中山	11,900	2,871.00	34,164,900	貸付株式数 3,200株
ヤマダ電機	185,700	557.00	103,434,900	貸付株式数 51,900株 (400株)
オートバックスセブン	21,100	2,022.00	42,664,200	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	9,500	1,684.00	15,998,000	
ニトリホールディングス	22,300	19,580.00	436,634,000	
吉野家ホールディングス	18,400	2,222.00	40,884,800	貸付株式数 5,100株
加藤産業	8,500	3,905.00	33,192,500	貸付株式数 1,500株
イノテック	7,200	1,419.00	10,216,800	

イエローハット	5,300	3,370.00	17,861,000	貸付株式数	300株
松屋フーズ	3,000	3,750.00	11,250,000		
J B C Cホールディングス	10,600	1,211.00	12,836,600		
サガミチェーン	10,900	1,429.00	15,576,100	貸付株式数	3,000株 (2,300株)
日 伝	5,300	2,156.00	11,426,800		
関西スーパーマーケット	5,700	1,220.00	6,954,000		
ミロク情報サービス	5,300	3,100.00	16,430,000		
北沢産業	33,100	269.00	8,903,900		
因幡電機産業	6,800	4,805.00	32,674,000	貸付株式数	1,900株
王将フードサービス	3,900	6,280.00	24,492,000		
ブレナス	6,200	1,870.00	11,594,000	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,600	2,302.00	10,589,200		
アークス	9,900	3,070.00	30,393,000	貸付株式数	2,700株
パローホールディングス	12,900	2,633.00	33,965,700		
バイテックホールディングス	3,800	2,413.00	9,169,400		
ミスミグループ本社	65,100	3,160.00	205,716,000		
ベ ル ク	2,700	5,980.00	16,146,000		
ファーストリテイリング	7,400	51,350.00	379,990,000		
ソフトバンクグループ	251,800	8,324.00	2,095,983,200		
スズケン	24,700	4,850.00	119,795,000	貸付株式数	6,900株
サンドラッグ	23,800	4,865.00	115,787,000		
サックスパーホールディング	6,700	1,008.00	6,753,600		
ジェコス	5,100	1,047.00	5,339,700		
ベルーナ	14,200	1,511.00	21,456,200		
合計			144,768,159,960		

(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せん。

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。

【ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成29年6月16日から平成30年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	44,343
コール・ローン	3,000	-
親投資信託受益証券	1,025,237	27,443,029
未収入金	-	200
流動資産合計	1,028,237	27,487,572
資産合計	1,028,237	27,487,572
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	7,000	206,883
未払受託者報酬	33	2,512
未払委託者報酬	1,012	37,048
その他未払費用	119	560
流動負債合計	8,164	247,003
負債合計	8,164	247,003
純資産の部		
元本等		
元本	1 1,000,000	1 22,987,038
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	20,073	4,253,531
（分配準備積立金）	20,073	23,230
元本等合計	1,020,073	27,240,569
純資産合計	1,020,073	27,240,569
負債純資産合計	1,028,237	27,487,572

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自	平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		28,237		330,608
営業収益合計		28,237		330,608
営業費用				
受託者報酬		33		2,536
委託者報酬		1,012		38,734
その他費用		119		743
営業費用合計		1,164		42,013
営業利益又は営業損失（ ）		27,073		372,621
経常利益又は経常損失（ ）		27,073		372,621
当期純利益又は当期純損失（ ）		27,073		372,621
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		20,073
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		4,812,962
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		4,812,962
分配金		1 7,000		1 206,883
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		20,073		4,253,531

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	21,987,038円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,000,000口	22,987,038口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,686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(19,387円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は27,073円(1万口当たり270.73円)であり、うち7,000円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(187,053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(4,253,288円)及び分配準備積立金(20,073円)より分配対象額は4,460,414円(1万口当たり1,940.40円)であり、うち206,883円(1万口当たり90円)を分配金額としております。</p>
------------	---	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期 平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15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	28,194	328,906
合計	28,194	328,906

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0201円 (10,201円)	1.1850円 (11,850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	ストックインデックス225・マザーファンド	9,823,184	27,443,029	
親投資信託受益証券 合計			27,443,029	
合計			27,443,029	

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、「ストックインデックス225・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。

「ストックインデックス225・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6月15日現在	平成30年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,389,088,942
コール・ローン	1,802,334,335	-
株式	2 134,490,260,640	152,731,980,480
派生商品評価勘定	-	32,827,900
未収入金	-	1,228,693,438
未収配当金	830,575,180	837,754,912
前払金	10,100,000	-
流動資産合計	137,133,270,155	156,220,345,672
資産合計	137,133,270,155	156,220,345,672
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	18,766,960	21,080
前受金	-	19,860,000
未払金	161,080	-
未払解約金	161,873,000	802,354,200
その他未払費用	-	103,114
流動負債合計	180,801,040	822,338,394
負債合計	180,801,040	822,338,394
純資産の部		
元本等		
元本	1 57,587,549,837	55,624,307,757
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	79,364,919,278	99,773,699,521
元本等合計	136,952,469,115	155,398,007,278
純資産合計	136,952,469,115	155,398,007,278
負債純資産合計	137,133,270,155	156,220,345,672

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16日 至 平成30年6月15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6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首	平成29年2月16日	平成29年6月16日
期首元本額	64,790,992,866円	57,587,549,837円
期中追加設定元本額	3,326,706,023円	13,183,390,233円
期中一部解約元本額	10,530,149,052円	15,146,632,313円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ストック インデックス ファ ンド225	31,228,069,897円	27,352,858,903円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・ストックインデックス ファンド225VA	993,463,971円	787,917,674円
大和 スtock インデックス 225 ファンド	10,548,764,962円	9,794,942,172円
D-I's 日経225イン デックス	102,636,159円	113,296,479円

	iFree 日経225イン デックス	58,676,083円	649,547,457円
	DC・ダイワ・ストックイン デックス225（確定拠出年 金専用ファンド）	5,071,828,805円	5,265,561,412円
	ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト12 Ver2 -	77,803,023円	- 円
	ダイワ・ノーロード 日経2 25ファンド	131,066,881円	243,350,081円
	ダイワファンドラップ 日経 225インデックス	1,388,712,132円	2,370,489,555円
	ダイワ日経225インデック ス（ダイワSMA専用）	431,098円	9,823,184円
	ダイワ・インデックスセレクト 日経225	7,986,096,826円	9,036,520,840円
計		57,587,549,837円	55,624,307,757円
2.	期末日における受益権の総数	57,587,549,837口	55,624,307,757口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 2,023,000,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 2,437,650,000円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	22,136,262,143	15,683,580,916
合計	22,136,262,143	15,683,580,916

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成28年9月21日から平成29年6月15日まで、及び平成29年9月20日から平成30年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成29年6月15日 現在				平成30年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	2,475,140,000	-	2,456,440,000	18,700,000	2,638,240,000	-	2,671,110,000	32,870,000
合計	2,475,140,000	-	2,456,440,000	18,700,000	2,638,240,000	-	2,671,110,000	32,870,000

(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6月15日現在	平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.3782円	2.7937円
(1万口当たり純資産額)	(23,782円)	(27,937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	
日本水産	248,000	545.00	135,160,000	
マルハニチロ	24,800	4,355.00	108,004,000	
国際石油開発帝石	99,200	1,174.50	116,510,400	
コムシスホールディングス	248,000	2,953.00	732,344,000	
大成建設	49,600	6,170.00	306,032,000	
大 林 組	248,000	1,142.00	283,216,000	

清水建設	248,000	1,109.00	275,032,000	
長谷工コーポレーション	49,600	1,609.00	79,806,400	
鹿島建設	248,000	899.00	222,952,000	
大和ハウス	248,000	3,963.00	982,824,000	
積水ハウス	248,000	1,927.50	478,020,000	
日 揮	248,000	2,181.00	540,888,000	
日清製粉G本社	248,000	2,396.00	594,208,000	
明治ホールディングス	49,600	9,630.00	477,648,000	
日本ハム	124,000	4,535.00	562,340,000	
ディー・エヌ・エー	74,400	2,134.00	158,769,600	
サッポロホールディングス	49,600	2,860.00	141,856,000	
アサヒグループホールディン	248,000	5,702.00	1,414,096,000	
麒麟HD	248,000	3,009.00	746,232,000	
宝ホールディングス	248,000	1,460.00	362,080,000	
双日	24,800	412.00	10,217,600	
キッコーマン	248,000	5,540.00	1,373,920,000	
味の素	248,000	2,157.50	535,060,000	
ニチレイ	124,000	2,902.00	359,848,000	
日本たばこ産業	248,000	3,165.00	784,920,000	
J. フロント リテイリング	124,000	1,819.00	225,556,000	
三越伊勢丹HD	248,000	1,425.00	353,400,000	
東洋紡	24,800	1,843.00	45,706,400	
ユニチカ	24,800	660.00	16,368,000	
日清紡ホールディングス	248,000	1,252.00	310,496,000	
東急不動産HD	248,000	801.00	198,648,000	
セブン&アイ・HLDGS	248,000	4,946.00	1,226,608,000	
帝 人	49,600	2,086.00	103,465,600	
東 レ	248,000	887.80	220,174,400	
ク ラ レ	248,000	1,653.00	409,944,000	
旭 化 成	248,000	1,446.00	358,608,000	
SUMCO	24,800	2,349.00	58,255,200	
王子ホールディングス	248,000	715.00	177,320,000	
日本製紙	24,800	1,867.00	46,301,600	
昭和電工	24,800	4,960.00	123,008,000	
住友化学	248,000	644.00	159,712,000	
日産化学	248,000	5,150.00	1,277,200,000	
東ソー	124,000	1,807.00	224,068,000	
トクヤマ	49,600	3,715.00	184,264,000	
デンカ	49,600	3,885.00	192,696,000	
信越化学	248,000	10,430.00	2,586,640,000	

協和発酵キリン	248,000	2,357.00	584,536,000
三井化学	49,600	3,045.00	151,032,000
三菱ケミカルHLDGS	124,000	970.20	120,304,800
宇部興産	24,800	3,085.00	76,508,000
日本化薬	248,000	1,198.00	297,104,000
電通	248,000	5,260.00	1,304,480,000
花王	248,000	8,647.00	2,144,456,000
武田薬品	248,000	4,365.00	1,082,520,000
アステラス製薬	1,240,000	1,768.00	2,192,320,000
大日本住友製薬	248,000	2,365.00	586,520,000
塩野義製薬	248,000	5,786.00	1,434,928,000
中外製薬	248,000	6,020.00	1,492,960,000
エーザイ	248,000	8,174.00	2,027,152,000
テルモ	496,000	6,720.00	3,333,120,000
第一三共	248,000	4,017.00	996,216,000
大塚ホールディングス	248,000	5,474.00	1,357,552,000
ヤフー	99,200	381.00	37,795,200
トレンドマイクロ	248,000	6,470.00	1,604,560,000
楽天	248,000	727.60	180,444,800
富士フイルムHLDGS	248,000	4,312.00	1,069,376,000
コニカミノルタ	248,000	1,062.00	263,376,000
資生堂	248,000	8,993.00	2,230,264,000
昭和シェル石油	248,000	1,607.00	398,536,000
JXTGホールディングス	248,000	764.00	189,472,000
横浜ゴム	124,000	2,412.00	299,088,000
ブリヂストン	248,000	4,424.00	1,097,152,000
旭硝子	49,600	4,535.00	224,936,000
日本板硝子	24,800	1,106.00	27,428,800
日本電気硝子	74,400	3,180.00	236,592,000
住友大阪セメント	248,000	530.00	131,440,000
太平洋セメント	24,800	4,055.00	100,564,000
東海カーボン	248,000	2,121.00	526,008,000
TOTO	124,000	5,630.00	698,120,000
日本碍子	248,000	2,012.00	498,976,000
新日鐵住金	24,800	2,255.00	55,924,000
神戸製鋼所	24,800	1,142.00	28,321,600
JFEホールディングス	24,800	2,281.00	56,568,800
日新製鋼	24,800	1,581.00	39,208,800
大平洋金属	24,800	3,990.00	98,952,000
日本製鋼所	49,600	3,070.00	152,272,000

日本軽金属HD	248,000	254.00	62,992,000	
三井金属	24,800	5,150.00	127,720,000	
東邦亜鉛	24,800	4,335.00	107,508,000	
三菱マテリアル	24,800	3,145.00	77,996,000	
住友鉱山	124,000	4,610.00	571,640,000	
DOWAホールディングス	49,600	3,645.00	180,792,000	
古河機金	24,800	1,635.00	40,548,000	
古河電工	24,800	4,040.00	100,192,000	
住友電工	248,000	1,692.50	419,740,000	
フジクラ	248,000	756.00	187,488,000	
東洋製罐グループHD	248,000	1,870.00	463,760,000	
リクルートホールディングス	744,000	3,182.00	2,367,408,000	
オークマ	49,600	6,020.00	298,592,000	
アマダホールディングス	248,000	1,132.00	280,736,000	
日本郵政	248,000	1,243.00	308,264,000	
小松製作所	248,000	3,393.00	841,464,000	
住友重機械	49,600	3,840.00	190,464,000	
日立建機	248,000	3,720.00	922,560,000	
クボタ	248,000	1,843.00	457,064,000	
荏原製作所	49,600	3,525.00	174,840,000	
千代田化工建	248,000	915.00	226,920,000	
ダイキン工業	248,000	13,295.00	3,297,160,000	
日本精工	248,000	1,190.00	295,120,000	
N T N	248,000	466.00	115,568,000	
ジェイテクト	248,000	1,577.00	391,096,000	
ミネベアミツミ	248,000	1,955.00	484,840,000	
日立	248,000	817.90	202,839,200	
三菱電機	248,000	1,521.00	377,208,000	
富士電機	248,000	857.00	212,536,000	
安川電機	248,000	4,195.00	1,040,360,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	248,000	506.00	125,488,000	
日本電気	24,800	3,125.00	77,500,000	
富士通	248,000	708.30	175,658,400	
沖電気	24,800	1,253.00	31,074,400	
セイコーエプソン	496,000	1,944.00	964,224,000	
パナソニック	248,000	1,566.00	388,368,000	
ソニー	248,000	5,445.00	1,350,360,000	
T D K	248,000	11,490.00	2,849,520,000	
アルプス電気	248,000	2,802.00	694,896,000	
パイオニア	248,000	161.00	39,928,000	

横河電機	248,000	2,008.00	497,984,000	
アドバンテスト	496,000	2,322.00	1,151,712,000	
デンソー	248,000	5,535.00	1,372,680,000	
カシオ	248,000	1,703.00	422,344,000	
ファナック	248,000	22,630.00	5,612,240,000	
京セラ	496,000	6,540.00	3,243,840,000	
太陽誘電	248,000	2,935.00	727,880,000	
日東電工	248,000	8,706.00	2,159,088,000	
三井E & S HD	24,800	1,479.00	36,679,200	
日立造船	49,600	531.00	26,337,600	
三菱重工業	24,800	4,156.00	103,068,800	
川崎重工業	24,800	3,415.00	84,692,000	
I H I	24,800	4,075.00	101,060,000	
コンコルディア・フィナンシャル	248,000	641.00	158,968,000	
日産自動車	248,000	1,091.00	270,568,000	
いすゞ自動車	124,000	1,526.00	189,224,000	
トヨタ自動車	248,000	7,562.00	1,875,376,000	
日野自動車	248,000	1,211.00	300,328,000	
三菱自動車工業	24,800	882.00	21,873,600	
マツダ	49,600	1,425.00	70,680,000	
本田技研	496,000	3,533.00	1,752,368,000	
スズキ	248,000	6,428.00	1,594,144,000	
S U B A R U	248,000	3,389.00	840,472,000	
ヤマハ発動機	248,000	3,020.00	748,960,000	
ニコン	248,000	1,802.00	446,896,000	
オリンパス	248,000	4,130.00	1,024,240,000	
S C R E E Nホールディングス	49,600	8,620.00	427,552,000	
キヤノン	372,000	3,752.00	1,395,744,000	
リコー	248,000	1,014.00	251,472,000	
シチズン時計	248,000	730.00	181,040,000	
凸版印刷	248,000	897.00	222,456,000	
大日本印刷	124,000	2,469.00	306,156,000	
ヤマハ	248,000	5,940.00	1,473,120,000	
伊藤忠	248,000	2,134.50	529,356,000	
丸紅	248,000	876.10	217,272,800	
豊田通商	248,000	3,940.00	977,120,000	
ユニー・ファミリーマートHD	248,000	12,050.00	2,988,400,000	
三井物産	248,000	1,920.00	476,160,000	
東京エレクトロン	248,000	19,080.00	4,731,840,000	
住友商事	248,000	1,910.00	473,680,000	

三菱商事	248,000	3,205.00	794,840,000	
高島屋	248,000	945.00	234,360,000	
丸井グループ	248,000	2,400.00	595,200,000	
クレディセゾン	248,000	1,774.00	439,952,000	
イオン	248,000	2,410.50	597,804,000	
新生銀行	24,800	1,759.00	43,623,200	
あおぞら銀行	24,800	4,395.00	108,996,000	
三菱UFJフィナンシャルG	248,000	658.70	163,357,600	
りそなホールディングス	24,800	653.10	16,196,880	
三井住友トラストHD	24,800	4,615.00	114,452,000	
三井住友フィナンシャルG	24,800	4,528.00	112,294,400	
千葉銀行	248,000	865.00	214,520,000	
ふくおかフィナンシャルG	248,000	604.00	149,792,000	
静岡銀行	248,000	1,097.00	272,056,000	
みずほフィナンシャルG	248,000	191.90	47,591,200	
大和証券G本社	248,000	648.90	160,927,200	
野村ホールディングス	248,000	566.20	140,417,600	
松井証券	248,000	1,056.00	261,888,000	
SOMPOホールディングス	62,000	4,613.00	286,006,000	
MS&AD	74,400	3,559.00	264,789,600	
SONY FH	49,600	2,130.00	105,648,000	
第一生命HLDGS	24,800	2,070.00	51,336,000	
東京海上HD	124,000	5,574.00	691,176,000	
T&Dホールディングス	49,600	1,757.50	87,172,000	
三井不動産	248,000	2,742.50	680,140,000	
三菱地所	248,000	2,043.00	506,664,000	
東京建物	124,000	1,544.00	191,456,000	
住友不動産	248,000	4,280.00	1,061,440,000	
東武鉄道	49,600	3,605.00	178,808,000	
東京急行	124,000	2,029.00	251,596,000	
小田急電鉄	124,000	2,475.00	306,900,000	
京王電鉄	49,600	5,460.00	270,816,000	
京成電鉄	124,000	3,955.00	490,420,000	
東日本旅客鉄道	24,800	11,080.00	274,784,000	
西日本旅客鉄道	24,800	8,202.00	203,409,600	
東海旅客鉄道	24,800	24,020.00	595,696,000	
日本通運	24,800	8,960.00	222,208,000	
ヤマトホールディングス	248,000	3,420.00	848,160,000	
日本郵船	24,800	2,340.00	58,032,000	
商船三井	24,800	2,940.00	72,912,000	

川崎汽船	24,800	2,271.00	56,320,800	
A N Aホールディングス	24,800	4,450.00	110,360,000	
三菱倉庫	124,000	2,380.00	295,120,000	
スカパー J S A T H D	24,800	519.00	12,871,200	
日本電信電話	49,600	5,236.00	259,705,600	
K D D I	1,488,000	3,038.00	4,520,544,000	
N T T ドコモ	24,800	2,858.50	70,890,800	
東京電力 H D	24,800	507.00	12,573,600	
中部電力	24,800	1,695.50	42,048,400	
関西電力	24,800	1,625.00	40,300,000	
東京瓦斯	49,600	2,994.50	148,527,200	
大阪瓦斯	49,600	2,353.50	116,733,600	
東 宝	24,800	3,770.00	93,496,000	
N T T データ	1,240,000	1,287.00	1,595,880,000	
東京ドーム	124,000	996.00	123,504,000	
セコム	248,000	8,270.00	2,050,960,000	
コナミホールディングス	248,000	5,530.00	1,371,440,000	
ファーストリテイリング	248,000	51,350.00	12,734,800,000	
ソフトバンクグループ	744,000	8,324.00	6,193,056,000	
合計			152,731,980,480	

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

武田薬品	50,000株	ファナック	30,000株
ファーストリテイリング	30,000株		

(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。

【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成29年6月16日から平成30年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	11,709
コール・ローン	4,399	1,066,157
親投資信託受益証券	3,629,732	1,345,084,332
流動資産合計	3,634,131	1,346,162,198
資産合計		
3,634,131		
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	20,798	11,660,513
未払受託者報酬	184	47,832
未払委託者報酬	3,397	921,817
その他未払費用	119	11,896
流動負債合計	24,498	12,642,058
負債合計		
24,498		
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,466,456	1 1,166,051,379
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	143,177	167,468,761
（分配準備積立金）	109,634	39,218,918
元本等合計	3,609,633	1,333,520,140
純資産合計		
3,609,633		
負債純資産合計		
3,634,131		

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自	平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		134,132		45,929,300
営業収益合計		134,132		45,929,300
営業費用				
支払利息		-		40
受託者報酬		184		48,198
委託者報酬		3,397		929,442
その他費用		119		12,079
営業費用合計		3,700		989,759
営業利益		130,432		44,939,541
経常利益		130,432		44,939,541
当期純利益		130,432		44,939,541
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		143,177
剰余金増加額又は欠損金減少額		33,543		134,046,556
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		33,543		134,046,556
分配金		1 20,798		1 11,660,513
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		143,177		167,468,761

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	3,466,456円
期中追加設定元本額	2,466,456円	1,162,584,923円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,466,456口	1,166,051,379口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(26,257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(104,175円)、投資信託約款に規定される収益調整金(33,543円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は163,975円(1万口当たり473.03円)であり、うち20,798円(1万口当たり60円)を分配金額としておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,412,452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(37,527,089円)、投資信託約款に規定される収益調整金(134,080,099円)及び分配準備積立金(109,634円)より分配対象額は179,129,274円(1万口当たり1,536.20円)であり、うち11,660,513円(1万口当たり100円)を分配金額としております。</p>
------------	---	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期
	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15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	134,063	45,926,505
合計	134,063	45,926,505

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期	第2期
平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期
自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0413円 (10,413円)	1.1436円 (11,436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	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	710,331,819	1,345,084,332	
親投資信託受益証券 合計			1,345,084,332	
合計			1,345,084,332	

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、「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」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。

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」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6月15日現在	平成30年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	247,092,378	170,771,012
金銭信託	-	6,720,404
コール・ローン	281,453,804	611,913,328
株式	20,378,537,455	34,565,920,178
投資信託受益証券	3,264,170	-
投資証券	533,236,179	839,789,867
派生商品評価勘定	236,094,459	7,182,208
未収入金	30,729,530	146,133
未収配当金	38,959,123	65,077,036
差入委託証拠金	299,545,331	340,786,487
流動資産合計	22,048,912,429	36,608,306,653
資産合計	22,048,912,429	36,608,306,653
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,026,063	470,094,721
未払金	222,202,305	-
未払解約金	-	47,051,000
その他未払費用	-	284,825
流動負債合計	237,228,368	517,430,546
負債合計	237,228,368	517,430,546
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,815,862,979	19,059,528,948
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,995,821,082	17,031,347,159
元本等合計	21,811,684,061	36,090,876,107
純資産合計	21,811,684,061	36,090,876,107
負債純資産合計	22,048,912,429	36,608,306,653

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16日 至 平成30年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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	(1)先物取引

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> <p>受取配当金</p> <p>原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首	平成29年2月16日	平成29年6月16日
期首元本額	9,273,210,145円	12,815,862,979円
期中追加設定元本額	4,084,600,324円	9,283,343,285円
期中一部解約元本額	541,947,490円	3,039,677,316円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国	9,834,242,824円	16,801,363,471円
株式インデックス（為替ヘッジあり）		

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 (為替ヘッジあり)	281,377,980円	1,101,496,652円
iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	- 円	155,311,204円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	763,932,916円	119,630,315円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	1,934,176,506円	171,395,487円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジあり)(ダイワ SMA専用)	2,132,753円	710,331,819円
計	12,815,862,979円	19,059,528,948円
2. 期末日における受益権の総数	12,815,862,979口	19,059,528,948口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15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、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年6月15日現在	平成30年6月15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	1,059,545,082	272,567,228
投資信託受益証券	150,186	-
投資証券	20,236,402	11,180,521
合計	1,079,931,670	261,386,707

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年1月11日から平成29年6月15日まで、及び平成30年1月11日から平成30年6月15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

	平成29年6月15日 現在	平成30年6月15日 現在
--	---------------	---------------

種類	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	823,854,261	-	824,228,794	374,533	1,222,292,941	-	1,229,236,115	6,943,174
合計	823,854,261	-	824,228,794	374,533	1,222,292,941	-	1,229,236,115	6,943,174

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種類	平成29年6月15日 現在				平成30年6月15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	21,473,393,188	-	21,252,682,795	220,710,393	34,673,053,201	-	35,142,908,888	469,855,687
アメリカ・ドル	13,913,649,806	-	13,766,209,360	147,440,446	23,050,591,704	-	23,440,320,304	389,728,600
イギリス・ポンド	1,546,093,238	-	1,514,292,192	31,801,046	2,469,653,005	-	2,501,812,782	32,159,777
イスラエル・シェケル	29,084,637	-	28,941,516	143,121	44,994,753	-	44,907,931	86,822
オーストラリア・ドル	614,063,439	-	621,155,445	7,092,006	899,183,431	-	901,270,942	2,087,511
カナダ・ドル	823,915,145	-	830,784,900	6,869,755	1,269,558,170	-	1,272,319,419	2,761,249

シンガポール・ドル	118,771,977	-	118,160,775	611,202	193,378,996	-	195,332,320	1,953,324
スイス・フラン	792,980,392	-	781,837,083	11,143,309	1,053,725,552	-	1,057,009,555	3,284,003
スウェーデン・クローナ	262,131,538	-	259,192,245	2,939,293	378,456,128	-	387,562,624	9,106,496
デンマーク・クローネ	161,552,633	-	159,636,744	1,915,889	254,151,958	-	254,941,877	789,919
ニュージーランド・ドル	21,884,231	-	22,157,749	273,518	33,350,565	-	33,565,970	215,405
ノルウェー・クローネ	55,788,592	-	55,253,470	535,122	100,547,790	-	102,626,776	2,078,986
ユーロ	2,844,474,484	-	2,809,499,904	34,974,580	4,439,687,813	-	4,458,056,820	18,369,007
香港・ドル	289,003,076	-	285,561,412	3,441,664	485,773,336	-	493,181,568	7,408,232
買建	159,096,030	-	159,079,500	16,530	-	-	-	-
アメリカ・ドル	159,096,030	-	159,079,500	16,530	-	-	-	-
合計	21,632,489,218	-	21,411,762,295	220,693,863	34,673,053,201	-	35,142,908,888	469,855,687

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.7019円	1.8936円

(1万口当たり純資産額)

(17,019円)

(18,936円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	1,100	114.890	126,379.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	800	215.560	172,448.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	1,659	61.220	101,563.980	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	550	177.230	97,476.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	6,200	35.260	218,612.000	
	ABBOTT LABORATORIES	15,097	62.960	950,507.120	
	ARCONIC INC	3,950	18.000	71,100.000	
	VERISK ANALYTICS INC	1,135	109.970	124,815.950	
	LAS VEGAS SANDS CORP	3,400	80.600	274,040.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	2,400	91.200	218,880.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	2,750	107.720	296,230.000	
	QORVO INC	1,179	83.650	98,623.350	
	AFLAC INC	7,068	45.680	322,866.240	
	DARDEN RESTAURANTS INC	1,248	92.190	115,053.120	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,000	46.550	46,550.000	
	ADOBE SYSTEMS INC	4,322	258.100	1,115,508.200	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,750	44.920	78,610.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	1,008	125.880	126,887.040	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	4,409	18.790	82,845.110	
	GARMIN LTD	750	61.940	46,455.000	
	AETNA INC	2,932	188.090	551,479.880	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,942	165.720	321,828.240	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	6,531	151.200	987,487.200	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	1,710	87.140	149,009.400		
WR BERKLEY CORP	600	75.280	45,168.000		
AUTOZONE INC	240	682.990	163,917.600		
DOLLAR TREE INC	1,911	88.340	168,817.740		
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	7,354	23.780	174,878.120		

PINNACLE WEST CAPITAL	900	75.410	67,869.000
CELANESE CORP-SERIES A	1,297	115.100	149,284.700
DR HORTON INC	3,306	43.080	142,422.480
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	450	64.260	28,917.000
DENTSPLY SIRONA INC	2,450	44.890	109,980.500
AUTODESK INC	1,913	138.410	264,778.330
MOODY'S CORP	1,490	175.930	262,135.700
DEVON ENERGY CORP	4,868	41.710	203,044.280
ALBEMARLE CORP	800	93.660	74,928.000
ATMOS ENERGY CORP	1,050	85.680	89,964.000
ALLIANT ENERGY CORP	2,200	39.620	87,164.000
CITIGROUP INC	22,328	66.160	1,477,220.480
AUTOMATIC DATA PROCESSING	3,687	139.820	515,516.340
AMERICAN ELECTRIC POWER	4,453	64.620	287,752.860
ALLEGHANY CORP	138	581.610	80,262.180
DOMINO'S PIZZA INC	300	273.650	82,095.000
HESS CORP	2,896	60.970	176,569.120
DAVITA INC	1,000	71.040	71,040.000
DANAHER CORP	5,431	102.640	557,437.840
FORTIVE CORP	3,044	80.130	243,915.720
AVNET INC	1,100	40.180	44,198.000
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5,314	74.520	395,999.280
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	1,200	23.470	28,164.000
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	1,701	21.730	36,962.730
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	4,584	45.240	207,380.160
BUNGE LTD	950	70.550	67,022.500
TE CONNECTIVITY LTD	3,246	99.310	322,360.260
APPLE INC	44,142	190.800	8,422,293.600
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,359	75.200	252,596.800
BOEING CO/THE	4,747	362.420	1,720,407.740
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,450	68.920	99,934.000
BECTON DICKINSON AND CO	2,283	232.820	531,528.060
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,500	29.800	44,700.000
LEIDOS HOLDINGS INC	1,400	60.750	85,050.000
CDK GLOBAL INC	1,100	65.860	72,446.000
NISOURCE INC	4,026	23.990	96,583.740
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,050	90.430	94,951.500

BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,606	56.800	488,820.800	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	35,473	47.820	1,696,318.860	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	11,020	192.500	2,121,350.000	
ANSYS INC	720	176.920	127,382.400	
H&R BLOCK INC	1,600	23.770	38,032.000	
BB&T CORP	6,955	52.440	364,720.200	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	14,041	53.630	753,018.830	
JPMORGAN CHASE & CO	29,728	108.030	3,211,515.840	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,275	123.660	281,326.500	
CIGNA CORP	2,045	175.330	358,549.850	
LKQ CORP	3,300	33.150	109,395.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	547	123.950	67,800.650	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,652	52.940	140,396.880	
CADENCE DESIGN SYS INC	2,650	44.940	119,091.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,200	147.650	177,180.000	
DOLLAR GENERAL CORP	2,198	96.330	211,733.340	
SERVICENOW INC	1,391	185.340	257,807.940	
CATERPILLAR INC	5,228	153.140	800,615.920	
CMS ENERGY CORP	2,500	43.620	109,050.000	
MOSAIC CO/THE	3,000	29.480	88,440.000	
DELTA AIR LINES INC	1,650	54.900	90,585.000	
CORNING INC	7,047	28.890	203,587.830	
CISCO SYSTEMS INC	42,366	44.690	1,893,336.540	
MORGAN STANLEY	11,515	51.310	590,834.650	
WABCO HOLDINGS INC	320	122.970	39,350.400	
MSCI INC	730	172.350	125,815.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	450	211.520	95,184.000	
MIDDLEBY CORP	400	106.170	42,468.000	
COTY INC-CL A	4,757	14.260	67,834.820	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	1,734	53.020	91,936.680	
BROADCOM INC	3,609	268.460	968,872.140	
UNITED THERAPEUTICS CORP	300	114.170	34,251.000	
ACUITY BRANDS INC	350	120.770	42,269.500	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	700	107.060	74,942.000	
ARAMARK	1,700	39.760	67,592.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,400	31.200	43,680.000	
DTE ENERGY COMPANY	1,350	97.050	131,017.500	
CENTENE CORP	1,550	123.500	191,425.000	

CBOE GLOBAL MARKETS INC	900	103.810	93,429.000
CITIZENS FINANCIAL GROUP	4,050	41.400	167,670.000
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,797	65.980	118,566.060
GARTNER INC	800	137.290	109,832.000
SPLUNK INC	1,100	119.500	131,450.000
AGCO CORP	500	61.690	30,845.000
DOMINION ENERGY INC	5,580	65.520	365,601.600
MONSTER BEVERAGE CORP	3,350	56.050	187,767.500
SMITH (A.O.) CORP	1,400	63.970	89,558.000
DEERE & CO	2,686	150.180	403,383.480
GLOBAL PAYMENTS INC	1,200	117.750	141,300.000
TIME WARNER INC	6,888	98.770	680,327.760
VMWARE INC-CLASS A	500	150.250	75,125.000
CHEMOURS CO/THE	1,400	49.780	69,692.000
NASDAQ INC	850	94.770	80,554.500
VAIL RESORTS INC	390	281.080	109,621.200
EAST WEST BANCORP INC	1,461	70.180	102,532.980
TARGA RESOURCES CORP	2,029	48.520	98,447.080
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	450	143.490	64,570.500
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	109.770	95,938.980
WESTLAKE CHEMICAL CORP	405	112.290	45,477.450
CONSOLIDATED EDISON INC	2,994	73.250	219,310.500
COGNEX CORP	1,400	45.780	64,092.000
TELEFLEX INC	485	284.160	137,817.600
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	806	129.650	104,497.900
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,225	83.030	101,711.750
IDEX CORP	700	143.670	100,569.000
COLGATE-PALMOLIVE CO	6,851	63.310	433,736.810
ROLLINS INC	700	52.270	36,589.000
AMETEK INC	1,982	74.840	148,332.880
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,155	49.800	107,319.000
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,000	41.810	41,810.000
XPO LOGISTICS INC	1,060	111.660	118,359.600
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,820	114.150	321,903.000
COSTCO WHOLESALE CORP	3,864	205.120	792,583.680
SCANA CORP	700	36.900	25,830.000
AFFILIATED MANAGERS GROUP	400	155.510	62,204.000

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	240	460.440	110,505.600	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	2,800	22.510	63,028.000	
UGI CORP	2,090	49.250	102,932.500	
CUMMINS INC	1,300	141.890	184,457.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	6,565	77.710	510,166.150	
SABRE CORP	1,600	26.410	42,256.000	
CDW CORP/DE	1,300	83.840	108,992.000	
SIGNATURE BANK	350	126.060	44,121.000	
COSTAR GROUP INC	382	409.700	156,505.400	
SVB FINANCIAL GROUP	450	316.490	142,420.500	
AMERCO	70	352.090	24,646.300	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	440	160.280	70,523.200	
MERCADOLIBRE INC	383	305.000	116,815.000	
HANESBRANDS INC	2,900	20.170	58,493.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	837	131.090	109,722.330	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,313	82.930	191,817.090	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	2,245	30.270	67,956.150	
IPG PHOTONICS CORP	250	241.160	60,290.000	
COPART INC	1,778	58.080	103,266.240	
DIAMONDBACK ENERGY INC	979	115.950	113,515.050	
SEATTLE GENETICS INC	1,000	65.490	65,490.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	650	366.270	238,075.500	
TRANSDIGM GROUP INC	500	344.170	172,085.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,500	31.530	78,825.000	
KINDER MORGAN INC	17,169	16.950	291,014.550	
HCA HEALTHCARE INC	2,689	106.010	285,060.890	
CABOT OIL & GAS CORP	4,608	23.610	108,794.880	
T-MOBILE US INC	2,600	59.530	154,778.000	
ZILLOW GROUP INC - C	700	65.090	45,563.000	
COCA-COLA CO/THE	35,429	43.580	1,543,995.820	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,600	39.500	63,200.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,250	76.770	95,962.500	
EATON VANCE CORP	1,250	54.890	68,612.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	2,200	33.150	72,930.000	
CSX CORP	7,081	65.890	466,567.090	
FLUOR CORP	1,290	48.890	63,068.100	

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	750	187.880	140,910.000	
EXPEDIA GROUP INC	1,150	123.580	142,117.000	
AUTOLIV INC	800	159.120	127,296.000	
AMAZON.COM INC	3,528	1,723.860	6,081,778.080	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	1,600	27.720	44,352.000	
FLOWSERVE CORP	900	41.540	37,386.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,945	151.560	294,784.200	
EXXON MOBIL CORP	36,852	81.890	3,017,810.280	
FLIR SYSTEMS INC	800	54.300	43,440.000	
AES CORP	4,000	13.180	52,720.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	650	197.760	128,544.000	
EVEREST RE GROUP LTD	350	226.000	79,100.000	
EOG RESOURCES INC	5,099	117.530	599,285.470	
EQT CORP	1,900	56.160	106,704.000	
AKamai TECHNOLOGIES INC	1,250	80.860	101,075.000	
ABIOMED INC	355	440.650	156,430.750	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,360	93.350	126,956.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	2,500	66.310	165,775.000	
FORD MOTOR CO	32,129	11.890	382,013.810	
MACY'S INC	2,200	37.560	82,632.000	
DISCOVERY INC - A	1,100	25.500	28,050.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,416	29.450	71,151.200	
DISCOVERY INC-C	2,149	24.150	51,898.350	
AERCAP HOLDINGS NV	1,824	54.550	99,499.200	
FORTINET INC	1,050	65.740	69,027.000	
MARKEL CORP	110	1,099.900	120,989.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	800	25.720	20,576.000	
NEXTERA ENERGY INC	4,050	158.820	643,221.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	11,450	17.580	201,291.000	
US BANCORP	14,281	50.930	727,331.330	
UNITED RENTALS INC	600	164.460	98,676.000	
F5 NETWORKS INC	550	181.640	99,902.000	
FASTENAL CO	2,907	52.790	153,460.530	
FISERV INC	3,500	76.430	267,505.000	
GENERAL ELECTRIC CO	73,308	13.640	999,921.120	
NEKTAR THERAPEUTICS	1,401	56.410	79,030.410	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,149	54.450	117,013.050	

GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	2,250	25.100	56,475.000	
GENERAL MOTORS CO	10,849	43.570	472,690.930	
TRIPADVISOR INC	700	57.730	40,411.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,061	195.820	403,585.020	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,114	233.650	727,586.100	
ALPHABET INC-CL A	2,561	1,160.110	2,971,041.710	
ALPHABET INC-CL C	2,656	1,152.120	3,060,030.720	
OWENS CORNING	800	65.200	52,160.000	
GENERAL MILLS INC	4,450	44.510	198,069.500	
FIRSTENERGY CORP	4,488	34.270	153,803.760	
GENUINE PARTS CO	1,200	94.070	112,884.000	
IHS MARKIT LTD	3,355	50.760	170,299.800	
FIFTH THIRD BANCORP	5,850	30.840	180,414.000	
HARRIS CORP	982	149.950	147,250.900	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	950	43.080	40,926.000	
HALLIBURTON CO	7,826	47.730	373,534.980	
HOME DEPOT INC	10,009	199.670	1,998,497.030	
ASSURANT INC	780	95.760	74,692.800	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	10,745	15.420	165,687.900	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	350	219.950	76,982.500	
HERSHEY CO/THE	1,358	92.140	125,126.120	
HARLEY-DAVIDSON INC	1,400	44.200	61,880.000	
HUMANA INC	1,288	304.430	392,105.840	
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,850	113.010	322,078.500	
HELMERICH & PAYNE	1,336	64.970	86,799.920	
HENRY SCHEIN INC	1,100	72.880	80,168.000	
HP INC	14,150	23.800	336,770.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	13,250	15.820	209,615.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	1,100	46.580	51,238.000	
HOLLYFRONTIER CORP	1,100	72.960	80,256.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	1,350	33.380	45,063.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	850	46.370	39,414.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,200	81.130	97,356.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	5,098	60.670	309,295.660	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	8,062	145.200	1,170,602.400	

INTERNATIONAL PAPER CO	3,050	56.840	173,362.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,500	56.800	85,200.000	
ZOETIS INC	4,100	88.150	361,415.000	
INGERSOLL-RAND PLC	2,044	91.910	187,864.040	
CHENIERE ENERGY INC	1,750	64.930	113,627.500	
ALLEGION PLC	1,110	81.790	90,786.900	
LEGGETT & PLATT INC	1,572	44.250	69,561.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	5,108	28.760	146,906.080	
WASTE CONNECTIONS INC	2,000	76.350	152,700.000	
JUNIPER NETWORKS INC	2,850	27.820	79,287.000	
JM SMUCKER CO/THE	900	103.750	93,375.000	
JOHNSON & JOHNSON	22,984	122.410	2,813,471.440	
ABBVIE INC	13,527	98.750	1,335,791.250	
HOLOGIC INC	3,042	40.230	122,379.660	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,141	102.040	320,507.640	
KROGER CO	7,160	26.160	187,305.600	
KLA-TENCOR CORP	1,520	113.130	171,957.600	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,288	310.590	710,629.920	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	730	205.530	150,036.900	
L BRANDS INC	1,950	35.990	70,180.500	
LOWE'S COS INC	7,106	99.160	704,630.960	
ELI LILLY & CO	8,698	86.350	751,072.300	
LAM RESEARCH CORP	1,477	181.170	267,588.090	
JONES LANG LASALLE INC	300	170.500	51,150.000	
LOEWS CORP	2,550	49.610	126,505.500	
LINCOLN NATIONAL CORP	1,800	68.050	122,490.000	
MCDONALD'S CORP	6,843	167.050	1,143,123.150	
3M CO	5,252	203.630	1,069,464.760	
FACEBOOK INC-A	20,818	196.810	4,097,190.580	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	1,717	87.910	150,941.470	
MANPOWERGROUP INC	650	93.070	60,495.500	
S&P GLOBAL INC	2,140	207.290	443,600.600	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	540	230.200	124,308.000	
CONCHO RESOURCES INC	1,200	127.250	152,700.000	
FIRST DATA CORP- CLASS A	3,850	21.610	83,198.500	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,900	36.560	69,464.000	
PHILLIPS 66	3,847	115.550	444,520.850	
TECHNIPFMC PLC	4,561	32.160	146,681.760	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	3,900	31.430	122,577.000
MATTEL INC	3,600	17.920	64,512.000
DXC TECHNOLOGY CO	2,429	84.450	205,129.050
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,029	105.860	108,929.940
MYLAN NV	4,888	39.510	193,124.880
METLIFE INC	7,519	46.770	351,663.630
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	3,734	21.760	81,251.840
ARISTA NETWORKS INC	423	281.120	118,913.760
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,349	46.590	62,849.910
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,435	113.900	163,446.500
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	210	592.700	124,467.000
BAKER HUGHES A GE CO	3,784	33.680	127,445.120
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,100	178.940	196,834.000
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	536	45.260	24,259.360
MERCK & CO. INC.	23,614	61.560	1,453,677.840
DOWDUPONT INC	20,358	68.380	1,392,080.040
MASCO CORP	2,200	38.420	84,524.000
M & T BANK CORP	1,323	174.710	231,141.330
MARSH & MCLENNAN COS	4,504	81.940	369,057.760
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	2,783	138.750	386,141.250
WORKDAY INC-CLASS A	1,200	128.200	153,840.000
SQUARE INC - A	2,791	63.880	178,289.080
TRANSUNION	2,015	71.280	143,629.200
VISTRA ENERGY CORP	2,500	24.010	60,025.000
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	1,100	65.850	72,435.000
WORLDPAY INC-CLASS A	2,876	84.310	242,475.560
NETAPP INC	2,300	77.500	178,250.000
NIKE INC -CL B	10,866	74.700	811,690.200
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,553	153.470	391,808.910
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,050	102.570	210,268.500
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,050	98.450	103,372.500
ALLY FINANCIAL INC	3,300	26.340	86,922.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,440	322.560	464,486.400
APTIV PLC	2,100	102.610	215,481.000
NEWMONT MINING CORP	4,150	39.160	162,514.000
MCKESSON CORP	1,769	150.000	265,350.000

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,387	61.430	146,633.410	
XYLEM INC	1,300	71.730	93,249.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	13,609	80.850	1,100,287.650	
NUCOR CORP	2,700	68.530	185,031.000	
WESTERN UNION CO	3,600	20.660	74,376.000	
GODADDY INC - CLASS A	1,300	73.550	95,615.000	
NEWELL BRANDS INC	4,058	26.390	107,090.620	
EVERGY INC	900	51.950	46,755.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	6,797	84.350	573,326.950	
LIBERTY BROADBAND-C	800	76.500	61,200.000	
PAYCHEX INC	2,675	69.340	185,484.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	700	281.890	197,323.000	
ALTRIA GROUP INC	16,446	56.700	932,488.200	
P G & E CORP	4,100	39.890	163,549.000	
PFIZER INC	51,016	36.160	1,844,738.560	
ALKERMES PLC	1,050	50.140	52,647.000	
XCEL ENERGY INC	4,050	42.870	173,623.500	
STRYKER CORP	2,818	168.750	475,537.500	
PARKER HANNIFIN CORP	1,239	171.910	212,996.490	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,353	191.450	259,031.850	
POLARIS INDUSTRIES INC	400	129.300	51,720.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	21,656	75.990	1,645,639.440	
EXELON CORP	7,854	41.070	322,563.780	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,750	120.160	210,280.000	
NVR INC	30	3,114.640	93,439.200	
CONOCOPHILLIPS	9,788	68.130	666,856.440	
PEPSICO INC	12,083	105.130	1,270,285.790	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3,550	98.750	350,562.500	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,350	79.780	107,703.000	
ACCENTURE PLC-CL A	5,165	162.760	840,655.400	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	600	56.650	33,990.000	
PENTAIR PLC	1,575	43.780	68,953.500	
QUALCOMM INC	12,536	59.460	745,390.560	
INVESCO LTD	3,700	27.210	100,677.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	500	133.500	66,750.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,300	56.260	129,398.000	
RAYTHEON COMPANY	2,567	202.680	520,279.560	
RED HAT INC	1,530	175.900	269,127.000	

REGENERON PHARMACEUTICALS	745	315.670	235,174.150	
REPUBLIC SERVICES INC	2,050	69.230	141,921.500	
BOOKING HOLDINGS INC	423	2,123.060	898,054.380	
ROSS STORES INC	3,035	84.500	256,457.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	844	120.780	101,938.320	
RESMED INC	1,383	106.760	147,649.080	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,200	110.940	133,128.000	
ROBERT HALF INTL INC	800	69.930	55,944.000	
RALPH LAUREN CORP	400	139.090	55,636.000	
ROCKWELL COLLINS INC	1,310	137.880	180,622.800	
REGIONS FINANCIAL CORP	9,250	18.620	172,235.000	
CHEVRON CORP	16,661	126.510	2,107,783.110	
EDISON INTERNATIONAL	3,103	60.200	186,800.600	
TESLA INC	1,194	357.720	427,117.680	
SYMANTEC CORP	5,400	21.360	115,344.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,218	142.290	173,309.220	
SYNOPSIS INC	1,100	90.870	99,957.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	1,610	295.610	475,932.100	
CBRE GROUP INC - A	2,800	48.300	135,240.000	
TWITTER INC	5,700	46.760	266,532.000	
SOUTHERN CO/THE	8,927	44.210	394,662.670	
SYSCO CORP	4,392	66.480	291,980.160	
TRAVELERS COS INC/THE	2,482	128.860	319,830.520	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,000	65.710	65,710.000	
STERICYCLE INC	500	64.210	32,105.000	
STEEL DYNAMICS INC	2,300	49.010	112,723.000	
SCHLUMBERGER LTD	11,132	68.330	760,649.560	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,050	53.820	56,511.000	
AT&T INC	53,563	32.520	1,741,868.760	
SOUTHWEST AIRLINES CO	900	51.940	46,746.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	3,627	25.890	93,903.030	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	761	401.200	305,313.200	
SEMPRA ENERGY	2,068	113.320	234,345.760	
TIFFANY & CO	1,086	135.670	147,337.620	
SEAGATE TECHNOLOGY	2,349	59.080	138,778.920	
TEXAS INSTRUMENTS INC	8,551	114.720	980,970.720	
SALESFORCE.COM INC	6,007	138.410	831,428.870	

WESTROCK CO	2,321	60.500	140,420.500	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	8,388	34.890	292,657.320	
ANDEAVOR	1,520	139.020	211,310.400	
UNION PACIFIC CORP	6,946	144.940	1,006,753.240	
MARATHON OIL CORP	6,100	21.120	128,832.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	4,175	75.190	313,918.250	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	6,543	126.940	830,568.420	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	6,033	117.190	707,007.270	
UNUM GROUP	1,900	38.830	73,777.000	
SPRINT CORP	4,114	5.460	22,462.440	
ANTERO RESOURCES CORP	1,000	19.760	19,760.000	
IQVIA HOLDINGS INC	1,432	103.160	147,725.120	
VOYA FINANCIAL INC	1,800	51.700	93,060.000	
AMEREN CORPORATION	1,850	56.370	104,284.500	
UNITEDHEALTH GROUP INC	8,266	255.330	2,110,557.780	
VERISIGN INC	750	141.220	105,915.000	
VALERO ENERGY CORP	3,882	116.820	453,495.240	
ULTA BEAUTY INC	480	246.600	118,368.000	
FNF GROUP	1,750	38.210	66,867.500	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	600	114.590	68,754.000	
ANTHEM INC	2,149	241.740	519,499.260	
WALT DISNEY CO/THE	12,829	108.750	1,395,153.750	
WELLS FARGO & CO	40,806	54.740	2,233,720.440	
WASTE MANAGEMENT INC	3,664	83.570	306,200.480	
WILLIAMS COS INC	7,790	27.210	211,965.900	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,050	74.320	78,036.000	
WHIRLPOOL CORP	500	155.470	77,735.000	
WALMART INC	13,054	83.790	1,093,794.660	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	900	88.280	79,452.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,550	114.880	178,064.000	
WYNN RESORTS LTD	717	176.250	126,371.250	
XEROX CORP	1,988	27.740	55,147.120	
WABTEC CORP	1,105	102.010	112,721.050	
TJX COMPANIES INC	5,603	94.560	529,819.680	
WATERS CORP	650	200.270	130,175.500	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	350	73.020	25,557.000	
ALLERGAN PLC	2,849	173.950	495,583.550	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	7,320	64.870	474,848.400	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,036	156.040	161,657.440	
WESTERN DIGITAL CORP	2,545	82.550	210,089.750	
WEC ENERGY GROUP INC	2,869	59.860	171,738.340	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	4,250	52.220	221,935.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	15,517	135.000	2,094,795.000	
PPL CORP	5,900	27.070	159,713.000	
PULTEGROUP INC	1,900	30.800	58,520.000	
PPG INDUSTRIES INC	2,012	103.960	209,167.520	
NORTHERN TRUST CORP	2,062	106.950	220,530.900	
NVIDIA CORP	5,059	266.910	1,350,297.690	
IAC/INTERACTIVECORP	600	162.260	97,356.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,175	141.840	592,182.000	
QURATE RETAIL INC	4,288	21.450	91,977.600	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,200	43.290	51,948.000	
TYSON FOODS INC-CL A	2,450	70.990	173,925.500	
NETFLIX INC	3,786	392.870	1,487,405.820	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,575	216.550	774,166.250	
TORCHMARK CORP	1,215	84.200	102,303.000	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,300	100.060	130,078.000	
TEXTRON INC	2,210	67.490	149,152.900	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	8,850	44.580	394,533.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	3,200	44.420	142,144.000	
NEWS CORP - CLASS A	2,900	16.020	46,458.000	
OGE ENERGY CORP	1,200	34.560	41,472.000	
OMNICOM GROUP	1,850	75.370	139,434.500	
ORACLE CORP	26,357	45.900	1,209,786.300	
MASTERCARD INC - A	8,011	199.310	1,596,672.410	
ONEOK INC	3,736	69.340	259,054.240	
CENTURYLINK INC	7,449	18.010	134,156.490	
ROPER TECHNOLOGIES INC	900	283.210	254,889.000	
YUM! BRANDS INC	2,524	83.380	210,451.120	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	800	121.840	97,472.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	400	226.470	90,588.000	

MOLSON COORS BREWING CO -B	1,775	66.720	118,428.000	
NOBLE ENERGY INC	3,750	34.570	129,637.500	
BANK OF AMERICA CORP	85,090	29.500	2,510,155.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,497	89.980	134,700.060	
NORDSTROM INC	800	49.870	39,896.000	
AMERICAN EXPRESS CO	6,584	99.760	656,819.840	
ANALOG DEVICES INC	3,336	101.700	339,271.200	
ADVANCED MICRO DEVICES	9,545	16.250	155,106.250	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	2,394	59.990	143,616.060	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	7,469	54.800	409,301.200	
ANADARKO PETROLEUM CORP	5,105	71.040	362,659.200	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,569	101.970	159,990.930	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,368	113.500	155,268.000	
NEWFIELD EXPLORATION CO	1,200	29.200	35,040.000	
AVERY DENNISON CORP	650	106.270	69,075.500	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,353	78.550	420,478.150	
EMERSON ELECTRIC CO	5,656	72.900	412,322.400	
AON PLC	2,296	140.210	321,922.160	
AMGEN INC	5,798	185.790	1,077,210.420	
TAPESTRY INC	2,550	45.530	116,101.500	
EATON CORP PLC	3,489	79.280	276,607.920	
CELGENE CORP	7,024	78.390	550,611.360	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,506	232.180	349,663.080	
APPLIED MATERIALS INC	9,164	49.690	455,359.160	
CIT GROUP INC	900	51.340	46,206.000	
CIMAREX ENERGY CO	800	86.550	69,240.000	
CME GROUP INC	3,041	168.860	513,503.260	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,389	42.160	142,880.240	
ECOLAB INC	2,364	145.400	343,725.600	
EQUIFAX INC	850	125.340	106,539.000	
GAP INC/THE	2,820	31.330	88,350.600	
GILEAD SCIENCES INC	11,064	71.150	787,203.600	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	1,476	120.630	178,049.880	
HORMEL FOODS CORP	2,200	36.110	79,442.000	
STATE STREET CORP	3,000	98.260	294,780.000	
SUNTRUST BANKS INC	3,922	68.890	270,186.580	
SCHWAB (CHARLES) CORP	10,506	56.610	594,744.660	
BAXTER INTERNATIONAL INC	4,541	75.410	342,436.810	

CAMPBELL SOUP CO	1,300	36.510	47,463.000	
CROWN HOLDINGS INC	800	44.970	35,976.000	
CARDINAL HEALTH INC	2,450	54.620	133,819.000	
FEDEX CORP	2,283	263.480	601,524.840	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,054	96.280	390,319.120	
FMC CORP	1,142	90.300	103,122.600	
FLEX LTD	4,500	14.010	63,045.000	
CERNER CORP	2,368	61.080	144,637.440	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	650	124.510	80,931.500	
CITRIX SYSTEMS INC	1,350	106.820	144,207.000	
INTEL CORP	40,199	55.540	2,232,652.460	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	2,800	23.580	66,024.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	2,850	53.080	151,278.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	2,500	148.890	372,225.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	15,300	7.380	112,914.000	
ILLUMINA INC	1,307	290.160	379,239.120	
SEALED AIR CORP	1,450	44.070	63,901.500	
INTUITIVE SURGICAL INC	927	495.520	459,347.040	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,236	99.940	123,525.840	
SNAP-ON INC	500	159.480	79,740.000	
CARMAX INC	1,990	73.220	145,707.800	
COMERICA INC	1,476	95.180	140,485.680	
INGREDION INC	530	113.130	59,958.900	
DUKE ENERGY CORP	6,064	73.460	445,461.440	
TARGET CORP	4,200	77.220	324,324.000	
DOVER CORP	1,200	76.060	91,272.000	
WW GRAINGER INC	400	317.390	126,956.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,116	65.350	72,930.600	
CINTAS CORP	763	191.560	146,160.280	
CA INC	2,200	37.060	81,532.000	
CONAGRA BRANDS INC	3,442	38.200	131,484.400	
CLOROX COMPANY	1,278	127.890	163,443.420	
ENTERGY CORP	1,600	76.710	122,736.000	
MICROSOFT CORP	62,672	101.420	6,356,194.240	
INCYTE CORP	1,447	73.640	106,557.080	
CVS HEALTH CORP	8,767	69.120	605,975.040	
MEDTRONIC PLC	11,631	86.570	1,006,895.670	

MICRON TECHNOLOGY INC	9,783	59.180	578,957.940	
BLACKROCK INC	1,057	523.360	553,191.520	
CENTERPOINT ENERGY INC	2,900	26.180	75,922.000	
HASBRO INC	1,000	91.610	91,610.000	
KELLOGG CO	2,620	66.600	174,492.000	
KEYCORP	8,773	20.530	180,109.690	
KANSAS CITY SOUTHERN	750	108.660	81,495.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	13,302	40.400	537,400.800	
KOHL'S CORP	1,650	73.280	120,912.000	
COOPER COS INC/THE	350	235.150	82,302.500	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	4,828	11.540	55,715.120	
APACHE CORP	3,673	42.890	157,534.970	
CHUBB LTD	3,901	130.100	507,520.100	
ARROW ELECTRONICS INC	1,000	79.100	79,100.000	
ALLSTATE CORP	2,910	92.800	270,048.000	
EBAY INC	9,053	39.000	353,067.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	9,673	85.610	828,105.530	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,283	107.930	138,474.190	
XILINX INC	2,200	70.430	154,946.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	4,832	82.240	397,383.680	
DISH NETWORK CORP-A	1,500	34.080	51,120.000	
ZIONS BANCORPORATION	1,900	55.450	105,355.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,044	156.370	319,620.280	
TOLL BROTHERS INC	1,200	39.050	46,860.000	
TRIMBLE INC	2,200	35.400	77,880.000	
LENNAR CORP-A	2,260	53.070	119,938.200	
LEAR CORP	600	202.690	121,614.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	2,300	64.840	149,132.000	
PROGRESSIVE CORP	5,067	61.890	313,596.630	
PRAXAIR INC	2,634	161.550	425,522.700	
PACCAR INC	2,780	63.760	177,252.800	
PVH CORP	550	160.240	88,132.000	
BIOGEN INC	1,899	305.680	580,486.320	
IDEXX LABORATORIES INC	742	226.080	167,751.360	
STARBUCKS CORP	12,484	57.020	711,837.680	
PERRIGO CO PLC	900	74.830	67,347.000	
EVERSOURCE ENERGY	2,400	53.990	129,576.000	
INTUIT INC	2,097	209.080	438,440.760	

	BORGWARNER INC	1,550	48.820	75,671.000	
	BEST BUY CO INC	2,300	73.320	168,636.000	
	BALL CORP	2,892	36.880	106,656.960	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	11,550	32.510	375,490.500	
	XL GROUP LTD	1,850	56.200	103,970.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	2,574	144.390	371,659.860	
	VULCAN MATERIALS CO	1,050	131.860	138,453.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,303	154.990	356,941.970	
	VF CORP	3,204	84.030	269,232.120	
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	2,841	55.120	156,595.920	
	VIACOM INC-CLASS B	3,071	28.910	88,782.610	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	480	214.110	102,772.800	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,003	123.310	123,679.930	
	CARNIVAL CORP	3,814	64.200	244,858.800	
	COMCAST CORP-CLASS A	40,632	33.820	1,374,174.240	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,100	37.000	77,700.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,200	62.740	138,028.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	5,600	8.850	49,560.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	11,000	7.400	81,400.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 209,775,825.420 (23,217,988,358)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	MERLIN ENTERTAINMENT	5,000	3.828	19,140.000	
	TUI AG-DI	4,802	17.645	84,731.290	
	BP PLC	173,930	5.855	1,018,360.150	
	UNILEVER PLC	10,199	40.335	411,376.660	
	BARCLAYS PLC	150,591	2.006	302,085.540	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	14,034	8.828	123,892.150	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	10,500	3.070	32,235.000	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	1,012	59.440	60,153.280	
	PRUDENTIAL PLC	22,506	18.645	419,624.370	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	34,542	2.636	91,052.710	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,758	38.230	67,208.340	
	BAE SYSTEMS PLC	29,337	6.508	190,925.190	
	AVIVA PLC	32,789	5.170	169,519.130	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	42,060	15.802	664,632.120	

MICRO FOCUS INTERNATIONAL	3,133	13.675	42,843.770
MELROSE INDUSTRIES PLC	40,000	2.405	96,200.000
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	2,900	5.642	16,361.800
AUTO TRADER GROUP PLC	13,352	4.221	56,358.790
DCC PLC	938	72.500	68,005.000
GVC HOLDINGS PLC	4,161	10.350	43,066.350
CONVATEC GROUP PLC	6,581	2.279	14,998.090
ROYAL MAIL PLC	10,076	5.052	50,903.950
NMC HEALTH PLC	975	36.840	35,919.000
RELX PLC	8,381	16.095	134,892.190
DIAGEO PLC	20,895	27.735	579,522.820
RIO TINTO PLC	10,582	44.020	465,819.640
STANDARD CHARTERED PLC	29,745	7.309	217,406.200
TESCO PLC	88,748	2.498	221,692.500
FRESNILLO PLC	2,400	12.060	28,944.000
SMITH & NEPHEW PLC	8,329	13.625	113,482.620
GLENCORE PLC	106,703	3.985	425,211.450
WOOD GROUP (JOHN) PLC	5,466	6.420	35,091.720
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,500	20.880	31,320.000
SMITHS GROUP PLC	4,080	18.010	73,480.800
BABCOCK INTL GROUP PLC	600	8.564	5,138.400
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	10,963	3.568	39,115.980
PEARSON PLC	8,271	8.832	73,049.470
SAINSBURY (J) PLC	17,631	3.147	55,484.750
NEXT PLC	1,159	61.940	71,788.460
TAYLOR WIMPEY PLC	32,236	1.881	60,635.910
WHITBREAD PLC	1,785	41.710	74,452.350
BUNZL PLC	3,159	23.500	74,236.500
VODAFONE GROUP PLC	222,753	1.880	418,909.290
CRODA INTERNATIONAL PLC	803	49.610	39,836.830
KINGFISHER PLC	17,229	3.145	54,185.200
WPP PLC	9,921	12.300	122,028.300
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	7.862	64,814.320
SEVERN TRENT PLC	1,300	18.800	24,440.000
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	5,855	61.500	360,082.500
ST JAMES'S PLACE PLC	4,883	12.405	60,573.610
SCHRODERS PLC	1,227	32.760	40,196.520
SSE PLC	8,282	13.600	112,635.200

WEIR GROUP PLC/THE	1,300	20.700	26,910.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	5.620	69,508.160	
ASTRAZENECA PLC	10,435	54.480	568,498.800	
FERGUSON PLC	1,989	61.280	121,885.920	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	49,681	2.732	135,728.490	
3I GROUP PLC	8,439	9.796	82,668.440	
SKY PLC	8,677	13.500	117,139.500	
ASHTED GROUP PLC	3,900	23.840	92,976.000	
SAGE GROUP PLC/THE	9,725	6.804	66,168.900	
NATIONAL GRID PLC	30,325	8.343	253,001.470	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	596,372	0.631	376,489.640	
RSA INSURANCE GROUP PLC	6,380	6.580	41,980.400	
IMPERIAL BRANDS PLC	8,223	26.080	214,455.840	
CENTRICA PLC	38,002	1.532	58,238.060	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	700	41.990	29,393.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	19,239	37.345	718,480.450	
BHP BILLITON PLC	17,820	17.488	311,636.160	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	2,960	27.510	81,429.600	
HSBC HOLDINGS PLC	166,922	7.346	1,226,209.010	
SHIRE PLC	8,223	40.695	334,634.980	
OLD MUTUAL PLC	41,479	2.269	94,115.850	
ANGLO AMERICAN PLC	10,745	17.934	192,700.830	
MONDI PLC	3,400	20.870	70,958.000	
WM MORRISON SUPERMARKETS	14,500	2.462	35,699.000	
CARNIVAL PLC	1,383	47.740	66,024.420	
EASYJET PLC	1,644	17.960	29,526.240	
COMPASS GROUP PLC	14,239	16.150	229,959.850	
PERSIMMON PLC	2,569	27.270	70,056.630	
BT GROUP PLC	65,624	2.141	140,500.980	
COCA-COLA HBC AG-DI	1,200	26.300	31,560.000	
BURBERRY GROUP PLC	3,300	21.630	71,379.000	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	1,372	49.440	67,831.680	
TRAVIS PERKINS PLC	1,700	14.315	24,335.500	
INTERTEK GROUP PLC	1,592	58.300	92,813.600	
ITV PLC	27,587	1.746	48,180.690	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	2,735	44.900	122,801.500	

	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	40,270	26.075	1,050,040.250	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	32,353	27.105	876,928.060	
	MEGGITT PLC	9,925	5.016	49,783.800	
	G4S PLC	11,320	2.795	31,639.400	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,570	19.080	29,955.600	
	INVESTEC PLC	4,600	5.710	26,266.000	
	ANTOFAGASTA PLC	3,460	10.650	36,849.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	20,457	3.532	72,254.120	
	EXPERIAN PLC	7,555	18.820	142,185.100	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 16,789,838.130 (2,462,397,661)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	AZRIELI GROUP LTD	530	184.400	97,732.000	
	FRUTAROM	418	352.200	147,219.600	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	5,000	4.000	20,000.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	11,096	17.800	197,508.800	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	444.400	133,320.000	
	BANK HAPOALIM BM	7,900	24.940	197,026.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	11,400	22.210	253,194.000	
	NICE LTD	800	397.000	317,600.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 1,363,600.400 (41,753,444)	
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	16,000	2.290	36,640.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	22,824	2.900	66,189.600	
	BHP BILLITON LIMITED	25,632	33.380	855,596.160	
	SOUTH32 LTD	36,213	3.810	137,971.530	
	ALUMINA LTD	12,100	2.740	33,154.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	7,728	33.720	260,588.160	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	10,500	4.650	48,825.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	3,600	10.170	36,612.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	22,399	25.950	581,254.050	
	WESTPAC BANKING CORP	26,820	27.300	732,186.000	
	SANTOS LTD	18,270	5.820	106,331.400	
	AUSNET SERVICES	28,500	1.555	44,317.500	

AUST AND NZ BANKING GROUP	24,874	26.200	651,698.800	
RIO TINTO LTD	3,949	84.620	334,164.380	
ORIGIN ENERGY LTD	12,050	9.700	116,885.000	
AMCOR LIMITED	10,996	13.790	151,634.840	
AURIZON HOLDINGS LTD	15,310	4.320	66,139.200	
OIL SEARCH LTD	15,418	8.380	129,202.840	
SEEK LTD	2,600	21.170	55,042.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	5,592	17.550	98,139.600	
NEWCREST MINING LTD	5,804	20.500	118,982.000	
INCITEC PIVOT LTD	20,400	3.450	70,380.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	14,500	67.450	978,025.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	2,000	30.320	60,640.000	
ORICA LTD	2,000	17.390	34,780.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	15,022	9.300	139,704.600	
CIMIC GROUP LTD	1,000	40.460	40,460.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	11,760	28.980	340,804.800	
COCA-COLA AMATIL LTD	2,600	8.870	23,062.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	17,352	4.590	79,645.680	
CROWN RESORTS LTD	3,000	13.250	39,750.000	
TELSTRA CORP LTD	35,114	2.900	101,830.600	
AMP LTD	24,935	3.630	90,514.050	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	3,200	21.650	69,280.000	
MACQUARIE GROUP LTD	2,542	113.450	288,389.900	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	4,035	29.600	119,436.000	
BANK OF QUEENSLAND LTD	3,000	9.910	29,730.000	
CSL LTD	3,729	186.790	696,539.910	
WESFARMERS LTD	9,567	47.000	449,649.000	
COCHLEAR LTD	444	189.800	84,271.200	
BLUESCOPE STEEL LTD	3,212	18.350	58,940.200	
SUNCORP GROUP LTD	9,938	13.870	137,840.060	
BORAL LTD	8,600	6.340	54,524.000	
ASX LTD	1,300	61.950	80,535.000	
COMPUTERSHARE LTD	3,700	17.870	66,119.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	17,518	7.940	139,092.920	
SONIC HEALTHCARE LTD	2,500	23.900	59,750.000	
CHALLENGER LTD	6,300	12.370	77,931.000	
AGL ENERGY LTD	7,039	21.440	150,916.160	
BRAMBLES LTD	11,337	9.030	102,373.110	

	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	800	62.560	50,048.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	900	57.780	52,002.000	
	REA GROUP LTD	608	90.110	54,786.880	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	621	51.430	31,938.030	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 9,515,243.160 (785,293,018)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	2,300	43.160	99,268.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	150	1,049.990	157,498.500	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	2,438	26.240	63,973.120	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	2,121	78.790	167,113.590	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,200	29.160	122,472.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,000	95.100	95,100.000	
	BCE INC	900	54.310	48,879.000	
	FRANCO-NEVADA CORP	1,600	91.290	146,064.000	
	SUNCOR ENERGY INC	12,912	52.140	673,231.680	
	METRO INC	1,600	43.940	70,304.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	3,300	63.770	210,441.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	9,900	75.980	752,202.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	3,800	115.200	437,760.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	15,100	76.200	1,150,620.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	1,700	33.350	56,695.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	12,000	99.850	1,198,200.000	
	TOURMALINE OIL CORP	1,300	24.120	31,356.000	
	VERMILION ENERGY INC	1,400	45.850	64,190.000	
	TRANSCANADA CORP	7,600	54.530	414,428.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	3,771	45.250	170,637.750	
	BOMBARDIER INC-B	19,200	4.890	93,888.000	
	BARRICK GOLD CORP	8,300	17.250	143,175.000	
	CAE INC	2,300	27.490	63,227.000	
	THOMSON REUTERS CORP	2,020	53.730	108,534.600	
	EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	24.560	44,208.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	600	86.130	51,678.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,000	66.020	66,020.000	
	LINAMAR CORP	600	63.730	38,238.000	

SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	1,100	14.810	16,291.000	
HYDRO ONE LTD	1,500	19.510	29,265.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	1,489	65.780	97,946.420	
WSP GLOBAL INC	1,200	73.830	88,596.000	
EMERA INC	1,200	40.230	48,276.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,000	31.430	31,430.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	3,000	61.940	185,820.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	1,800	60.960	109,728.000	
KINROSS GOLD CORP	10,534	4.970	52,353.980	
BANK OF MONTREAL	5,100	101.840	519,384.000	
POWER CORP OF CANADA	3,100	30.630	94,953.000	
METHANEX CORP	600	89.570	53,742.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	800	220.210	176,168.000	
NUTRIEN LTD	5,127	70.310	360,479.370	
CAMECO CORP	2,800	15.850	44,380.000	
TELUS CORP	300	46.230	13,869.000	
POWER FINANCIAL CORP	2,000	32.260	64,520.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	4,400	37.430	164,692.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	173.080	86,540.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	8,000	3.750	30,000.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	9,100	41.990	382,109.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	200	760.140	152,028.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,100	85.740	265,794.000	
WESTON (GEORGE) LTD	700	103.920	72,744.000	
BLACKBERRY LTD	6,400	16.000	102,400.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	5,200	54.720	284,544.000	
ENBRIDGE INC	14,300	42.690	610,467.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	6,600	55.030	363,198.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	16,000	24.870	397,920.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	2,000	35.070	70,140.000	
GOLDCORP INC	6,300	18.740	118,062.000	
ENCANA CORP	6,900	16.600	114,540.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,200	254.420	305,304.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,100	52.500	57,750.000	

	GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,400	37.850	52,990.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,400	109.430	700,352.000	
	CGI GROUP INC - CLASS A	1,900	81.400	154,660.000	
	HUSKY ENERGY INC	3,012	19.770	59,547.240	
	ONEX CORPORATION	700	92.730	64,911.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	3,900	27.660	107,874.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	2,500	33.940	84,850.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	1,900	59.610	113,259.000	
	IGM FINANCIAL INC	300	39.760	11,928.000	
	OPEN TEXT CORP	2,700	47.100	127,170.000	
	CI FINANCIAL CORP	2,000	24.960	49,920.000	
	SAPUTO INC	1,300	43.530	56,589.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	6,300	21.950	138,285.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	3,000	54.790	164,370.000	
	FORTIS INC	4,200	40.600	170,520.000	
	LUNDIN MINING CORP	6,600	8.350	55,110.000	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	2,500	9.780	24,450.000	
	CENOVUS ENERGY INC	8,000	12.380	99,040.000	
	DOLLARAMA INC	900	151.710	136,539.000	
	ATCO LTD -CLASS I	800	39.220	31,376.000	
	ALTAGAS LTD	800	26.150	20,920.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	2,000	21.080	42,160.000	
	KEYERA CORP	2,200	36.080	79,376.000	
	INTER PIPELINE LTD	4,800	24.560	117,888.000	
	ARC RESOURCES LTD	2,800	13.210	36,988.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 15,005,908.250 (1,265,448,242)	
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	10,800	26.950	291,060.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	14,500	27.610	400,345.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	7,100	11.190	79,449.000	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	7.240	125,252.000	
	UOL GROUP LTD	5,200	7.670	39,884.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	11.210	58,292.000	
	CAPITALAND LTD	19,000	3.390	64,410.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	27,000	0.965	26,055.000	

	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	12,000	2.630	31,560.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	900	33.150	29,835.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	25,800	12.130	312,954.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	45,000	1.220	54,900.000	
	VENTURE CORP LTD	3,200	20.110	64,352.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	65,400	3.190	208,626.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	14,100	3.450	48,645.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	4,000	2.800	11,200.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	9,000	0.320	2,880.000	
	SATS LTD	7,700	5.020	38,654.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	6,900	7.210	49,749.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	10,000	2.320	23,200.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	15,800	3.280	51,824.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 2,013,126.000 (165,478,957)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFY AG-REG	189	139.650	26,393.850	
	UBS GROUP AG-REG	32,402	15.760	510,655.520	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	50	657.000	32,850.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,754	60.840	106,713.360	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	5,877	211.300	1,241,810.100	
	PARGESA HOLDING SA-BR	389	90.300	35,126.700	
	SIKA AG-REG	1,140	146.300	166,782.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	75,600.000	75,600.000	
	ABB LTD-REG	14,676	23.370	342,978.120	
	SWISS RE AG	2,500	89.040	222,600.000	
	NESTLE SA-REG	25,666	74.620	1,915,196.920	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	163	743.000	121,109.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	300	222.000	66,600.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	21,508	15.645	336,492.660	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,198	61.280	134,693.440	
	SGS SA-REG	46	2,665.000	122,590.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	153	217.800	33,323.400	
	VIFOR PHARMA AG	369	162.850	60,091.650	

	TEMENOS AG - REG	508	154.300	78,384.400	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	267	498.100	132,992.700	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,163	300.400	349,365.200	
	BALOISE HOLDING AG - REG	320	149.700	47,904.000	
	CLARIANT AG-REG	1,568	24.790	38,870.720	
	NOVARTIS AG-REG	18,670	75.500	1,409,585.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	20	1,814.000	36,280.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	4,447	92.540	411,525.380	
	SWISSCOM AG-REG	276	446.000	123,096.000	
	GEBERIT AG-REG	334	441.800	147,561.200	
	GIVAUDAN-REG	68	2,260.000	153,680.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	111	768.500	85,303.500	
	SONOVA HOLDING AG-REG	563	174.000	97,962.000	
	LONZA GROUP AG-REG	542	275.000	149,050.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	90.500	40,725.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	3,801	52.220	198,488.220	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	231	352.500	81,427.500	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	495	153.650	76,056.750	
	SWISS PRIME SITE-REG	946	92.450	87,457.700	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	10	6,340.000	63,400.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 9,360,721.990 (1,038,291,283)	
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	700	274.000	191,800.000	
	ERICSSON LM-B SHS	26,383	68.180	1,798,792.940	
	VOLVO AB-B SHS	14,568	149.850	2,183,014.800	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	777	550.000	427,350.000	
	SKF AB-B SHARES	4,000	172.300	689,200.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,600	218.500	568,100.000	
	NORDEA BANK AB	26,529	85.620	2,271,412.980	
	SWEDISH MATCH AB	1,200	424.300	509,160.000	
	TELE2 AB-B SHS	3,258	116.050	378,090.900	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	13,100	83.060	1,088,086.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	12,526	98.880	1,238,570.880	
	SWEDBANK AB - A SHARES	9,075	189.800	1,722,435.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,039	140.060	1,266,002.340	

	SKANSKA AB-B SHS	3,709	160.250	594,367.250	
	SANDVIK AB	10,122	156.600	1,585,105.200	
	INVESTOR AB-B SHS	3,382	373.700	1,263,853.400	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	6,982	278.950	1,947,628.900	
	SECURITAS AB-B SHS	2,500	145.400	363,500.000	
	TELIA CO AB	24,107	42.940	1,035,154.580	
	ALFA LAVAL AB	2,000	224.500	449,000.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,500	253.600	634,000.000	
	ASSA ABLOY AB-B	8,401	191.050	1,605,011.050	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	285.600	270,748.800	
	LUNDIN PETROLEUM AB	1,900	283.800	539,220.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	5,050	215.400	1,087,770.000	
	BOLIDEN AB	3,171	305.550	968,899.050	
	EPIROC AB-A	6,982	83.850	585,440.700	
	EPIROC AB-B	2,500	80.550	201,375.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,400	87.980	211,152.000	
	KINNEVIK AB - B	1,500	317.100	475,650.000	
	HEXAGON AB-B SHS	2,400	514.800	1,235,520.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,300	184.800	240,240.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クロー ナ 29,625,651.770 (374,468,238)	
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	16,516	285.900	4,721,924.400	
	DANSKE BANK A/S	7,236	219.100	1,585,407.600	
	ISS A/S	1,320	222.400	293,568.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	30	9,275.000	278,250.000	
	H LUNDBECK A/S	500	459.400	229,700.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,857	414.200	769,169.400	
	CARLSBERG AS-B	806	739.600	596,117.600	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,802	328.100	591,236.200	
	COLOPLAST-B	1,052	638.600	671,807.200	
	DSV A/S	1,650	542.200	894,630.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,314	258.400	339,537.600	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	66	9,932.000	655,512.000	
	TRYG A/S	1,700	150.600	256,020.000	
	PANDORA A/S	750	488.600	366,450.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	750	652.200	489,150.000	

	GENMAB A/S	433	987.800	427,717.400	
	ORSTED A/S	1,533	374.900	574,721.700	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 13,740,919.100 (235,931,581)	
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	15,000	3.150	47,250.000	
	A2 MILK CO LTD	7,000	11.500	80,500.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	16,860	3.800	64,068.000	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,100	6.930	56,133.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	2,326	6.750	15,700.500	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	3,700	15.010	55,537.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	4,419	12.000	53,028.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 372,216.500 (28,634,615)	
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	13,050	53.100	692,955.000	
	DNB ASA	8,545	158.600	1,355,237.000	
	ORKLA ASA	7,000	73.160	512,120.000	
	TELENOR ASA	6,250	170.700	1,066,875.000	
	EQUINOR ASA	9,144	218.800	2,000,707.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,450	346.300	502,135.000	
	MARINE HARVEST	2,350	171.300	402,555.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	129.400	258,800.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,700	245.500	417,350.000	
	AKER BP ASA	1,306	304.600	397,807.600	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 7,606,541.800 (103,448,968)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	6,861	100.800	691,588.800	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	30.980	55,764.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	15,695	9.657	151,566.610	
	COMMERZBANK AG	9,689	9.297	90,078.630	
	VOLKSWAGEN AG	420	163.000	68,460.000	

VOLKSWAGEN AG-PREF	1,372	163.340	224,102.480	
MAN SE	100	93.150	9,315.000	
SIEMENS AG-REG	6,087	120.700	734,700.900	
E.ON SE	16,270	9.272	150,855.440	
UNIPER SE	1,380	25.580	35,300.400	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,921	86.270	251,994.670	
GEA GROUP AG	1,300	32.030	41,639.000	
OSRAM LICHT AG	645	51.900	33,475.500	
CONTINENTAL AG	900	220.500	198,450.000	
BASF SE	7,357	88.070	647,930.990	
K+S AG-REG	1,400	22.920	32,088.000	
ALLIANZ SE-REG	3,581	183.060	655,537.860	
THYSSENKRUPP AG	4,030	23.690	95,470.700	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,857	110.100	204,455.700	
RWE AG	5,309	20.060	106,498.540	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,700	23.840	40,528.000	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	560	85.000	47,600.000	
BRENTAG AG	1,436	50.440	72,431.840	
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,709	70.940	263,116.460	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	959	58.080	55,698.720	
HOCHTIEF AG	166	160.200	26,593.200	
SAP SE	7,808	104.300	814,374.400	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,214	185.600	225,318.400	
SCHAEFFLER AG	2,102	13.005	27,336.510	
ZALANDO SE	700	47.620	33,334.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	1,230	77.720	95,595.600	
KION GROUP AG	600	72.520	43,512.000	
WIRECARD AG	1,000	156.300	156,300.000	
COVESTRO AG	1,945	77.600	150,932.000	
INNOGY SE	1,500	36.800	55,200.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	305	133.000	40,565.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,265	63.120	79,846.800	
DELIVERY HERO AG	1,056	41.000	43,296.000	
METRO AG	1,500	11.400	17,100.000	
1&1 DRILLISCH AG	500	64.450	32,225.000	
LINDE AG - TENDER	1,627	209.200	340,368.400	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,500	35.885	53,827.500	

BEIERSDORF AG	815	99.360	80,978.400
FUCHS PETROLUB SE -PREF	700	46.400	32,480.000
MERCK KGAA	1,149	84.140	96,676.860
ADIDAS AG	1,592	198.750	316,410.000
PUMA SE	51	505.000	25,755.000
HENKEL AG & CO KGAA	650	98.350	63,927.500
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	28,991	13.850	401,525.350
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	1,766	88.480	156,255.680
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	8,010	63.190	506,151.900
QIAGEN N.V.	2,521	32.210	81,201.410
INFINEON TECHNOLOGIES AG	9,773	25.490	249,113.770
HANNOVER RUECK SE	644	111.900	72,063.600
DEUTSCHE POST AG-REG	7,548	30.360	229,157.280
DEUTSCHE BOERSE AG	1,897	116.400	220,810.800
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	1,560	24.250	37,830.000
LANXESS AG	600	72.260	43,356.000
MTU AERO ENGINES AG	400	166.600	66,640.000
AXEL SPRINGER SE	470	61.600	28,952.000
DEUTSCHE WOHNEN SE	3,285	41.270	135,571.950
SYMRISE AG	1,436	75.140	107,901.040
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	6,240	3.672	22,913.280
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	250	74.450	18,612.500
HUGO BOSS AG -ORD	811	80.020	64,896.220
RTL GROUP	350	65.550	22,942.500
VONOVIA SE	4,435	41.500	184,052.500
KONINKLIJKE PHILIPS NV	8,113	36.955	299,815.910
NN GROUP NV	3,100	36.890	114,359.000
ARCELORMITTAL	5,327	29.045	154,722.710
UNILEVER NV-CVA	12,732	46.660	594,075.120
HEINEKEN NV	2,215	88.020	194,964.300
RELX NV	8,200	18.265	149,773.000
AEGON NV	14,361	5.430	77,980.230
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	10,652	20.435	217,673.620
AKZO NOBEL	2,118	76.360	161,730.480
KONINKLIJKE DSM NV	1,938	90.180	174,768.840

WOLTERS KLUWER	2,376	48.160	114,428.160	
ING GROEP NV	30,853	12.722	392,511.860	
KONINKLIJKE KPN NV	36,000	2.411	86,796.000	
ASML HOLDING NV	3,231	185.600	599,673.600	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	3,453	23.020	79,488.060	
VOPAK	630	41.700	26,271.000	
RANDSTAD NV	750	53.460	40,095.000	
HEINEKEN HOLDING NV	1,100	85.000	93,500.000	
JCDECAUX SA	845	27.940	23,609.300	
TOTAL SA	19,922	52.860	1,053,076.920	
MICHELIN (CGDE)	1,428	110.500	157,794.000	
AIR LIQUIDE SA	3,438	112.100	385,399.800	
KERING	612	514.600	314,935.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,286	75.700	324,450.200	
BOUYGUES SA	1,892	38.870	73,542.040	
BNP PARIBAS	9,582	54.840	525,476.880	
PEUGEOT SA	4,573	21.320	97,496.360	
NATIXIS	7,674	6.390	49,036.860	
THALES SA	918	110.700	101,622.600	
DANONE	4,932	64.990	320,530.680	
CARREFOUR SA	5,156	15.530	80,072.680	
SUEZ	2,950	11.550	34,072.500	
VIVENDI	8,801	21.900	192,741.900	
L'OREAL	2,056	211.100	434,021.600	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	4,013	41.505	166,559.560	
LEGRAND SA	2,250	64.960	146,160.000	
CASINO GUICHARD PERRACHON	200	34.300	6,860.000	
PERNOD RICARD SA	1,808	144.900	261,979.200	
SOCIETE BIC SA	150	79.900	11,985.000	
EURAZEO SA	534	67.150	35,858.100	
REXEL SA	3,870	13.360	51,703.200	
SOCIETE GENERALE SA	6,129	37.460	229,592.340	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,311	302.550	699,193.050	
ACCOR SA	1,850	44.660	82,621.000	
CAPGEMINI SE	1,645	118.000	194,110.000	
VALEO SA	1,965	53.340	104,813.100	
PUBLICIS GROUPE	1,806	59.380	107,240.280	
BUREAU VERITAS SA	3,227	23.380	75,447.260	

EIFFAGE	750	96.360	72,270.000
SODEXO SA	669	85.720	57,346.680
IPSEN	276	137.100	37,839.600
INGENICO GROUP	499	76.480	38,163.520
AMUNDI SA	437	63.300	27,662.100
TELEPERFORMANCE	500	139.800	69,900.000
UBISOFT ENTERTAINMENT	500	99.740	49,870.000
FAURECIA	560	72.020	40,331.200
EUROFINS SCIENTIFIC	131	419.000	54,889.000
SEB SA	197	152.700	30,081.900
ESSILOR INTERNATIONAL	1,486	121.150	180,028.900
DASSAULT AVIATION SA	22	1,704.000	37,488.000
AXA SA	15,775	21.835	344,447.120
EDENRED	1,913	27.430	52,473.590
RENAULT SA	1,650	84.830	139,969.500
HERMES INTERNATIONAL	268	551.400	147,775.200
STMICROELECTRONICS NV	4,917	22.640	111,320.880
REMY COINTREAU	253	126.500	32,004.500
ATOS SE	946	123.250	116,594.500
DASSAULT SYSTEMES SA	1,149	123.950	142,418.550
WENDEL	201	125.400	25,205.400
ORANGE	17,404	14.640	254,794.560
ALSTOM	1,310	40.260	52,740.600
CNP ASSURANCES	1,349	19.770	26,669.730
SANOFI	9,252	67.330	622,937.160
VINCI SA	3,922	85.800	336,507.600
AIRBUS SE	4,704	104.560	491,850.240
VEOLIA ENVIRONNEMENT	3,863	19.510	75,367.130
CREDIT AGRICOLE SA	9,904	12.050	119,343.200
BIOMERIEUX	457	81.900	37,428.300
ENGIE	14,444	13.895	200,699.380
IMERYS SA	340	71.400	24,276.000
EDF	6,760	11.550	78,078.000
SES	4,402	15.605	68,693.210
SAFRAN SA	2,592	104.150	269,956.800
ILIAD SA	219	141.950	31,087.050
ARKEMA	838	103.900	87,068.200
ADP	350	194.600	68,110.000
EUTELSAT COMMUNICATIONS	1,400	17.700	24,780.000

SCOR SE	1,297	32.320	41,919.040
GETLINK	3,940	12.190	48,028.600
BOLLORE	7,300	4.168	30,426.400
UCB SA	1,110	66.400	73,704.000
KBC GROUP NV	2,211	66.940	148,004.340
COLRUYT SA	350	45.960	16,086.000
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	900	93.900	84,510.000
SOLVAY SA	873	113.400	98,998.200
UMICORE	1,600	51.000	81,600.000
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	6,089	84.030	511,658.670
AGEAS	1,654	44.170	73,057.180
PROXIMUS	2,269	21.770	49,396.130
TELENET GROUP HOLDING NV	462	41.440	19,145.280
PRYSMIAN SPA	1,440	25.700	37,008.000
ASSICURAZIONI GENERALI	11,733	14.735	172,885.750
MEDIOBANCA SPA	4,460	8.166	36,420.360
TENARIS SA	4,700	15.770	74,119.000
UNICREDIT SPA	17,637	14.520	256,089.240
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.684	74,216.050
TELECOM ITALIA-RSP	48,381	0.599	29,018.920
INTESA SANPAOLO-RSP	9,384	2.690	25,242.960
INTESA SANPAOLO	102,740	2.594	266,507.560
ATLANTIA SPA	3,527	25.160	88,739.320
POSTE ITALIANE SPA	2,900	7.820	22,678.000
MONCLER SPA	1,522	42.180	64,197.960
RECORDATI SPA	692	33.300	23,043.600
ENI SPA	21,146	15.814	334,402.840
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	4,483	6.925	31,044.770
PIRELLI & C SPA	5,651	7.400	41,817.400
LEONARDO SPA	2,500	8.998	22,495.000
ENEL SPA	71,157	4.873	346,748.060
SNAM SPA	24,300	3.613	87,795.900
LUXOTTICA GROUP SPA	1,307	55.560	72,616.920
TERNA SPA	9,900	4.656	46,094.400
EXOR NV	1,088	61.820	67,260.160
CNH INDUSTRIAL NV	7,353	10.125	74,449.120
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	10,787	18.238	196,733.300
FERRARI NV	1,130	127.200	143,736.000

TELEFONICA SA	40,569	7.549	306,255.380	
ENDESA SA	2,150	19.505	41,935.750	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	52,305	6.094	318,746.670	
IBERDROLA SA	46,886	6.660	312,260.760	
BANCO DE SABADELL SA	49,634	1.469	72,912.340	
BANKINTER SA	6,700	8.678	58,142.600	
REPSOL SA	10,213	17.220	175,867.860	
GRIFOLS SA	3,004	27.610	82,940.440	
BANCO SANTANDER SA	129,809	4.786	621,330.770	
AMADEUS IT GROUP SA	3,695	72.240	266,926.800	
GAS NATURAL SDG SA	2,100	21.790	45,759.000	
MAPFRE SA	8,005	2.583	20,676.910	
CAIXABANK S.A	30,487	3.857	117,588.350	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE- DI	4,900	8.190	40,131.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,195	36.800	80,776.000	
AENA SME SA	569	160.050	91,068.450	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	9,655	30.030	289,939.650	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	1,793	13.150	23,577.950	
ENAGAS SA	3,675	24.520	90,111.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,056	17.895	72,582.120	
FERROVIAL SA	3,876	18.430	71,434.680	
BANKIA SA	15,905	3.388	53,886.140	
UPM-KYMMENE OYJ	4,493	31.850	143,102.050	
NOKIA OYJ	43,904	5.238	229,969.150	
WARTSILA OYJ ABP	4,116	17.555	72,256.380	
STORA ENSO OYJ-R SHS	4,193	17.745	74,404.780	
METSO OYJ	1,108	31.000	34,348.000	
ELISA OYJ	1,300	39.260	51,038.000	
SAMPO OYJ-A SHS	3,832	42.260	161,940.320	
FORTUM OYJ	4,400	20.300	89,320.000	
KONE OYJ-B	2,660	44.570	118,556.200	
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,770	34.780	61,560.600	
NESTE OYJ	1,100	67.000	73,700.000	
ORION OYJ-CLASS B	1,763	24.420	43,052.460	
OMV AG	1,209	50.580	61,151.220	

	ERSTE GROUP BANK AG	2,750	36.290	99,797.500	
	VOESTALPINE AG	800	44.740	35,792.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,100	28.000	30,800.000	
	ANDRITZ AG	550	43.940	24,167.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1,995	34.720	69,266.400	
	AIB GROUP PLC	9,000	4.960	44,640.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	10,234	7.050	72,149.700	
	JERONIMO MARTINS	2,900	13.370	38,773.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	15,100	3.400	51,340.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	3,609	16.180	58,393.620	
	KERRY GROUP PLC-A	1,266	89.350	113,117.100	
	CRH PLC	6,500	32.620	212,030.000	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	889	98.000	87,122.000	
ユーロ 小計				ユーロ 34,372,176.920 (4,396,201,427)	
香港・ドル	株		香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	14,500	55.300	801,850.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	22,000	64.850	1,426,700.000	
	MTR CORP	7,500	43.600	327,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	12,000	123.200	1,478,400.000	
	SINO LAND CO	34,000	13.360	454,240.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	22,552	88.300	1,991,341.600	
	WHARF HOLDINGS LTD	8,000	25.500	204,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	3,500	83.000	290,500.000	
	CLP HOLDINGS LTD	13,500	81.250	1,096,875.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	10,514	44.050	463,141.700	
	HANG LUNG GROUP LTD	8,000	23.650	189,200.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	79,305	14.860	1,178,472.300	
	HANG SENG BANK LTD	6,400	197.900	1,266,560.000	
	WHEELOCK & CO LTD	6,000	57.650	345,900.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	58,000	11.860	687,880.000	
	WH GROUP LTD	91,500	6.960	636,840.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	10,000	255.600	2,556,000.000	
	MINTH GROUP LTD	6,000	37.150	222,900.000	
	LI & FUNG LTD	70,000	3.010	210,700.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	12,000	17.300	207,600.000	

ASM PACIFIC TECHNOLOGY	2,000	105.900	211,800.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	8,000	23.250	186,000.000	
NWS HOLDINGS LTD	15,000	14.580	218,700.000	
KERRY PROPERTIES LTD	7,500	42.850	321,375.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	8,600	32.000	275,200.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	6,000	44.750	268,500.000	
SJM HOLDINGS LTD	10,000	10.340	103,400.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	8,000	30.850	246,800.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	23,052	65.650	1,513,363.800	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	59.100	325,050.000	
PCCW LTD	60,000	4.490	269,400.000	
AIA GROUP LTD	107,600	70.150	7,548,140.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	14,000	59.450	832,300.000	
SANDS CHINA LTD	23,000	45.250	1,040,750.000	
SHANGRI-LA ASIA LTD	4,000	16.680	66,720.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	12,000	47.250	567,000.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	14,000	21.150	296,100.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	29,000	39.800	1,154,200.000	
WYNN MACAU LTD	16,800	28.300	475,440.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 31,956,339.400 (450,584,386)	
合計			34,565,920,178 [34,565,920,178]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,072	180,288.960	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	2,794	458,355.700	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,150	137,862.000	
		GGP INC	6,391	132,485.430	
		VORNADO REALTY TRUST	1,156	83,162.640	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,055	165,635.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	2,850	181,687.500	
		EQUINIX INC	706	280,098.440	
AMERICAN TOWER CORP	3,691	510,649.850			

	HOST HOTELS & RESORTS INC	6,228	132,843.240	
	KIMCO REALTY CORP	3,300	54,549.000	
	INVITATION HOMES INC	2,200	49,324.000	
	VENTAS INC	2,700	146,907.000	
	WEYERHAEUSER CO	5,858	218,269.080	
	AGNC INVESTMENT CORP	4,334	82,346.000	
	CROWN CASTLE INTL CORP	3,493	353,386.810	
	IRON MOUNTAIN INC	1,718	58,394.820	
	VEREIT INC	7,750	56,110.000	
	PROLOGIS INC	4,806	309,602.520	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	700	89,362.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	650	58,604.000	
	DUKE REALTY CORP	3,100	88,505.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	600	140,898.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	450	54,490.500	
	WELLTOWER INC	2,947	169,865.080	
	HCP INC	4,550	108,608.500	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1,000	44,280.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,100	106,557.000	
	MACERICH CO/THE	700	39,284.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	9,600	100,992.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,552	65,447.840	
	REALTY INCOME CORP	2,550	135,124.500	
	PUBLIC STORAGE	1,300	278,798.000	
	REGENCY CENTERS CORP	1,150	69,011.500	
	SL GREEN REALTY CORP	650	63,596.000	
	UDR INC	1,900	70,490.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,800	191,934.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,285	125,326.050	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 5,593,131.960 (619,047,845)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	4,808	45,853.890	
	SEGRO PLC	5,920	39,664.000	
	HAMMERSON PLC	10,958	58,669.130	
	BRITISH LAND CO PLC	6,300	43,596.000	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 187,783.020	

			(27,540,258)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	4,303	81,326.700	
	TRANSURBAN GROUP	17,162	204,571.040	
	SYDNEY AIRPORT	9,129	66,367.830	
	APA GROUP	7,500	72,075.000	
	SCENTRE GROUP	43,529	183,257.090	
	DEXUS	6,500	62,400.000	
	GPT GROUP	14,648	73,386.480	
	MIRVAC GROUP	31,638	70,552.740	
	STOCKLAND	14,300	59,345.000	
	GOODMAN GROUP	14,731	139,797.190	
	VICINITY CENTRES	19,523	51,540.720	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,064,619.790 (87,863,071)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,000	40,240.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,400	33,432.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 73,672.000 (6,212,760)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	28,000	45,920.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30,500	79,910.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	9,000	18,270.000	
	SUNTEC REIT	26,000	44,200.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 188,300.000 (15,478,260)	
ユーロ			ユーロ	
	UNIBAIL GROUP STAPLED	1,249	239,183.500	
	ICADE	406	33,373.200	
	GECINA SA	334	47,962.400	
	KLEPIERRE	2,394	79,911.720	
	COVIVIO	353	31,628.800	
ユーロ 小計			ユーロ 432,059.620	

			(55,260,425)
香港・ドル			香港・ドル
	LINK REIT	18,000	1,285,200.000
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52,000	387,400.000
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34,000	340,680.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 2,013,280.000 (28,387,248)
投資証券 合計			839,789,867 [839,789,867]
合計			839,789,867 [839,789,867]

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 600銘柄	97.4%	2.6%	67.2%
	投資証券 38銘柄			
イギリス・ポンド	株式 97銘柄	98.9%	1.1%	7.0%
	投資証券 4銘柄			
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 54銘柄	89.9%	10.1%	2.5%
	投資証券 11銘柄			
カナダ・ドル	株式 87銘柄	99.5%	0.5%	3.6%
	投資証券 2銘柄			
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	91.4%	8.6%	0.5%
	投資証券 4銘柄			
スイス・フラン	株式 38銘柄	100%	-%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	100%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	0.3%
ユーロ	株式 240銘柄	98.8%	1.2%	12.6%
	投資証券 5銘柄			
香港・ドル	株式 39銘柄	94.1%	5.9%	1.4%
	投資証券 3銘柄			

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成29年6月16日から平成30年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	28
コール・ローン	1,600	2,520
親投資信託受益証券	1,019,277	1,149,181
未収入金	-	100
流動資産合計	1,020,877	1,151,829
資産合計	1,020,877	1,151,829
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,000	22,000
未払受託者報酬	40	69
未払委託者報酬	1,341	2,270
その他未払費用	119	182
流動負債合計	11,500	24,521
負債合計	11,500	24,521
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,000	1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,377	127,308
（分配準備積立金）	9,377	127,308
元本等合計	1,009,377	1,127,308
純資産合計	1,009,377	1,127,308
負債純資産合計	1,020,877	1,151,829

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自	平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		20,877		144,904
営業収益合計		20,877		144,904
営業費用				
受託者報酬		40		131
委託者報酬		1,341		4,477
その他費用		119		365
営業費用合計		1,500		4,973
営業利益		19,377		139,931
経常利益		19,377		139,931
当期純利益		19,377		139,931
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		9,377
分配金		1 10,000		1 22,000
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,377		127,308

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,000,000口	1,000,000口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(10,450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(8,927円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は19,377円(1万口当たり193.77円)であり、うち10,000円(1万口当たり100円)を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(22,913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(117,018円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は149,308円(1万口当たり1,493.08円)であり、うち22,000円(1万口当たり220円)を分配金額としております。</p>
------------	---	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期 平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15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	20,873	144,558
合計	20,873	144,558

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0094円 (10,094円)	1.1273円 (11,273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	外国株式インデックスマザーファンド	463,548	1,149,181	
親投資信託受益証券 合計			1,149,181	
合計			1,149,181	

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、「外国株式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。

「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6月15日現在	平成30年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	346,819,039	541,972,936
金銭信託	-	1,966,937
コール・ローン	181,785,842	179,095,653
株式	82,741,832,920	99,506,241,962
投資証券	2,206,588,706	2,485,300,663
派生商品評価勘定	3,264,170	2,128,170
未収入金	129,368,958	434,216
未収配当金	162,927,811	190,403,446
差入委託証拠金	622,227,057	796,508,844
流動資産合計	86,394,814,503	103,704,052,827
資産合計	86,394,814,503	103,704,052,827
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,067,400	-
未払金	136,043,962	39,376,579
未払解約金	97,297,500	96,396,300
その他未払費用	-	4,294
流動負債合計	234,408,862	135,777,173
負債合計	234,408,862	135,777,173
純資産の部		
元本等		
元本	1 39,756,964,781	41,775,947,138
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	46,403,440,860	61,792,328,516
元本等合計	86,160,405,641	103,568,275,654
純資産合計	86,160,405,641	103,568,275,654
負債純資産合計	86,394,814,503	103,704,052,827

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16日 至 平成30年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。
	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29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首	平成29年2月16日	平成29年6月16日
期首元本額	39,780,118,238円	39,756,964,781円
期中追加設定元本額	2,170,967,595円	6,670,399,883円
期中一部解約元本額	2,194,121,052円	4,651,417,526円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックス V A	606,308,550円	516,700,593円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	23,451,318円	16,429,883円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	333,762,596円	229,429,617円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	37,203,103円	27,312,346円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,182,162,437円	734,645,896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)	303,803,310円	548,554,400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)	793,528,195円	1,334,039,645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)	124,987,382円	488,855,095円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,053,424円	1,010,873円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	172,046円	195,844円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	320,601,718円	534,842,007円
i F r e e 8資産バランス	186,813,694円	401,816,816円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	22,942,769,265円	25,684,078,835円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	510,329,880円	542,582,707円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	688,744,682円	767,007,247円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	533,956,961円	622,100,357円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,450,334,927円	1,470,100,006円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	6,551,178円	4,277,573円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	15,813,339円	12,987,127円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,481,056円	3,783,334円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	89,936円	76,716円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	178,417円	157,568円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	4,364,859円	668,959円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	43,745,808円	2,223,951円

ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,258,021,224円	323,855,425円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	453,064,837円	378,861,282円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	4,182,692,989円	3,419,943,699円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	201,888,567円	169,136,819円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	435,630,775円	591,527,140円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	27,021,370円	62,177,536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)	470,320円	463,548円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,932,845,155円	2,735,785,564円
ダイワライフスタイル25	21,531,379円	19,963,541円
ダイワライフスタイル50	72,166,279円	70,913,871円
ダイワライフスタイル75	57,423,805円	59,441,318円
計	39,756,964,781円	41,775,947,138円
2. 期末日における受益権の総数	39,756,964,781口	41,775,947,138口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年6月15日現在	平成30年6月15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	8,266,321,458	4,300,033,310
投資証券	162,493,720	97,623,755
合計	8,428,815,178	4,202,409,555

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成28年12月1日から平成29年6月15日まで、及び平成29年12月1日から平成30年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	平成29年6月15日 現在				平成30年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数								
先物取引								
買 建	1,199,140,852	-	1,202,405,022	3,264,170	1,542,242,790	-	1,543,155,900	913,110
合計	1,199,140,852	-	1,202,405,022	3,264,170	1,542,242,790	-	1,543,155,900	913,110

(注) 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	平成29年6月15日 現在				平成30年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち			(円)	うち		

		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	99,707,400	-	98,640,000	1,067,400	98,243,940	-	99,459,000	1,215,060
アメリカ・ドル	99,707,400	-	98,640,000	1,067,400	98,243,940	-	99,459,000	1,215,060
合計	99,707,400	-	98,640,000	1,067,400	98,243,940	-	99,459,000	1,215,060

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.1672円	2.4791円
(1万口当たり純資産額)	(21,672円)	(24,791円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	2,850	114.890	327,436.500	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,200	215.560	474,232.000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,800	61.220	293,856.000	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,450	177.230	256,983.500	
SYNCHRONY FINANCIAL	18,800	35.260	662,888.000	
ABBOTT LABORATORIES	42,766	62.960	2,692,547.360	
ARCONIC INC	10,333	18.000	185,994.000	
VERISK ANALYTICS INC	3,900	109.970	428,883.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	9,600	80.600	773,760.000	
AMPHENOL CORP-CL A	7,450	91.200	679,440.000	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,079	107.720	870,269.880	
QORVO INC	3,100	83.650	259,315.000	
AFLAC INC	19,000	45.680	867,920.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	2,950	92.190	271,960.500	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3,500	46.550	162,925.000	
ADOBE SYSTEMS INC	11,950	258.100	3,084,295.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,500	44.920	247,060.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,600	125.880	327,288.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	8,000	18.790	150,320.000	
GARMIN LTD	2,900	61.940	179,626.000	
AETNA INC	7,879	188.090	1,481,961.110	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,350	165.720	886,602.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	18,400	151.200	2,782,080.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,171	87.140	363,460.940	
WR BERKLEY CORP	2,300	75.280	173,144.000	
AUTOZONE INC	660	682.990	450,773.400	
DOLLAR TREE INC	5,721	88.340	505,393.140	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	22,500	23.780	535,050.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,650	75.410	199,836.500	
CELANESE CORP-SERIES A	3,300	115.100	379,830.000	
DR HORTON INC	8,716	43.080	375,485.280	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,450	64.260	157,437.000	
DENTSPLY SIRONA INC	5,450	44.890	244,650.500	
AUTODESK INC	5,500	138.410	761,255.000	
MOODY'S CORP	4,250	175.930	747,702.500	

DEVON ENERGY CORP	12,450	41.710	519,289.500	
ALBEMARLE CORP	2,800	93.660	262,248.000	
ATMOS ENERGY CORP	2,500	85.680	214,200.000	
ALLIANT ENERGY CORP	5,750	39.620	227,815.000	
CITIGROUP INC	64,473	66.160	4,265,533.680	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,850	139.820	1,517,047.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	12,100	64.620	781,902.000	
ALLEGHANY CORP	370	581.610	215,195.700	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	273.650	301,015.000	
HESS CORP	7,200	60.970	438,984.000	
DAVITA INC	3,500	71.040	248,640.000	
DANAHER CORP	15,400	102.640	1,580,656.000	
FORTIVE CORP	7,500	80.130	600,975.000	
AVNET INC	2,800	40.180	112,504.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	14,150	74.520	1,054,458.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,900	23.470	115,003.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,728	21.730	102,739.440	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13,600	45.240	615,264.000	
BUNGE LTD	3,600	70.550	253,980.000	
TE CONNECTIVITY LTD	8,525	99.310	846,617.750	
APPLE INC	125,000	190.800	23,850,000.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,000	75.200	676,800.000	
BOEING CO/THE	13,790	362.420	4,997,771.800	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,915	68.920	269,821.800	
BECTON DICKINSON AND CO	6,539	232.820	1,522,409.980	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,000	29.800	178,800.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,550	60.750	215,662.500	
CDK GLOBAL INC	2,900	65.860	190,994.000	
NISOURCE INC	8,500	23.990	203,915.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,350	90.430	302,940.500	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	25,171	56.800	1,429,712.800	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	100,454	47.820	4,803,710.280	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	30,950	192.500	5,957,875.000	
ANSYS INC	2,100	176.920	371,532.000	
H&R BLOCK INC	5,100	23.770	121,227.000	
BB&T CORP	19,250	52.440	1,009,470.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	40,100	53.630	2,150,563.000	

JPMORGAN CHASE & CO	84,520	108.030	9,130,695.600	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,000	123.660	741,960.000	
CIGNA CORP	6,050	175.330	1,060,746.500	
LKQ CORP	7,800	33.150	258,570.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,000	123.950	123,950.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,462	52.940	342,098.280	
CADENCE DESIGN SYS INC	6,750	44.940	303,345.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,610	147.650	533,016.500	
DOLLAR GENERAL CORP	6,650	96.330	640,594.500	
SERVICENOW INC	4,250	185.340	787,695.000	
CATERPILLAR INC	14,450	153.140	2,212,873.000	
CMS ENERGY CORP	6,750	43.620	294,435.000	
MOSAIC CO/THE	9,050	29.480	266,794.000	
DELTA AIR LINES INC	4,350	54.900	238,815.000	
CORNING INC	21,300	28.890	615,357.000	
CISCO SYSTEMS INC	120,400	44.690	5,380,676.000	
MORGAN STANLEY	33,000	51.310	1,693,230.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,250	122.970	153,712.500	
MSCI INC	2,150	172.350	370,552.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	900	211.520	190,368.000	
MIDDLEBY CORP	1,300	106.170	138,021.000	
COTY INC-CL A	11,839	14.260	168,824.140	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	5,200	53.020	275,704.000	
BROADCOM INC	10,002	268.460	2,685,136.920	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,050	114.170	119,878.500	
ACUITY BRANDS INC	1,000	120.770	120,770.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,180	107.060	233,390.800	
ARAMARK	5,850	39.760	232,596.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5,350	31.200	166,920.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,350	97.050	422,167.500	
CENTENE CORP	5,050	123.500	623,675.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,800	103.810	290,668.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,150	41.400	503,010.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,300	65.980	283,714.000	
GARTNER INC	2,200	137.290	302,038.000	
SPLUNK INC	3,350	119.500	400,325.000	
AGCO CORP	1,450	61.690	89,450.500	
DOMINION ENERGY INC	15,750	65.520	1,031,940.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	10,550	56.050	591,327.500	

SMITH (A.O.) CORP	3,650	63.970	233,490.500	
DEERE & CO	7,500	150.180	1,126,350.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,800	117.750	447,450.000	
TIME WARNER INC	19,033	98.770	1,879,889.410	
VMWARE INC-CLASS A	1,800	150.250	270,450.000	
CHEMOURS CO/THE	4,550	49.780	226,499.000	
NASDAQ INC	2,900	94.770	274,833.000	
VAIL RESORTS INC	950	281.080	267,026.000	
EAST WEST BANCORP INC	3,650	70.180	256,157.000	
TARGA RESOURCES CORP	5,350	48.520	259,582.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,650	143.490	236,758.500	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,800	109.770	197,586.000	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,050	112.290	117,904.500	
CONSOLIDATED EDISON INC	7,550	73.250	553,037.500	
COGNEX CORP	4,150	45.780	189,987.000	
TELEFLEX INC	1,130	284.160	321,100.800	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,100	129.650	272,265.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,750	83.030	228,332.500	
IDEX CORP	1,950	143.670	280,156.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	20,450	63.310	1,294,689.500	
ROLLINS INC	2,550	52.270	133,288.500	
AMETEK INC	5,775	74.840	432,201.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,100	49.800	303,780.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,200	41.810	133,792.000	
XPO LOGISTICS INC	3,100	111.660	346,146.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,250	114.150	941,737.500	
COSTCO WHOLESALE CORP	10,650	205.120	2,184,528.000	
SCANA CORP	3,100	36.900	114,390.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,350	155.510	209,938.500	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	600	460.440	276,264.000	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	7,600	22.510	171,076.000	
UGI CORP	4,200	49.250	206,850.000	
CUMMINS INC	3,850	141.890	546,276.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	17,550	77.710	1,363,810.500	
SABRE CORP	5,100	26.410	134,691.000	
CDW CORP/DE	3,750	83.840	314,400.000	

SIGNATURE BANK	1,300	126.060	163,878.000	
COSTAR GROUP INC	900	409.700	368,730.000	
SVB FINANCIAL GROUP	1,300	316.490	411,437.000	
AMERCO	170	352.090	59,855.300	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,500	160.280	240,420.000	
MERCADOLIBRE INC	1,000	305.000	305,000.000	
HANESBRANDS INC	8,500	20.170	171,445.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,950	131.090	255,625.500	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7,066	82.930	585,983.380	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,600	30.270	139,242.000	
IPG PHOTONICS CORP	900	241.160	217,044.000	
COPART INC	5,400	58.080	313,632.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,450	115.950	284,077.500	
SEATTLE GENETICS INC	2,600	65.490	170,274.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,870	366.270	684,924.900	
TRANSDIGM GROUP INC	1,280	344.170	440,537.600	
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,000	31.530	283,770.000	
KINDER MORGAN INC	48,781	16.950	826,837.950	
HCA HEALTHCARE INC	6,800	106.010	720,868.000	
CABOT OIL & GAS CORP	11,150	23.610	263,251.500	
T-MOBILE US INC	8,550	59.530	508,981.500	
ZILLOW GROUP INC - C	2,500	65.090	162,725.000	
COCA-COLA CO/THE	98,600	43.580	4,296,988.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,300	39.500	209,350.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,250	76.770	326,272.500	
EATON VANCE CORP	2,750	54.890	150,947.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	7,950	33.150	263,542.500	
CSX CORP	21,400	65.890	1,410,046.000	
FLUOR CORP	3,300	48.890	161,337.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,450	187.880	460,306.000	
EXPEDIA GROUP INC	3,025	123.580	373,829.500	
AUTOLIV INC	2,150	159.120	342,108.000	
AMAZON.COM INC	10,070	1,723.860	17,359,270.200	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	5,550	27.720	153,846.000	
FLOWERVE CORP	3,200	41.540	132,928.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,200	151.560	788,112.000	
EXXON MOBIL CORP	103,105	81.890	8,443,268.450	

FLIR SYSTEMS INC	3,400	54.300	184,620.000	
AES CORP	15,600	13.180	205,608.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	1,900	197.760	375,744.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,020	226.000	230,520.000	
EOG RESOURCES INC	14,150	117.530	1,663,049.500	
EQT CORP	6,250	56.160	351,000.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,150	80.860	335,569.000	
ABIOMED INC	1,080	440.650	475,902.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,000	93.350	373,400.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,990	66.310	529,816.900	
FORD MOTOR CO	89,723	11.890	1,066,806.470	
MACY'S INC	7,498	37.560	281,624.880	
DISCOVERY INC - A	3,440	25.500	87,720.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	29.450	143,922.150	
DISCOVERY INC-C	7,289	24.150	176,029.350	
AERCAP HOLDINGS NV	3,400	54.550	185,470.000	
FORTINET INC	3,500	65.740	230,090.000	
MARKEL CORP	340	1,099.900	373,966.000	
NEXTERA ENERGY INC	11,450	158.820	1,818,489.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	34,108	17.580	599,618.640	
US BANCORP	40,350	50.930	2,055,025.500	
UNITED RENTALS INC	2,150	164.460	353,589.000	
F5 NETWORKS INC	1,600	181.640	290,624.000	
FASTENAL CO	7,200	52.790	380,088.000	
FISERV INC	10,250	76.430	783,407.500	
GENERAL ELECTRIC CO	211,650	13.640	2,886,906.000	
NEKTAR THERAPEUTICS	4,100	56.410	231,281.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	5,200	54.450	283,140.000	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	6,050	25.100	151,855.000	
GENERAL MOTORS CO	31,300	43.570	1,363,741.000	
TRIPADVISOR INC	2,750	57.730	158,757.500	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,200	195.820	1,214,084.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,740	233.650	2,042,101.000	
ALPHABET INC-CL A	7,260	1,160.110	8,422,398.600	
ALPHABET INC-CL C	7,687	1,152.120	8,856,346.440	
OWENS CORNING	2,750	65.200	179,300.000	
GENERAL MILLS INC	14,050	44.510	625,365.500	
FIRSTENERGY CORP	11,068	34.270	379,300.360	

GENUINE PARTS CO	3,500	94.070	329,245.000	
IHS MARKIT LTD	9,634	50.760	489,021.840	
FIFTH THIRD BANCORP	17,600	30.840	542,784.000	
HARRIS CORP	2,850	149.950	427,357.500	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	43.080	129,240.000	
HALLIBURTON CO	21,050	47.730	1,004,716.500	
HOME DEPOT INC	28,450	199.670	5,680,611.500	
ASSURANT INC	1,250	95.760	119,700.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	27,200	15.420	419,424.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,090	219.950	239,745.500	
HERSHEY CO/THE	3,500	92.140	322,490.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,000	44.200	176,800.000	
HUMANA INC	3,500	304.430	1,065,505.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,200	113.010	926,682.000	
HELMERICH & PAYNE	2,600	64.970	168,922.000	
HENRY SCHEIN INC	3,800	72.880	276,944.000	
HP INC	40,200	23.800	956,760.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	39,400	15.820	623,308.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,300	46.580	200,294.000	
HOLLYFRONTIER CORP	4,300	72.960	313,728.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	4,900	33.380	163,562.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,100	46.370	97,377.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,100	81.130	251,503.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	14,903	60.670	904,165.010	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	22,350	145.200	3,245,220.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	9,450	56.840	537,138.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,600	56.800	204,480.000	
ZOETIS INC	11,800	88.150	1,040,170.000	
INGERSOLL-RAND PLC	6,279	91.910	577,102.890	
CHENIERE ENERGY INC	5,050	64.930	327,896.500	
ALLEGION PLC	2,450	81.790	200,385.500	
LEGGETT & PLATT INC	3,100	44.250	137,175.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	13,673	28.760	393,235.480	
WASTE CONNECTIONS INC	6,457	76.350	492,991.950	

JUNIPER NETWORKS INC	8,900	27.820	247,598.000	
JM SMUCKER CO/THE	2,720	103.750	282,200.000	
JOHNSON & JOHNSON	65,400	122.410	8,005,614.000	
ABBVIE INC	38,979	98.750	3,849,176.250	
HOLOGIC INC	6,550	40.230	263,506.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	8,650	102.040	882,646.000	
KROGER CO	21,850	26.160	571,596.000	
KLA-TENCOR CORP	3,850	113.130	435,550.500	
LOCKHEED MARTIN CORP	6,300	310.590	1,956,717.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,200	205.530	452,166.000	
L BRANDS INC	5,900	35.990	212,341.000	
LOWE'S COS INC	20,250	99.160	2,007,990.000	
ELI LILLY & CO	24,200	86.350	2,089,670.000	
LAM RESEARCH CORP	4,030	181.170	730,115.100	
JONES LANG LASALLE INC	1,100	170.500	187,550.000	
LOEWS CORP	7,250	49.610	359,672.500	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,449	68.050	370,804.450	
MCDONALD'S CORP	19,300	167.050	3,224,065.000	
3M CO	14,550	203.630	2,962,816.500	
FACEBOOK INC-A	58,600	196.810	11,533,066.000	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	5,104	87.910	448,692.640	
MANPOWERGROUP INC	1,600	93.070	148,912.000	
S&P GLOBAL INC	6,150	207.290	1,274,833.500	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,500	230.200	345,300.000	
CONCHO RESOURCES INC	3,600	127.250	458,100.000	
FIRST DATA CORP- CLASS A	11,150	21.610	240,951.500	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,300	36.560	193,768.000	
PHILLIPS 66	10,950	115.550	1,265,272.500	
TECHNIPFMC PLC	11,150	32.160	358,584.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	13,400	31.430	421,162.000	
MATTEL INC	8,700	17.920	155,904.000	
DXC TECHNOLOGY CO	7,038	84.450	594,359.100	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,000	105.860	317,580.000	
MYLAN NV	12,850	39.510	507,703.500	
METLIFE INC	21,900	46.770	1,024,263.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	11,100	21.760	241,536.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,290	281.120	362,644.800	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	3,800	46.590	177,042.000	

MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,028	113.900	458,789.200	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	640	592.700	379,328.000	
BAKER HUGHES A GE CO	10,273	33.680	345,994.640	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,080	178.940	551,135.200	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1,940	45.260	87,804.400	
MERCK & CO. INC.	66,471	61.560	4,091,954.760	
DOWDUPONT INC	57,105	68.380	3,904,839.900	
MASCO CORP	7,900	38.420	303,518.000	
M & T BANK CORP	3,519	174.710	614,804.490	
MARSH & MCLENNAN COS	12,300	81.940	1,007,862.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,472	138.750	1,036,740.000	
WORKDAY INC-CLASS A	3,300	128.200	423,060.000	
SQUARE INC - A	7,050	63.880	450,354.000	
TRANSUNION	4,400	71.280	313,632.000	
VISTRA ENERGY CORP	8,700	24.010	208,887.000	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,850	65.850	253,522.500	
WORLDPAY INC-CLASS A	7,250	84.310	611,247.500	
NETAPP INC	6,450	77.500	499,875.000	
NIKE INC -CL B	32,200	74.700	2,405,340.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,900	153.470	1,058,943.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,650	102.570	579,520.500	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,200	98.450	315,040.000	
ALLY FINANCIAL INC	10,700	26.340	281,838.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,030	322.560	1,299,916.800	
APTIV PLC	6,500	102.610	666,965.000	
NEWMONT MINING CORP	13,000	39.160	509,080.000	
MCKESSON CORP	5,050	150.000	757,500.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,100	61.430	436,153.000	
XYLEM INC	4,500	71.730	322,785.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	37,900	80.850	3,064,215.000	
NUCOR CORP	7,700	68.530	527,681.000	
WESTERN UNION CO	11,746	20.660	242,672.360	
GODADDY INC - CLASS A	3,600	73.550	264,780.000	
NEWELL BRANDS INC	12,292	26.390	324,385.880	
EVERGY INC	3,450	51.950	179,227.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	18,700	84.350	1,577,345.000	
LIBERTY BROADBAND-C	2,550	76.500	195,075.000	

PAYCHEX INC	7,850	69.340	544,319.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,120	281.890	597,606.800	
ALTRIA GROUP INC	46,400	56.700	2,630,880.000	
P G & E CORP	12,500	39.890	498,625.000	
PFIZER INC	145,163	36.160	5,249,094.080	
ALKERMES PLC	3,600	50.140	180,504.000	
XCEL ENERGY INC	12,400	42.870	531,588.000	
STRYKER CORP	8,200	168.750	1,383,750.000	
PARKER HANNIFIN CORP	3,300	171.910	567,303.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,150	191.450	794,517.500	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,400	129.300	181,020.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	61,817	75.990	4,697,473.830	
EXELON CORP	23,222	41.070	953,727.540	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,500	120.160	660,880.000	
NVR INC	90	3,114.640	280,317.600	
CONOCOPHILLIPS	29,300	68.130	1,996,209.000	
PEPSICO INC	34,700	105.130	3,648,011.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,250	98.750	1,012,187.500	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,250	79.780	339,065.000	
ACCENTURE PLC-CL A	14,900	162.760	2,425,124.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,950	56.650	110,467.500	
PENTAIR PLC	4,205	43.780	184,094.900	
QUALCOMM INC	36,250	59.460	2,155,425.000	
INVESCO LTD	10,150	27.210	276,181.500	
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,900	133.500	253,650.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,200	56.260	405,072.000	
RAYTHEON COMPANY	7,120	202.680	1,443,081.600	
RED HAT INC	4,300	175.900	756,370.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,900	315.670	599,773.000	
REPUBLIC SERVICES INC	5,600	69.230	387,688.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,180	2,123.060	2,505,210.800	
ROSS STORES INC	9,300	84.500	785,850.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,400	120.780	289,872.000	
RESMED INC	3,400	106.760	362,984.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,300	110.940	366,102.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,050	69.930	213,286.500	
RALPH LAUREN CORP	1,300	139.090	180,817.000	
ROCKWELL COLLINS INC	3,963	137.880	546,418.440	

REGIONS FINANCIAL CORP	28,835	18.620	536,907.700	
CHEVRON CORP	46,268	126.510	5,853,364.680	
EDISON INTERNATIONAL	7,850	60.200	472,570.000	
TESLA INC	3,300	357.720	1,180,476.000	
SYMANTEC CORP	15,050	21.360	321,468.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,722	142.290	529,603.380	
SYNOPSYS INC	3,750	90.870	340,762.500	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,505	295.610	1,331,723.050	
CBRE GROUP INC - A	7,500	48.300	362,250.000	
TWITTER INC	16,800	46.760	785,568.000	
SOUTHERN CO/THE	24,500	44.210	1,083,145.000	
SYSCO CORP	12,200	66.480	811,056.000	
TRAVELERS COS INC/THE	6,623	128.860	853,439.780	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,200	65.710	210,272.000	
STERICYCLE INC	2,150	64.210	138,051.500	
STEEL DYNAMICS INC	5,700	49.010	279,357.000	
SCHLUMBERGER LTD	33,652	68.330	2,299,441.160	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,150	53.820	223,353.000	
AT&T INC	149,541	32.520	4,863,073.320	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,650	51.940	189,581.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	11,000	25.890	284,790.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,040	401.200	818,448.000	
SEMPRA ENERGY	5,800	113.320	657,256.000	
TIFFANY & CO	2,950	135.670	400,226.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,050	59.080	416,514.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	24,100	114.720	2,764,752.000	
SALESFORCE.COM INC	16,650	138.410	2,304,526.500	
WESTROCK CO	6,180	60.500	373,890.000	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	22,284	34.890	777,488.760	
ANDEAVOR	3,650	139.020	507,423.000	
UNION PACIFIC CORP	19,050	144.940	2,761,107.000	
MARATHON OIL CORP	21,300	21.120	449,856.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	11,900	75.190	894,761.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	18,400	126.940	2,335,696.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	16,750	117.190	1,962,932.500	
UNUM GROUP	5,400	38.830	209,682.000	

SPRINT CORP	20,765	5.460	113,376.900	
ANTERO RESOURCES CORP	5,100	19.760	100,776.000	
IQVIA HOLDINGS INC	3,944	103.160	406,863.040	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	51.700	224,895.000	
AMEREN CORPORATION	5,800	56.370	326,946.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	23,626	255.330	6,032,426.580	
VERISIGN INC	2,150	141.220	303,623.000	
VALERO ENERGY CORP	10,592	116.820	1,237,357.440	
ULTA BEAUTY INC	1,410	246.600	347,706.000	
FNF GROUP	6,838	38.210	261,279.980	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,100	114.590	240,639.000	
ANTHEM INC	6,290	241.740	1,520,544.600	
WALT DISNEY CO/THE	36,850	108.750	4,007,437.500	
WELLS FARGO & CO	113,972	54.740	6,238,827.280	
WASTE MANAGEMENT INC	10,650	83.570	890,020.500	
WILLIAMS COS INC	20,000	27.210	544,200.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,200	74.320	237,824.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	155.470	264,299.000	
WALMART INC	36,450	83.790	3,054,145.500	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	88.280	256,012.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,050	114.880	580,144.000	
WYNN RESORTS LTD	2,400	176.250	423,000.000	
XEROX CORP	5,211	27.740	144,553.140	
WABTEC CORP	2,050	102.010	209,120.500	
TJX COMPANIES INC	15,650	94.560	1,479,864.000	
WATERS CORP	1,900	200.270	380,513.000	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,800	73.020	131,436.000	
ALLERGAN PLC	8,207	173.950	1,427,607.650	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,100	64.870	1,368,757.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,133	156.040	488,873.320	
WESTERN DIGITAL CORP	7,300	82.550	602,615.000	
WEC ENERGY GROUP INC	7,830	59.860	468,703.800	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	12,200	52.220	637,084.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	44,200	135.000	5,967,000.000	
PPL CORP	16,700	27.070	452,069.000	
PULTEGROUP INC	6,250	30.800	192,500.000	

PPG INDUSTRIES INC	6,150	103.960	639,354.000	
NORTHERN TRUST CORP	5,350	106.950	572,182.500	
NVIDIA CORP	14,800	266.910	3,950,268.000	
IAC/INTERACTIVECORP	1,850	162.260	300,181.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,643	141.840	1,651,443.120	
QURATE RETAIL INC	11,450	21.450	245,602.500	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4,700	43.290	203,463.000	
TYSON FOODS INC-CL A	7,450	70.990	528,875.500	
NETFLIX INC	10,550	392.870	4,144,778.500	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,750	216.550	2,111,362.500	
TORCHMARK CORP	2,675	84.200	225,235.000	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,950	100.060	395,237.000	
TEXTRON INC	6,350	67.490	428,561.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	25,850	44.580	1,152,393.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	11,000	44.420	488,620.000	
NEWS CORP - CLASS A	9,237	16.020	147,976.740	
OGE ENERGY CORP	4,700	34.560	162,432.000	
OMNICOM GROUP	5,700	75.370	429,609.000	
ORACLE CORP	76,333	45.900	3,503,684.700	
MASTERCARD INC - A	22,900	199.310	4,564,199.000	
ONEOK INC	10,250	69.340	710,735.000	
CENTURYLINK INC	23,952	18.010	431,375.520	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,500	283.210	708,025.000	
YUM! BRANDS INC	8,300	83.380	692,054.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,850	121.840	347,244.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,230	226.470	278,558.100	
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,600	66.720	306,912.000	
NOBLE ENERGY INC	11,600	34.570	401,012.000	
BANK OF AMERICA CORP	241,301	29.500	7,118,379.500	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,300	89.980	386,914.000	
NORDSTROM INC	3,000	49.870	149,610.000	
AMERICAN EXPRESS CO	17,950	99.760	1,790,692.000	
ANALOG DEVICES INC	8,899	101.700	905,028.300	
ADVANCED MICRO DEVICES	22,800	16.250	370,500.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	6,800	59.990	407,932.000	

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	21,722	54.800	1,190,365.600	
ANADARKO PETROLEUM CORP	13,500	71.040	959,040.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,500	101.970	458,865.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,200	113.500	476,700.000	
NEWFIELD EXPLORATION CO	5,100	29.200	148,920.000	
AVERY DENNISON CORP	2,100	106.270	223,167.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	14,550	78.550	1,142,902.500	
EMERSON ELECTRIC CO	15,700	72.900	1,144,530.000	
AON PLC	6,050	140.210	848,270.500	
AMGEN INC	17,250	185.790	3,204,877.500	
TAPESTRY INC	7,100	45.530	323,263.000	
EATON CORP PLC	10,736	79.280	851,150.080	
CELGENE CORP	19,200	78.390	1,505,088.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,180	232.180	970,512.400	
APPLIED MATERIALS INC	26,300	49.690	1,306,847.000	
CIT GROUP INC	3,300	51.340	169,422.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,250	86.550	194,737.500	
CME GROUP INC	8,400	168.860	1,418,424.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	9,244	42.160	389,727.040	
ECOLAB INC	6,400	145.400	930,560.000	
EQUIFAX INC	2,900	125.340	363,486.000	
GAP INC/THE	5,950	31.330	186,413.500	
GILEAD SCIENCES INC	31,600	71.150	2,248,340.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,348	120.630	524,499.240	
HORMEL FOODS CORP	7,350	36.110	265,408.500	
STATE STREET CORP	8,943	98.260	878,739.180	
SUNTRUST BANKS INC	11,548	68.890	795,541.720	
SCHWAB (CHARLES) CORP	29,500	56.610	1,669,995.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	12,700	75.410	957,707.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,400	36.510	160,644.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,100	44.970	139,407.000	
CARDINAL HEALTH INC	7,800	54.620	426,036.000	
FEDEX CORP	6,200	263.480	1,633,576.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,854	96.280	1,141,303.120	
FMC CORP	3,350	90.300	302,505.000	
FLEX LTD	12,900	14.010	180,729.000	
CERNER CORP	7,300	61.080	445,884.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,900	124.510	236,569.000	

CITRIX SYSTEMS INC	3,700	106.820	395,234.000	
INTEL CORP	114,000	55.540	6,331,560.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	9,400	23.580	221,652.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,600	53.080	456,488.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	7,450	148.890	1,109,230.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,500	7.380	284,130.000	
ILLUMINA INC	3,550	290.160	1,030,068.000	
SEALED AIR CORP	4,400	44.070	193,908.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,710	495.520	1,342,859.200	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,150	99.940	314,811.000	
SNAP-ON INC	1,400	159.480	223,272.000	
CARMAX INC	4,600	73.220	336,812.000	
COMERICA INC	4,200	95.180	399,756.000	
INGREDION INC	1,700	113.130	192,321.000	
DUKE ENERGY CORP	17,278	73.460	1,269,241.880	
TARGET CORP	12,500	77.220	965,250.000	
DOVER CORP	3,900	76.060	296,634.000	
VW GRAINGER INC	1,300	317.390	412,607.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,100	65.350	202,585.000	
CINTAS CORP	2,200	191.560	421,432.000	
CA INC	7,505	37.060	278,135.300	
CONAGRA BRANDS INC	10,000	38.200	382,000.000	
COLOROX COMPANY	3,100	127.890	396,459.000	
ENTERGY CORP	4,400	76.710	337,524.000	
MICROSOFT CORP	178,300	101.420	18,083,186.000	
INCYTE CORP	4,300	73.640	316,652.000	
CVS HEALTH CORP	24,674	69.120	1,705,466.880	
MEDTRONIC PLC	33,088	86.570	2,864,428.160	
MICRON TECHNOLOGY INC	28,200	59.180	1,668,876.000	
BLACKROCK INC	2,940	523.360	1,538,678.400	
CENTERPOINT ENERGY INC	10,300	26.180	269,654.000	
HASBRO INC	2,850	91.610	261,088.500	
KELLOGG CO	6,450	66.600	429,570.000	
KEYCORP	26,700	20.530	548,151.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,550	108.660	277,083.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	36,611	40.400	1,479,084.400	

KOHL'S CORP	4,150	73.280	304,112.000	
COOPER COS INC/THE	1,200	235.150	282,180.000	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	12,000	11.540	138,480.000	
APACHE CORP	9,260	42.890	397,161.400	
CHUBB LTD	11,349	130.100	1,476,504.900	
ARROW ELECTRONICS INC	2,150	79.100	170,065.000	
ALLSTATE CORP	8,900	92.800	825,920.000	
EBAY INC	23,900	39.000	932,100.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	27,800	85.610	2,379,958.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	3,450	107.930	372,358.500	
XILINX INC	6,150	70.430	433,144.500	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	13,860	82.240	1,139,846.400	
DISH NETWORK CORP-A	5,750	34.080	195,960.000	
ZIONS BANCORPORATION	4,800	55.450	266,160.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,500	156.370	860,035.000	
TOLL BROTHERS INC	3,800	39.050	148,390.000	
TRIMBLE INC	6,400	35.400	226,560.000	
LENNAR CORP-A	7,100	53.070	376,797.000	
LEAR CORP	1,650	202.690	334,438.500	
E*TRADE FINANCIAL CORP	6,500	64.840	421,460.000	
PROGRESSIVE CORP	14,300	61.890	885,027.000	
PRAXAIR INC	7,000	161.550	1,130,850.000	
PACCAR INC	8,687	63.760	553,883.120	
PVH CORP	1,850	160.240	296,444.000	
BIOGEN INC	5,160	305.680	1,577,308.800	
IDEXX LABORATORIES INC	2,100	226.080	474,768.000	
STARBUCKS CORP	34,600	57.020	1,972,892.000	
PERRIGO CO PLC	3,050	74.830	228,231.500	
EVERSOURCE ENERGY	7,730	53.990	417,342.700	
INTUIT INC	5,950	209.080	1,244,026.000	
BORGWARNER INC	5,100	48.820	248,982.000	
BEST BUY CO INC	6,500	73.320	476,580.000	
BALL CORP	8,034	36.880	296,293.920	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	33,247	32.510	1,080,859.970	
XL GROUP LTD	6,100	56.200	342,820.000	
ELECTRONIC ARTS INC	7,550	144.390	1,090,144.500	
VULCAN MATERIALS CO	3,200	131.860	421,952.000	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,200	154.990	960,938.000	
VF CORP	8,350	84.030	701,650.500	

	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	8,371	55.120	461,409.520	
	VIACOM INC-CLASS B	8,671	28.910	250,678.610	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,570	214.110	336,152.700	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,200	123.310	271,282.000	
	CARNIVAL CORP	10,650	64.200	683,730.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	113,790	33.820	3,848,377.800	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	5,200	37.000	192,400.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,300	62.740	332,522.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	8.850	79,650.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	28,500	7.400	210,900.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 596,423,217.070 (66,012,121,665)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	MERLIN ENTERTAINMENT	16,300	3.828	62,396.400	
	TUI AG-DI	10,947	17.645	193,159.810	
	BP PLC	488,400	5.855	2,859,582.000	
	UNILEVER PLC	30,660	40.335	1,236,671.100	
	BARCLAYS PLC	423,000	2.006	848,538.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	41,700	8.828	368,127.600	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	42,100	3.070	129,247.000	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,280	59.440	135,523.200	
	PRUDENTIAL PLC	64,000	18.645	1,193,280.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	87,391	2.636	230,362.670	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,964	38.230	189,773.720	
	BAE SYSTEMS PLC	78,700	6.508	512,179.600	
	AVIVA PLC	98,566	5.170	509,586.220	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	122,152	15.802	1,930,245.900	
	INFORMA PLC	32,000	8.346	267,072.000	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	10,500	13.675	143,587.500	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	119,500	2.405	287,397.500	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	9,300	5.642	52,470.600	
	AUTO TRADER GROUP PLC	22,400	4.221	94,550.400	
	DCC PLC	2,150	72.500	155,875.000	
	GVC HOLDINGS PLC	14,000	10.350	144,900.000	
	CONVATEC GROUP PLC	33,000	2.279	75,207.000	
	ROYAL MAIL PLC	22,300	5.052	112,659.600	

NMC HEALTH PLC	2,700	36.840	99,468.000
RELX PLC	26,746	16.095	430,476.870
DIAGEO PLC	61,800	27.735	1,714,023.000
RIO TINTO PLC	30,050	44.020	1,322,801.000
STANDARD CHARTERED PLC	81,300	7.309	594,221.700
TESCO PLC	245,800	2.498	614,008.400
FRESNILLO PLC	5,600	12.060	67,536.000
SMITH & NEPHEW PLC	22,100	13.625	301,112.500
GLENCORE PLC	306,625	3.985	1,221,900.620
WOOD GROUP (JOHN) PLC	16,200	6.420	104,004.000
HARGREAVES LANSDOWN PLC	6,800	20.880	141,984.000
SMITHS GROUP PLC	10,233	18.010	184,296.330
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	8.564	52,240.400
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	33,483	3.568	119,467.340
PEARSON PLC	20,163	8.832	178,079.610
SAINSBURY (J) PLC	41,025	3.147	129,105.670
NEXT PLC	3,550	61.940	219,887.000
TAYLOR WIMPEY PLC	84,200	1.881	158,380.200
WHITBREAD PLC	4,611	41.710	192,324.810
BUNZL PLC	8,255	23.500	193,992.500
VODAFONE GROUP PLC	667,683	1.880	1,255,644.640
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,193	49.610	158,404.730
KINGFISHER PLC	55,411	3.145	174,267.590
WPP PLC	31,300	12.300	384,990.000
UNITED UTILITIES GROUP PLC	17,127	7.862	134,652.470
SEVERN TRENT PLC	5,733	18.800	107,780.400
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	16,750	61.500	1,030,125.000
ST JAMES'S PLACE PLC	13,600	12.405	168,708.000
SCHRODERS PLC	3,050	32.760	99,918.000
SSE PLC	25,100	13.600	341,360.000
WEIR GROUP PLC/THE	6,150	20.700	127,305.000
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	25,900	5.620	145,558.000
ASTRAZENECA PLC	31,450	54.480	1,713,396.000
FERGUSON PLC	5,887	61.280	360,755.360
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	146,500	2.732	400,238.000
3I GROUP PLC	23,891	9.796	234,036.230
SKY PLC	25,500	13.500	344,250.000
ASHTED GROUP PLC	12,700	23.840	302,768.000
SAGE GROUP PLC/THE	27,614	6.804	187,885.650

NATIONAL GRID PLC	84,234	8.343	702,764.260	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,785,965	0.631	1,127,479.700	
RSA INSURANCE GROUP PLC	26,260	6.580	172,790.800	
IMPERIAL BRANDS PLC	23,450	26.080	611,576.000	
CENTRICA PLC	143,660	1.532	220,158.950	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,200	41.990	134,368.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	56,710	37.345	2,117,834.950	
BHP BILLITON PLC	51,977	17.488	908,973.770	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	9,100	27.510	250,341.000	
HSBC HOLDINGS PLC	497,700	7.346	3,656,104.200	
SHIRE PLC	22,574	40.695	918,648.930	
OLD MUTUAL PLC	122,525	2.269	278,009.220	
ANGLO AMERICAN PLC	32,883	17.934	589,723.720	
MONDI PLC	9,350	20.870	195,134.500	
WM MORRISON SUPERMARKETS	54,900	2.462	135,163.800	
CARNIVAL PLC	4,511	47.740	215,355.140	
EASYJET PLC	4,000	17.960	71,840.000	
COMPASS GROUP PLC	39,439	16.150	636,939.850	
PERSIMMON PLC	7,900	27.270	215,433.000	
BT GROUP PLC	213,400	2.141	456,889.400	
COCA-COLA HBC AG-DI	4,400	26.300	115,720.000	
BURBERRY GROUP PLC	10,489	21.630	226,877.070	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,636	49.440	229,203.840	
TRAVIS PERKINS PLC	5,900	14.315	84,458.500	
INTERTEK GROUP PLC	4,050	58.300	236,115.000	
ITV PLC	93,100	1.746	162,599.150	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	7,899	44.900	354,665.100	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	112,600	26.075	2,936,045.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	93,318	27.105	2,529,384.390	
MEGGITT PLC	19,500	5.016	97,812.000	
G4S PLC	37,800	2.795	105,651.000	
ADMIRAL GROUP PLC	4,950	19.080	94,446.000	
INVESTEC PLC	16,000	5.710	91,360.000	
ANTOFAGASTA PLC	9,800	10.650	104,370.000	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	67,157	3.532	237,198.520	
EXPERIAN PLC	22,654	18.820	426,348.280	

イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド	
				49,091,528.880	
				(7,199,763,625)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	184.400	184,400.000	
	FRUTAROM	900	352.200	316,980.000	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,300	4.000	193,200.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	17,600	17.800	313,280.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	444.400	266,640.000	
	BANK HAPOALIM BM	26,600	24.940	663,404.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	35,400	22.210	786,234.000	
	NICE LTD	1,400	397.000	555,800.000	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,000	67.050	201,150.000		
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル	
				3,481,088.000	
				(106,590,915)	
オーストラリ ア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	HEALTHSCOPE LTD	45,500	2.290	104,195.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	66,500	2.900	192,850.000	
	BHP BILLITON LIMITED	79,650	33.380	2,658,717.000	
	SOUTH32 LTD	128,600	3.810	489,966.000	
	ALUMINA LTD	62,300	2.740	170,702.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	23,500	33.720	792,420.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	38,800	4.650	180,420.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	10.170	120,006.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	68,750	25.950	1,784,062.500	
	WESTPAC BANKING CORP	84,048	27.300	2,294,510.400	
	SANTOS LTD	45,200	5.820	263,064.000	
	AUSNET SERVICES	41,000	1.555	63,755.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	73,600	26.200	1,928,320.000	
	RIO TINTO LTD	10,450	84.620	884,279.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	43,700	9.700	423,890.000	
	AMCOR LIMITED	28,100	13.790	387,499.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	49,500	4.320	213,840.000	
	OIL SEARCH LTD	32,900	8.380	275,702.000	
SEEK LTD	8,300	21.170	175,711.000		
TREASURY WINE ESTATES LTD	18,000	17.550	315,900.000		

NEWCREST MINING LTD	18,650	20.500	382,325.000	
INCITEC PIVOT LTD	42,300	3.450	145,935.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	43,350	67.450	2,923,957.500	
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,450	30.320	195,564.000	
ORICA LTD	9,200	17.390	159,988.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	34,300	9.300	318,990.000	
CIMIC GROUP LTD	2,400	40.460	97,104.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	33,000	28.980	956,340.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	8.870	121,519.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	48,400	4.590	222,156.000	
CROWN RESORTS LTD	9,600	13.250	127,200.000	
TELSTRA CORP LTD	104,600	2.900	303,340.000	
AMP LTD	75,000	3.630	272,250.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	11,100	21.650	240,315.000	
MACQUARIE GROUP LTD	7,984	113.450	905,784.800	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	14,550	29.600	430,680.000	
BANK OF QUEENSLAND LTD	9,100	9.910	90,181.000	
CSL LTD	11,350	186.790	2,120,066.500	
WESFARMERS LTD	27,895	47.000	1,311,065.000	
COCHLEAR LTD	1,400	189.800	265,720.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	13,400	18.350	245,890.000	
SUNCORP GROUP LTD	32,700	13.870	453,549.000	
BORAL LTD	27,700	6.340	175,618.000	
ASX LTD	4,700	61.950	291,165.000	
COMPUTERSHARE LTD	11,400	17.870	203,718.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	3.500	49,000.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	61,000	7.940	484,340.000	
SONIC HEALTHCARE LTD	10,400	23.900	248,560.000	
CHALLENGER LTD	13,900	12.370	171,943.000	
AGL ENERGY LTD	16,400	21.440	351,616.000	
BRAMBLES LTD	39,500	9.030	356,685.000	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	62.560	87,584.000	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,550	57.780	205,119.000	
TPG TELECOM LTD	8,700	5.470	47,589.000	
REA GROUP LTD	1,200	90.110	108,132.000	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,400	51.430	72,002.000	

オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル	
				28,862,799.700	
				(2,382,046,861)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,100	43.160	306,436.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	500	1,049.990	524,995.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,096	26.240	133,719.040	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	5,587	78.790	440,199.730	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	10,700	29.160	312,012.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,550	95.100	337,605.000	
	BCE INC	3,730	54.310	202,576.300	
	FRANCO-NEVADA CORP	4,700	91.290	429,063.000	
	SUNCOR ENERGY INC	41,130	52.140	2,144,518.200	
	METRO INC	5,500	43.940	241,670.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	8,500	63.770	542,045.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	29,800	75.980	2,264,204.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	10,750	115.200	1,238,400.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	45,600	76.200	3,474,720.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	7,600	33.350	253,460.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	35,950	99.850	3,589,607.500	
	TOURMALINE OIL CORP	5,400	24.120	130,248.000	
	VERMILION ENERGY INC	2,800	45.850	128,380.000	
	TRANSCANADA CORP	21,650	54.530	1,180,574.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	12,729	45.250	575,987.250	
	BOMBARDIER INC-B	53,000	4.890	259,170.000	
	BARRICK GOLD CORP	28,600	17.250	493,350.000	
	CAE INC	6,500	27.490	178,685.000	
	THOMSON REUTERS CORP	7,104	53.730	381,697.920	
	EMPIRE CO LTD 'A'	4,600	24.560	112,976.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	86.130	137,808.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,450	66.020	227,769.000	
	LINAMAR CORP	1,300	63.730	82,849.000	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	6,400	14.810	94,784.000	
	HYDRO ONE LTD	7,200	19.510	140,472.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	65.780	359,158.800	
	WSP GLOBAL INC	2,700	73.830	199,341.000	
	EMERA INC	1,300	40.230	52,299.000	

CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,300	31.430	103,719.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,000	61.940	557,460.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,900	60.960	359,664.000	
KINROSS GOLD CORP	29,500	4.970	146,615.000	
BANK OF MONTREAL	16,300	101.840	1,659,992.000	
POWER CORP OF CANADA	8,600	30.630	263,418.000	
METHANEX CORP	2,200	89.570	197,054.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	2,200	220.210	484,462.000	
NUTRIEN LTD	15,919	70.310	1,119,264.890	
CAMECO CORP	9,200	15.850	145,820.000	
TELUS CORP	5,400	46.230	249,642.000	
POWER FINANCIAL CORP	6,200	32.260	200,012.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	14,000	37.430	524,020.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,600	173.080	276,928.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	24,800	3.750	93,000.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	30,800	41.990	1,293,292.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	700	760.140	532,098.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,700	85.740	745,938.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,300	103.920	135,096.000	
BLACKBERRY LTD	11,900	16.000	190,400.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	15,250	54.720	834,480.000	
ENBRIDGE INC	42,800	42.690	1,827,132.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	20,850	55.030	1,147,375.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	49,400	24.870	1,228,578.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	8,700	35.070	305,109.000	
GOLDCORP INC	21,859	18.740	409,637.660	
ENCANA CORP	24,300	16.600	403,380.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,600	254.420	915,912.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,500	52.500	131,250.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,600	37.850	211,960.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	18,550	109.430	2,029,926.500	
CGI GROUP INC - CLASS A	6,500	81.400	529,100.000	
HUSKY ENERGY INC	8,458	19.770	167,214.660	
ONEX CORPORATION	2,000	92.730	185,460.000	

	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,700	27.660	295,962.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	4,400	33.940	149,336.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	59.610	268,245.000	
	IGM FINANCIAL INC	1,900	39.760	75,544.000	
	OPEN TEXT CORP	6,600	47.100	310,860.000	
	CI FINANCIAL CORP	7,000	24.960	174,720.000	
	SAPUTO INC	5,800	43.530	252,474.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,700	21.950	388,515.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	11,000	54.790	602,690.000	
	FORTIS INC	10,400	40.600	422,240.000	
	LUNDIN MINING CORP	16,100	8.350	134,435.000	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	13,300	9.780	130,074.000	
	CENOVUS ENERGY INC	27,200	12.380	336,736.000	
	DOLLARAMA INC	2,600	151.710	394,446.000	
	ATCO LTD -CLASS I	1,700	39.220	66,674.000	
	ALTAGAS LTD	4,500	26.150	117,675.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	3,800	21.080	80,104.000	
	KEYERA CORP	4,800	36.080	173,184.000	
	INTER PIPELINE LTD	9,500	24.560	233,320.000	
	ARC RESOURCES LTD	8,300	13.210	109,643.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 45,492,067.450 (3,836,346,048)	
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	33,100	26.950	892,045.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	44,200	27.610	1,220,362.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	13,670	11.190	152,967.300	
	KEPPEL CORP LTD	36,300	7.240	262,812.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	7.670	107,380.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,400	11.210	116,584.000	
	CAPITALAND LTD	63,000	3.390	213,570.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	56,800	0.965	54,812.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	2.630	107,830.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	33.150	89,505.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	79,000	12.130	958,270.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	153,000	1.220	186,660.000	

	VENTURE CORP LTD	7,200	20.110	144,792.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	203,850	3.190	650,281.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	39,500	3.450	136,275.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	22,700	2.800	63,560.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.320	52,608.000	
	SATS LTD	16,000	5.020	80,320.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,800	7.210	149,968.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	55,300	2.320	128,296.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	43,200	3.280	141,696.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 5,910,593.800 (485,850,809)	
スイス・フラン	株		スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFY AG-REG	850	139.650	118,702.500	
	UBS GROUP AG-REG	97,700	15.760	1,539,752.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	200	657.000	131,400.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,900	60.840	237,276.000	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	17,700	211.300	3,740,010.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	950	90.300	85,785.000	
	SIKA AG-REG	3,180	146.300	465,234.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	75,600.000	226,800.000	
	ABB LTD-REG	45,900	23.370	1,072,683.000	
	SWISS RE AG	7,750	89.040	690,060.000	
	NESTLE SA-REG	77,050	74.620	5,749,471.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	420	743.000	312,060.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	970	222.000	215,340.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	65,120	15.645	1,018,802.400	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,550	61.280	340,104.000	
	SGS SA-REG	130	2,665.000	346,450.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	500	217.800	108,900.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,200	162.850	195,420.000	
	TEMENOS AG - REG	1,550	154.300	239,165.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	790	498.100	393,499.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,802	300.400	1,142,120.800	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,200	149.700	179,640.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	24.790	141,303.000	
	NOVARTIS AG-REG	55,350	75.500	4,178,925.000	

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	60	1,814.000	108,840.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	13,100	92.540	1,212,274.000	
	SWISSCOM AG-REG	660	446.000	294,360.000	
	GEBERIT AG-REG	910	441.800	402,038.000	
	GIVAUDAN-REG	230	2,260.000	519,800.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	270	768.500	207,495.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,300	174.000	226,200.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,830	275.000	503,250.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,300	90.500	117,650.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	11,390	52.220	594,785.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	820	352.500	289,050.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,350	153.650	207,427.500	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,850	92.450	171,032.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	25	6,340.000	158,500.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 27,881,605.500 (3,092,627,682)	
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	274.000	520,600.000	
	ERICSSON LM-B SHS	78,130	68.180	5,326,903.400	
	VOLVO AB-B SHS	39,100	149.850	5,859,135.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,500	550.000	825,000.000	
	SKF AB-B SHARES	9,750	172.300	1,679,925.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	5,950	218.500	1,300,075.000	
	NORDEA BANK AB	74,800	85.620	6,404,376.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,600	424.300	1,951,780.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	116.050	1,038,647.500	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	38,650	83.060	3,210,269.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	37,450	98.880	3,703,056.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	22,400	189.800	4,251,520.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	23,550	140.060	3,298,413.000	
	SKANSKA AB-B SHS	8,350	160.250	1,338,087.500	
	SANDVIK AB	28,450	156.600	4,455,270.000	
	INVESTOR AB-B SHS	11,350	373.700	4,241,495.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	16,550	278.950	4,616,622.500	
	SECURITAS AB-B SHS	7,400	145.400	1,075,960.000	
	TELIA CO AB	71,600	42.940	3,074,504.000	

	ALFA LAVAL AB	7,000	224.500	1,571,500.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,700	253.600	2,459,920.000	
	ASSA ABLOY AB-B	24,900	191.050	4,757,145.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,800	285.600	514,080.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	4,650	283.800	1,319,670.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	15,000	215.400	3,231,000.000	
	BOLIDEN AB	6,500	305.550	1,986,075.000	
	EPIROC AB-A	16,550	83.850	1,387,717.500	
	EPIROC AB-B	9,700	80.550	781,335.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	9,750	87.980	857,805.000	
	KINNEVIK AB - B	5,650	317.100	1,791,615.000	
	HEXAGON AB-B SHS	6,500	514.800	3,346,200.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,000	184.800	739,200.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クロー ナ 82,914,901.400 (1,048,044,353)	
デンマーク・ク ローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	46,400	285.900	13,265,760.000	
	DANSKE BANK A/S	18,800	219.100	4,119,080.000	
	ISS A/S	3,900	222.400	867,360.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	9,275.000	881,125.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	459.400	780,980.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,250	414.200	2,174,550.000	
	CARLSBERG AS-B	2,600	739.600	1,922,960.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,800	328.100	1,902,980.000	
	COLOPLAST-B	2,950	638.600	1,883,870.000	
	DSV A/S	4,750	542.200	2,575,450.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,675	258.400	691,220.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	160	9,932.000	1,589,120.000	
	TRYG A/S	2,500	150.600	376,500.000	
	PANDORA A/S	2,750	488.600	1,343,650.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,550	652.200	1,663,110.000	
	GENMAB A/S	1,400	987.800	1,382,920.000	
	ORSTED A/S	4,700	374.900	1,762,030.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 39,182,665.000 (672,766,358)	

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	3.150	81,900.000	
	A2 MILK CO LTD	19,000	11.500	218,500.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.800	200,218.200	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	6.930	162,162.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	6.750	135,675.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	13,500	15.010	202,635.000	
RYMAN HEALTHCARE LTD	8,800	12.000	105,600.000		
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ド ル 1,106,690.200 (85,137,677)	
ノルウェー・ク ローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	35,200	53.100	1,869,120.000	
	DNB ASA	23,950	158.600	3,798,470.000	
	ORKLA ASA	20,850	73.160	1,525,386.000	
	TELENOR ASA	18,600	170.700	3,175,020.000	
	EQUINOR ASA	28,423	218.800	6,218,952.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,160	346.300	1,440,608.000	
	MARINE HARVEST	9,900	171.300	1,695,870.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,850	129.400	627,590.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,400	245.500	589,200.000	
AKER BP ASA	2,900	304.600	883,340.000		
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 21,823,556.400 (296,800,367)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	20,500	100.800	2,066,400.000	
	EVONIK INDUSTRIES AG	4,250	30.980	131,665.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	50,650	9.657	489,127.050	
	COMMERZBANK AG	26,335	9.297	244,836.490	
	VOLKSWAGEN AG	800	163.000	130,400.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	4,620	163.340	754,630.800	
	MAN SE	850	93.150	79,177.500	
	SIEMENS AG-REG	18,900	120.700	2,281,230.000	
	E.ON SE	54,500	9.272	505,324.000	
UNIPER SE	4,900	25.580	125,342.000		

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8,250	86.270	711,727.500	
GEA GROUP AG	4,500	32.030	144,135.000	
OSRAM LICHT AG	2,560	51.900	132,864.000	
CONTINENTAL AG	2,700	220.500	595,350.000	
BASF SE	22,750	88.070	2,003,592.500	
K+S AG-REG	4,800	22.920	110,016.000	
ALLIANZ SE-REG	11,010	183.060	2,015,490.600	
THYSSENKRUPP AG	10,700	23.690	253,483.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,450	110.100	489,945.000	
RWE AG	13,150	20.060	263,789.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	5,650	23.840	134,696.000	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,000	85.000	85,000.000	
BRENNTAG AG	3,950	50.440	199,238.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	10,500	70.940	744,870.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,000	58.080	174,240.000	
HOCHTIEF AG	450	160.200	72,090.000	
SAP SE	24,342	104.300	2,538,870.600	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,830	185.600	710,848.000	
SCHAEFFLER AG	3,800	13.005	49,419.000	
ZALANDO SE	2,900	47.620	138,098.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,700	77.720	287,564.000	
KION GROUP AG	1,850	72.520	134,162.000	
WIRECARD AG	2,950	156.300	461,085.000	
COVESTRO AG	4,900	77.600	380,240.000	
INNOGY SE	3,400	36.800	125,120.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	950	133.000	126,350.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,750	63.120	236,700.000	
DELIVERY HERO AG	2,500	41.000	102,500.000	
METRO AG	4,100	11.400	46,740.000	
1&1 DRILLISCH AG	1,300	64.450	83,785.000	
LINDE AG - TENDER	4,630	209.200	968,596.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,000	35.885	143,540.000	
BEIERSDORF AG	2,550	99.360	253,368.000	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,700	46.400	78,880.000	
MERCK KGAA	3,250	84.140	273,455.000	
ADIDAS AG	4,660	198.750	926,175.000	
PUMA SE	156	505.000	78,780.000	

HENKEL AG & CO KGAA	2,650	98.350	260,627.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	83,100	13.850	1,150,935.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,300	88.480	468,944.000	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	23,850	63.190	1,507,081.500	
QIAGEN N.V.	5,598	32.210	180,311.580	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	28,750	25.490	732,837.500	
HANNOVER RUECK SE	1,500	111.900	167,850.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	24,450	30.360	742,302.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	4,900	116.400	570,360.000	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	5,950	24.250	144,287.500	
LANXESS AG	2,200	72.260	158,972.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,330	166.600	221,578.000	
AXEL SPRINGER SE	1,200	61.600	73,920.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	8,850	41.270	365,239.500	
SYMRISE AG	3,000	75.140	225,420.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	18,800	3.672	69,033.600	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,350	74.450	100,507.500	
HUGO BOSS AG -ORD	1,590	80.020	127,231.800	
RTL GROUP	1,000	65.550	65,550.000	
VONOVIA SE	12,100	41.500	502,150.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	23,726	36.955	876,794.330	
NN GROUP NV	7,600	36.890	280,364.000	
ARCELORMITTAL	16,900	29.045	490,860.500	
UNILEVER NV-CVA	40,300	46.660	1,880,398.000	
HEINEKEN NV	6,350	88.020	558,927.000	
RELX NV	23,719	18.265	433,227.530	
AEGON NV	44,744	5.430	242,959.920	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	31,983	20.435	653,572.600	
AKZO NOBEL	6,300	76.360	481,068.000	
KONINKLIJKE DSM NV	4,550	90.180	410,319.000	
WOLTERS KLUWER	7,300	48.160	351,568.000	
ING GROEP NV	97,250	12.722	1,237,214.500	
KONINKLIJKE KPN NV	84,250	2.411	203,126.750	
ASML HOLDING NV	9,850	185.600	1,828,160.000	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	10,300	23.020	237,106.000	

VOPAK	1,900	41.700	79,230.000
RANDSTAD NV	2,850	53.460	152,361.000
HEINEKEN HOLDING NV	2,850	85.000	242,250.000
JCDECAUX SA	1,900	27.940	53,086.000
TOTAL SA	60,450	52.860	3,195,387.000
MICHELIN (CGDE)	4,250	110.500	469,625.000
AIR LIQUIDE SA	10,702	112.100	1,199,694.200
KERING	1,880	514.600	967,448.000
SCHNEIDER ELECTRIC SE	14,100	75.700	1,067,370.000
BOUYGUES SA	5,250	38.870	204,067.500
BNP PARIBAS	27,800	54.840	1,524,552.000
PEUGEOT SA	14,500	21.320	309,140.000
NATIXIS	22,950	6.390	146,650.500
THALES SA	2,680	110.700	296,676.000
DANONE	15,150	64.990	984,598.500
CARREFOUR SA	14,900	15.530	231,397.000
SUEZ	8,875	11.550	102,506.250
VIVENDI	25,441	21.900	557,157.900
L'OREAL	6,300	211.100	1,329,930.000
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	12,500	41.505	518,812.500
LEGRAND SA	6,567	64.960	426,592.320
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,300	34.300	44,590.000
PERNOD RICARD SA	5,417	144.900	784,923.300
SOCIETE BIC SA	700	79.900	55,930.000
EURAZEO SA	1,045	67.150	70,171.750
REXEL SA	7,050	13.360	94,188.000
SOCIETE GENERALE SA	19,350	37.460	724,851.000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,900	302.550	2,087,595.000
ACCOR SA	4,650	44.660	207,669.000
CAPGEMINI SE	3,990	118.000	470,820.000
VALEO SA	5,950	53.340	317,373.000
PUBLICIS GROUPE	5,250	59.380	311,745.000
BUREAU VERITAS SA	6,500	23.380	151,970.000
EIFFAGE	1,820	96.360	175,375.200
SODEXO SA	2,300	85.720	197,156.000
IPSEN	900	137.100	123,390.000
INGENICO GROUP	1,600	76.480	122,368.000
AMUNDI SA	1,500	63.300	94,950.000

TELEPERFORMANCE	1,400	139.800	195,720.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,000	99.740	199,480.000	
FAURECIA	1,900	72.020	136,838.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	270	419.000	113,130.000	
SEB SA	560	152.700	85,512.000	
ESSILOR INTERNATIONAL	5,200	121.150	629,980.000	
DASSAULT AVIATION SA	60	1,704.000	102,240.000	
AXA SA	48,200	21.835	1,052,447.000	
EDENRED	5,950	27.430	163,208.500	
RENAULT SA	4,700	84.830	398,701.000	
HERMES INTERNATIONAL	780	551.400	430,092.000	
STMICROELECTRONICS NV	17,350	22.640	392,804.000	
REMY COINTREAU	550	126.500	69,575.000	
ATOS SE	2,350	123.250	289,637.500	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,200	123.950	396,640.000	
WENDEL	680	125.400	85,272.000	
ORANGE	50,250	14.640	735,660.000	
ALSTOM	4,050	40.260	163,053.000	
CNP ASSURANCES	4,300	19.770	85,011.000	
SANOFI	28,175	67.330	1,897,022.750	
VINCI SA	12,700	85.800	1,089,660.000	
AIRBUS SE	14,450	104.560	1,510,892.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,650	19.510	266,311.500	
CREDIT AGRICOLE SA	28,100	12.050	338,605.000	
BIOMERIEUX	1,000	81.900	81,900.000	
ENGIE	46,173	13.895	641,573.830	
IMERYS SA	900	71.400	64,260.000	
EDF	13,950	11.550	161,122.500	
SES	9,000	15.605	140,445.000	
SAFRAN SA	8,300	104.150	864,445.000	
ILIAD SA	650	141.950	92,267.500	
ARKEMA	1,650	103.900	171,435.000	
ADP	740	194.600	144,004.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	17.700	71,685.000	
SCOR SE	4,150	32.320	134,128.000	
GETLINK	11,250	12.190	137,137.500	
BOLLORE	21,300	4.168	88,778.400	
UCB SA	3,250	66.400	215,800.000	
KBC GROUP NV	6,200	66.940	415,028.000	

COLRUYT SA	1,600	45.960	73,536.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,000	93.900	187,800.000	
SOLVAY SA	1,800	113.400	204,120.000	
UMICORE	5,100	51.000	260,100.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	19,000	84.030	1,596,570.000	
AGEAS	4,540	44.170	200,531.800	
PROXIMUS	3,500	21.770	76,195.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,200	41.440	49,728.000	
PRYSMIAN SPA	5,350	25.700	137,495.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	31,343	14.735	461,839.100	
MEDIOBANCA SPA	15,265	8.166	124,653.990	
TENARIS SA	11,250	15.770	177,412.500	
UNICREDIT SPA	49,256	14.520	715,197.120	
TELECOM ITALIA SPA	282,782	0.684	193,422.880	
TELECOM ITALIA-RSP	146,950	0.599	88,140.610	
INTESA SANPAOLO-RSP	21,000	2.690	56,490.000	
INTESA SANPAOLO	336,097	2.594	871,835.610	
ATLANTIA SPA	11,407	25.160	287,000.120	
POSTE ITALIANE SPA	13,500	7.820	105,570.000	
MONCLER SPA	4,700	42.180	198,246.000	
RECORDATI SPA	2,600	33.300	86,580.000	
ENI SPA	63,800	15.814	1,008,933.200	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	14,300	6.925	99,027.500	
PIRELLI & C SPA	11,000	7.400	81,400.000	
LEONARDO SPA	9,525	8.998	85,705.950	
ENEL SPA	201,934	4.873	984,024.380	
SNAM SPA	56,600	3.613	204,495.800	
LUXOTTICA GROUP SPA	4,100	55.560	227,796.000	
TERNA SPA	34,900	4.656	162,494.400	
EXOR NV	2,680	61.820	165,677.600	
CNH INDUSTRIAL NV	25,200	10.125	255,150.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	26,650	18.238	486,042.700	
FERRARI NV	3,145	127.200	400,044.000	
TELEFONICA SA	114,927	7.549	867,583.920	
ENDESA SA	7,650	19.505	149,213.250	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	166,412	6.094	1,014,114.720	
IBERDROLA SA	146,234	6.660	973,918.440	

BANCO DE SABADELL SA	130,909	1.469	192,305.320	
BANKINTER SA	16,600	8.678	144,054.800	
REPSOL SA	33,850	17.220	582,897.000	
GRIFOLS SA	7,200	27.610	198,792.000	
BANCO SANTANDER SA	405,750	4.786	1,942,122.370	
AMADEUS IT GROUP SA	11,000	72.240	794,640.000	
GAS NATURAL SDG SA	8,450	21.790	184,125.500	
MAPFRE SA	25,450	2.583	65,737.350	
CAIXABANK S.A	88,800	3.857	342,501.600	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE- DI	15,200	8.190	124,488.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,176	36.800	227,276.800	
AENA SME SA	1,700	160.050	272,085.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	27,450	30.030	824,323.500	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	5,600	13.150	73,640.000	
ENAGAS SA	5,400	24.520	132,408.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,700	17.895	191,476.500	
FERROVIAL SA	12,300	18.430	226,689.000	
BANKIA SA	30,105	3.388	101,995.740	
UPM-KYMMENE OYJ	13,000	31.850	414,050.000	
NOKIA OYJ	146,750	5.238	768,676.500	
WARTSILA OYJ ABP	10,800	17.555	189,594.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	13,800	17.745	244,881.000	
METSO OYJ	2,800	31.000	86,800.000	
ELISA OYJ	3,650	39.260	143,299.000	
SAMPO OYJ-A SHS	11,100	42.260	469,086.000	
FORTUM OYJ	11,150	20.300	226,345.000	
KONE OYJ-B	8,200	44.570	365,474.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,050	34.780	106,079.000	
NESTE OYJ	3,150	67.000	211,050.000	
ORION OYJ-CLASS B	2,450	24.420	59,829.000	
OMV AG	3,550	50.580	179,559.000	
ERSTE GROUP BANK AG	7,400	36.290	268,546.000	
VOESTALPINE AG	2,850	44.740	127,509.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	28.000	95,200.000	
ANDRITZ AG	1,600	43.940	70,304.000	

	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,000	34.720	208,320.000	
	AIB GROUP PLC	20,000	4.960	99,200.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	23,660	7.050	166,803.000	
	JERONIMO MARTINS	6,000	13.370	80,220.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	56,500	3.400	192,100.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	11,650	16.180	188,497.000	
	KERRY GROUP PLC-A	3,970	89.350	354,719.500	
	CRH PLC	20,850	32.620	680,127.000	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	2,050	98.000	200,900.000	
ユーロ 小計				ユーロ 101,565,651.120 (12,990,246,778)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	35,000	55.300	1,935,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	59,000	64.850	3,826,150.000	
	MTR CORP	38,000	43.600	1,656,800.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	40,000	123.200	4,928,000.000	
	SINO LAND CO	74,000	13.360	988,640.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	66,169	88.300	5,842,722.700	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	25.500	816,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	12,500	83.000	1,037,500.000	
	CLP HOLDINGS LTD	41,500	81.250	3,371,875.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	32,916	44.050	1,449,949.800	
	HANG LUNG GROUP LTD	21,000	23.650	496,650.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	230,181	14.860	3,420,489.660	
	HANG SENG BANK LTD	19,600	197.900	3,878,840.000	
	WHEELOCK & CO LTD	20,000	57.650	1,153,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	149,000	11.860	1,767,140.000	
	WH GROUP LTD	222,500	6.960	1,548,600.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	29,400	255.600	7,514,640.000	
	MINTH GROUP LTD	18,000	37.150	668,700.000	
	LI & FUNG LTD	152,000	3.010	457,520.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	50,000	17.300	865,000.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	7,600	105.900	804,840.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	19,000	23.250	441,750.000	
	NWS HOLDINGS LTD	35,500	14.580	517,590.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	17,500	42.850	749,875.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	32,640	32.000	1,044,480.000	

HYSAN DEVELOPMENT CO	17,000	44.750	760,750.000	
SJM HOLDINGS LTD	47,000	10.340	485,980.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	28,800	30.850	888,480.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	63,669	65.650	4,179,869.850	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	16,000	59.100	945,600.000	
PCCW LTD	95,000	4.490	426,550.000	
AIA GROUP LTD	304,600	70.150	21,367,690.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	30,000	59.450	1,783,500.000	
SANDS CHINA LTD	60,400	45.250	2,733,100.000	
SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	16.680	500,400.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	33,000	47.250	1,559,250.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	23,600	21.150	499,140.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	92,000	39.800	3,661,600.000	
WYNN MACAU LTD	38,000	28.300	1,075,400.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 92,049,562.010 (1,297,898,824)	
合計			99,506,241,962 [99,506,241,962]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,447	579,716.460	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,687	1,261,052.350	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,750	449,550.000	
		GGP INC	16,700	346,191.000	
		VORNADO REALTY TRUST	4,047	291,141.180	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,850	447,450.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,850	564,187.500	
		EQUINIX INC	1,918	760,947.320	
		AMERICAN TOWER CORP	10,850	1,501,097.500	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	18,593	396,588.690	
		KIMCO REALTY CORP	10,000	165,300.000	
		INVITATION HOMES INC	7,400	165,908.000	
		VENTAS INC	8,700	473,367.000	
WEYERHAEUSER CO	18,264	680,516.640			

	AGNC INVESTMENT CORP	9,900	188,100.000	
	CROWN CASTLE INTL CORP	9,800	991,466.000	
	IRON MOUNTAIN INC	6,760	229,772.400	
	VEREIT INC	24,400	176,656.000	
	PROLOGIS INC	13,062	841,454.040	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,370	302,554.200	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,350	211,876.000	
	DUKE REALTY CORP	8,700	248,385.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,580	371,031.400	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,850	224,016.500	
	WELLTOWER INC	9,200	530,288.000	
	HCP INC	11,300	269,731.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,600	159,408.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,750	266,392.500	
	MACERICH CO/THE	2,900	162,748.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	28,100	295,612.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3,750	158,137.500	
	REALTY INCOME CORP	6,750	357,682.500	
	PUBLIC STORAGE	3,850	825,671.000	
	REGENCY CENTERS CORP	3,700	222,037.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,400	234,816.000	
	UDR INC	6,800	252,280.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	4,950	527,818.500	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,000	292,590.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 16,423,537.180 (1,817,757,095)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	18,062	172,257.290	
	SEGRO PLC	25,750	172,525.000	
	HAMMERSON PLC	19,200	102,796.800	
	BRITISH LAND CO PLC	23,400	161,928.000	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 609,507.090 (89,390,310)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	14,900	281,610.000	
	TRANSURBAN GROUP	55,400	660,368.000	

	SYDNEY AIRPORT	27,500	199,925.000	
	APA GROUP	29,200	280,612.000	
	SCENTRE GROUP	135,822	571,810.620	
	DEXUS	25,850	248,160.000	
	GPT GROUP	44,060	220,740.600	
	MIRVAC GROUP	91,400	203,822.000	
	STOCKLAND	61,500	255,225.000	
	GOODMAN GROUP	43,900	416,611.000	
	VICINITY CENTRES	83,173	219,576.720	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 3,558,460.940 (293,679,781)	
カナダ・ドル	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,500	45,345.000	カナダ・ドル
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,700	74,444.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,900	93,132.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 212,921.000 (17,955,628)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	60,100	98,564.000	シンガポール・ドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	62,500	163,750.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	63,200	128,296.000	
	SUNTEC REIT	63,000	107,100.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 497,710.000 (40,911,762)	
ユーロ	UNIBAIL GROUP STAPLED	3,460	662,590.000	ユーロ
	ICADE	800	65,760.000	
	GECINA SA	1,250	179,500.000	
	KLEPIERRE	5,650	188,597.000	
	COVIVIO	850	76,160.000	
ユーロ 小計			ユーロ 1,172,607.000 (149,976,436)	
香港・ドル	LINK REIT	54,500	3,891,300.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	64,500	480,525.000	

	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	99,000	991,980.000	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 5,363,805.000 (75,629,651)	
投資証券	合計		2,485,300,663 [2,485,300,663]	
合計			2,485,300,663 [2,485,300,663]	

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 599銘柄 投資証券 38銘柄	97.3%	2.7%	66.6%
イギリス・ポンド	株式 98銘柄 投資証券 4銘柄	98.8%	1.2%	7.1%
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 56銘柄 投資証券 11銘柄	89.0%	11.0%	2.6%
カナダ・ドル	株式 87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	92.2%	7.8%	0.5%
スイス・フラン	株式 38銘柄	100%	-%	3.0%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	100%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	100%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	0.3%
ユーロ	株式 240銘柄 投資証券 5銘柄	98.9%	1.1%	12.9%
香港・ドル	株式 39銘柄 投資証券 3銘柄	94.5%	5.5%	1.3%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成29年6月16日から平成30年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	3,764
コール・ローン	24,221	342,721
親投資信託受益証券	24,070,613	279,060,235
流動資産合計	24,094,834	279,406,720
資産合計	24,094,834	279,406,720
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	504	5,696
未払委託者報酬	6,579	71,668
その他未払費用	263	2,796
流動負債合計	7,346	80,160
負債合計	7,346	80,160
純資産の部		
元本等		
元本	1 23,931,206	1 275,900,547
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	156,282	3,426,013
（分配準備積立金）	87,489	621,868
元本等合計	24,087,488	279,326,560
純資産合計	24,087,488	279,326,560
負債純資産合計	24,094,834	279,406,720

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自	平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		94,835		457,069
営業収益合計		94,835		457,069
営業費用				
受託者報酬		504		6,977
委託者報酬		6,579		87,907
その他費用		263		3,345
営業費用合計		7,346		98,229
営業利益		87,489		358,840
経常利益		87,489		358,840
当期純利益		87,489		358,840
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		156,282
剰余金増加額又は欠損金減少額		68,793		2,910,891
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		68,793		2,910,891
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		156,282		3,426,013

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	23,931,206円
期中追加設定元本額	22,931,206円	251,969,341円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	23,931,206口	275,900,547口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15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(46,922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(40,567円)、投資信託約款に規定される収益調整金(68,793円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は156,282円(1万口当たり65.30円)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(534,379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(2,804,145円)及び分配準備積立金(87,489円)より分配対象額は3,426,013円(1万口当たり124.18円)であり、分配を行っておりません。
------------	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15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、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期
	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15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	94,835	457,021
合計	94,835	457,021

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期	第2期
平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期
自 平成29年6月16日
至 平成30年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0065円 (10,065円)	1.0124円 (10,124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	日本債券インデックスマザーファンド	199,030,194	279,060,235	
親投資信託受益証券 合計			279,060,235	
合計			279,060,235	

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、「日本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。

「日本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6月15日現在	平成30年6月15日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

金銭信託	-	2,590,675
コール・ローン	294,593,535	235,888,930
国債証券	51,904,909,350	62,694,390,280
地方債証券	4,320,396,100	4,460,002,450
特殊債券	3,562,978,306	3,338,374,600
社債券	3,525,861,500	3,606,957,200
未収利息	190,882,739	208,511,175
前払費用	10,346,174	6,324,909
流動資産合計	63,809,967,704	74,553,040,219
資産合計	63,809,967,704	74,553,040,219
負債の部		
流動負債		
未払金	131,557,840	-
未払解約金	20,330,508	71,156,514
その他未払費用	-	3,891
流動負債合計	151,888,348	71,160,405
負債合計	151,888,348	71,160,405
純資産の部		
元本等		
元本	1 45,733,895,667	53,122,088,329
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,924,183,689	21,359,791,485
元本等合計	63,658,079,356	74,481,879,814
純資産合計	63,658,079,356	74,481,879,814
負債純資産合計	63,809,967,704	74,553,040,219

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16日 至 平成30年6月15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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首	平成29年2月16日	平成29年6月16日
期首元本額	40,462,907,932円	45,733,895,667円
期中追加設定元本額	6,329,429,775円	14,320,084,238円
期中一部解約元本額	1,058,442,040円	6,931,891,576円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	183,717,925円	144,466,105円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,218,679,460円	930,933,526円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	135,996,674円	111,826,913円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,843,420,822円	1,283,693,789円
D-I's 日本債券インデックス	764,175円	761,060円
DCダイワ日本債券インデックス	4,821,035,911円	5,457,745,439円
ダイワ・バランスファンド35VA	14,966,447,020円	13,867,768,482円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	2,379,460,793円	2,269,479,451円

ダイワ国内バランスファンド 25VA（適格機関投資家専用）	315,318,660円	312,147,523円
ダイワ国内バランスファンド 30VA（適格機関投資家専用）	431,261,541円	416,966,702円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	50,313,634円	56,296,878円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	10,226,323,913円	17,898,814,500円
ダイワ日本債券インデックス （ダイワSMA専用）	17,293,350円	199,030,194円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	361,782,302円	1,453,404,501円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,113,105,829円	1,305,882,033円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,662,138,794円	6,333,134,398円
ダイワライフスタイル25	436,558,332円	451,884,199円
ダイワライフスタイル50	450,696,236円	489,448,250円
ダイワライフスタイル75	119,580,296円	138,404,386円
計	45,733,895,667円	53,122,088,329円
2. 期末日における受益権の総数	45,733,895,667口	53,122,088,329口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15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。
--------------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年6月15日現在	平成30年6月15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	528,616,830	112,073,410
地方債証券	25,985,000	8,139,750
特殊債券	23,911,515	5,579,100
社債券	9,695,300	7,687,100
合計	588,208,645	90,667,460

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成28年12月1日から平成29年6月15日まで、及び平成29年12月1日から平成30年6月15日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.3919円	1.4021円

(1万口当たり純資産額)	(13,919円)	(14,021円)
--------------	-----------	-----------

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 7 8 2年国債	100,000,000	100,258,000	
	3 8 0 2年国債	330,000,000	330,986,700	
	3 8 2 2年国債	250,000,000	250,847,500	
	3 8 3 2年国債	530,000,000	531,902,700	
	3 8 5 2年国債	500,000,000	502,000,000	
	1 2 0 5年国債	180,000,000	180,770,400	
	1 2 1 5年国債	550,000,000	551,661,000	
	1 2 2 5年国債	630,000,000	632,230,200	
	1 2 3 5年国債	730,000,000	732,949,200	
	1 2 4 5年国債	980,000,000	984,527,600	
	1 2 5 5年国債	860,000,000	864,472,000	
	1 2 6 5年国債	890,000,000	895,144,200	
	1 2 7 5年国債	780,000,000	784,953,000	
	1 2 8 5年国債	755,000,000	760,118,900	
	1 2 9 5年国債	880,000,000	886,327,200	
	1 3 0 5年国債	980,000,000	987,585,200	
	1 3 1 5年国債	920,000,000	927,626,800	
	1 3 2 5年国債	580,000,000	585,133,000	
	1 3 3 5年国債	250,000,000	252,352,500	
	1 3 4 5年国債	510,000,000	515,079,600	
	1 3 5 5年国債	600,000,000	606,162,000	
	1 4 0年国債	70,000,000	101,553,900	
	2 4 0年国債	116,000,000	162,917,360	
	3 4 0年国債	74,000,000	104,464,320	
	4 4 0年国債	107,000,000	151,581,550	
	5 4 0年国債	125,000,000	170,296,250	
	6 4 0年国債	105,000,000	140,220,150	
	7 4 0年国債	121,000,000	154,496,430	
8 4 0年国債	230,000,000	272,287,800		

9	40年国債	220,000,000	189,002,000	
10	40年国債	375,000,000	381,577,500	
11	40年国債	60,000,000	58,846,200	
303	10年国債	60,000,000	61,164,000	
304	10年国債	110,000,000	111,995,400	
305	10年国債	500,000,000	510,830,000	
306	10年国債	255,000,000	261,877,350	
307	10年国債	400,000,000	410,088,000	
308	10年国債	200,000,000	205,770,000	
309	10年国債	90,000,000	92,234,700	
310	10年国債	130,000,000	133,341,000	
311	10年国債	150,000,000	153,175,500	
312	10年国債	395,000,000	408,264,100	
313	10年国債	200,000,000	207,902,000	
314	10年国債	260,000,000	268,834,800	
315	10年国債	221,000,000	229,833,370	
316	10年国債	250,000,000	259,237,500	
317	10年国債	214,000,000	222,536,460	
318	10年国債	200,000,000	207,324,000	
319	10年国債	100,000,000	104,278,000	
320	10年国債	230,000,000	239,027,500	
321	10年国債	175,000,000	182,355,250	
322	10年国債	130,000,000	134,973,800	
324	10年国債	410,000,000	425,092,100	
325	10年国債	310,000,000	322,133,400	
326	10年国債	30,000,000	31,107,600	
327	10年国債	450,000,000	468,652,500	
328	10年国債	550,000,000	568,656,000	
329	10年国債	500,000,000	522,765,000	
330	10年国債	312,000,000	326,838,720	
331	10年国債	365,000,000	378,501,350	
332	10年国債	310,000,000	321,835,800	
333	10年国債	640,000,000	665,344,000	
334	10年国債	600,000,000	624,618,000	
335	10年国債	780,000,000	808,197,000	
336	10年国債	275,000,000	285,243,750	
337	10年国債	300,000,000	307,254,000	
338	10年国債	490,000,000	505,454,600	
339	10年国債	380,000,000	392,156,200	

3 4 0	1 0 年国債	770,000,000	795,525,500	
3 4 1	1 0 年国債	520,000,000	533,712,400	
3 4 2	1 0 年国債	780,000,000	788,798,400	
3 4 3	1 0 年国債	800,000,000	808,664,000	
3 4 4	1 0 年国債	640,000,000	646,617,600	
3 4 5	1 0 年国債	590,000,000	595,776,100	
3 4 6	1 0 年国債	750,000,000	756,892,500	
3 4 7	1 0 年国債	250,000,000	252,137,500	
3 4 8	1 0 年国債	600,000,000	604,992,000	
3 4 9	1 0 年国債	650,000,000	654,933,500	
3 5 0	1 0 年国債	650,000,000	654,420,000	
1	3 0 年国債	16,000,000	20,843,840	
2	3 0 年国債	24,000,000	30,336,000	
3	3 0 年国債	30,000,000	37,686,000	
4	3 0 年国債	36,000,000	48,163,320	
5	3 0 年国債	28,000,000	35,230,720	
6	3 0 年国債	24,000,000	31,004,160	
7	3 0 年国債	55,000,000	70,690,400	
8	3 0 年国債	27,000,000	32,966,460	
9	3 0 年国債	43,000,000	50,097,580	
1 0	3 0 年国債	45,000,000	50,478,300	
1 1	3 0 年国債	40,000,000	48,423,200	
1 2	3 0 年国債	60,000,000	76,257,000	
1 3	3 0 年国債	75,000,000	94,311,000	
1 4	3 0 年国債	82,000,000	108,310,520	
1 5	3 0 年国債	100,000,000	133,905,000	
1 6	3 0 年国債	100,000,000	134,207,000	
1 7	3 0 年国債	80,000,000	106,339,200	
1 8	3 0 年国債	80,000,000	105,270,400	
1 9	3 0 年国債	57,000,000	75,140,820	
2 0	3 0 年国債	60,000,000	81,192,000	
2 1	3 0 年国債	60,000,000	79,300,200	
2 2	3 0 年国債	70,000,000	95,155,200	
2 3	3 0 年国債	60,000,000	81,711,600	
2 4	3 0 年国債	92,000,000	125,512,840	
2 5	3 0 年国債	150,000,000	199,452,000	
2 6	3 0 年国債	180,000,000	242,800,200	
2 7	3 0 年国債	150,000,000	205,770,000	
2 8	3 0 年国債	170,000,000	233,857,100	

2 9	3 0 年国債	200,000,000	272,404,000	
3 0	3 0 年国債	220,000,000	296,406,000	
3 1	3 0 年国債	180,000,000	239,718,600	
3 2	3 0 年国債	235,000,000	318,927,900	
3 3	3 0 年国債	261,000,000	339,070,320	
3 4	3 0 年国債	233,000,000	313,280,150	
3 5	3 0 年国債	270,000,000	352,177,200	
3 6	3 0 年国債	270,000,000	352,989,900	
3 7	3 0 年国債	290,000,000	373,786,800	
3 8	3 0 年国債	170,000,000	215,826,900	
3 9	3 0 年国債	172,000,000	222,552,520	
4 0	3 0 年国債	140,000,000	178,019,800	
4 1	3 0 年国債	170,000,000	212,306,200	
4 2	3 0 年国債	146,000,000	182,434,300	
4 3	3 0 年国債	160,000,000	200,041,600	
4 4	3 0 年国債	165,000,000	206,405,100	
4 5	3 0 年国債	200,000,000	240,614,000	
4 6	3 0 年国債	180,000,000	216,595,800	
4 7	3 0 年国債	190,000,000	233,612,600	
4 8	3 0 年国債	190,000,000	224,293,100	
4 9	3 0 年国債	93,000,000	109,787,430	
5 0	3 0 年国債	215,000,000	221,280,150	
5 1	3 0 年国債	210,000,000	189,222,600	
5 2	3 0 年国債	235,000,000	223,383,950	
5 3	3 0 年国債	195,000,000	190,138,650	
5 4	3 0 年国債	218,000,000	223,753,020	
5 5	3 0 年国債	200,000,000	205,068,000	
5 6	3 0 年国債	210,000,000	215,098,800	
5 7	3 0 年国債	200,000,000	204,640,000	
5 8	3 0 年国債	220,000,000	224,862,000	
4 3	2 0 年国債	100,000,000	103,829,000	
4 4	2 0 年国債	85,000,000	88,936,350	
4 5	2 0 年国債	78,000,000	81,474,900	
4 6	2 0 年国債	73,000,000	76,436,840	
4 7	2 0 年国債	89,000,000	93,700,090	
4 8	2 0 年国債	54,000,000	57,575,340	
4 9	2 0 年国債	64,000,000	67,960,960	
5 0	2 0 年国債	107,000,000	113,029,450	
5 1	2 0 年国債	82,000,000	87,274,240	

5 2	2 0 年国債	52,000,000	55,787,160	
5 3	2 0 年国債	66,000,000	71,147,340	
5 4	2 0 年国債	65,000,000	70,298,150	
5 5	2 0 年国債	140,000,000	151,169,200	
5 8	2 0 年国債	200,000,000	217,194,000	
5 9	2 0 年国債	45,000,000	48,689,100	
6 0	2 0 年国債	10,000,000	10,683,900	
6 1	2 0 年国債	100,000,000	105,304,000	
6 2	2 0 年国債	95,000,000	99,325,350	
6 3	2 0 年国債	130,000,000	142,460,500	
6 4	2 0 年国債	90,000,000	99,486,900	
6 5	2 0 年国債	175,000,000	194,272,750	
6 6	2 0 年国債	135,000,000	149,119,650	
6 7	2 0 年国債	55,000,000	61,294,200	
6 8	2 0 年国債	120,000,000	135,813,600	
6 9	2 0 年国債	110,000,000	123,860,000	
7 0	2 0 年国債	83,000,000	95,420,950	
7 1	2 0 年国債	125,000,000	142,197,500	
7 2	2 0 年国債	175,000,000	198,929,500	
7 3	2 0 年国債	120,000,000	136,236,000	
7 4	2 0 年国債	73,000,000	83,354,320	
7 5	2 0 年国債	80,000,000	91,748,000	
7 6	2 0 年国債	51,000,000	57,797,280	
7 7	2 0 年国債	130,000,000	148,209,100	
7 8	2 0 年国債	61,000,000	69,386,280	
7 9	2 0 年国債	50,000,000	57,225,500	
8 0	2 0 年国債	53,000,000	61,032,150	
8 1	2 0 年国債	76,000,000	87,348,320	
8 2	2 0 年国債	87,000,000	100,624,200	
8 3	2 0 年国債	93,000,000	108,025,080	
8 5	2 0 年国債	58,000,000	67,679,620	
8 6	2 0 年国債	80,000,000	94,596,000	
8 7	2 0 年国債	55,000,000	64,606,850	
8 8	2 0 年国債	100,000,000	118,745,000	
8 9	2 0 年国債	78,000,000	91,994,760	
9 0	2 0 年国債	20,000,000	23,682,200	
9 1	2 0 年国債	60,000,000	71,542,800	
9 2	2 0 年国債	310,000,000	365,843,400	
9 3	2 0 年国債	100,000,000	117,558,000	

9 4	2 0 年国債	130,000,000	153,964,200	
9 5	2 0 年国債	50,000,000	60,329,000	
9 6	2 0 年国債	55,000,000	65,371,350	
9 7	2 0 年国債	40,000,000	48,102,000	
9 8	2 0 年国債	120,000,000	143,196,000	
9 9	2 0 年国債	250,000,000	299,340,000	
1 0 0	2 0 年国債	155,000,000	187,709,650	
1 0 1	2 0 年国債	75,000,000	92,286,000	
1 0 2	2 0 年国債	80,000,000	98,814,400	
1 0 3	2 0 年国債	70,000,000	85,765,400	
1 0 4	2 0 年国債	10,000,000	12,052,900	
1 0 5	2 0 年国債	126,000,000	152,359,200	
1 0 6	2 0 年国債	150,000,000	182,911,500	
1 0 7	2 0 年国債	27,000,000	32,750,730	
1 0 8	2 0 年国債	177,000,000	211,003,470	
1 0 9	2 0 年国債	35,000,000	41,813,450	
1 1 0	2 0 年国債	130,000,000	158,081,300	
1 1 1	2 0 年国債	130,000,000	159,978,000	
1 1 2	2 0 年国債	170,000,000	207,349,000	
1 1 3	2 0 年国債	250,000,000	305,830,000	
1 1 4	2 0 年国債	130,000,000	159,576,300	
1 1 5	2 0 年国債	180,000,000	223,000,200	
1 1 6	2 0 年国債	140,000,000	173,951,400	
1 1 7	2 0 年国債	215,000,000	264,643,500	
1 1 8	2 0 年国債	95,000,000	116,136,550	
1 1 9	2 0 年国債	93,000,000	111,490,260	
1 2 0	2 0 年国債	210,000,000	246,781,500	
1 2 1	2 0 年国債	135,000,000	163,829,250	
1 2 2	2 0 年国債	160,000,000	192,238,400	
1 2 3	2 0 年国債	140,000,000	173,727,400	
1 2 4	2 0 年国債	193,000,000	237,123,660	
1 2 5	2 0 年国債	85,000,000	106,872,200	
1 2 6	2 0 年国債	110,000,000	135,465,000	
1 2 7	2 0 年国債	165,000,000	201,133,350	
1 2 8	2 0 年国債	119,000,000	145,379,920	
1 2 9	2 0 年国債	200,000,000	241,788,000	
1 3 0	2 0 年国債	140,000,000	169,586,200	
1 3 1	2 0 年国債	80,000,000	95,868,800	
1 3 2	2 0 年国債	120,000,000	144,051,600	

1 3 3	2 0 年国債	210,000,000	254,858,100	
1 3 4	2 0 年国債	80,000,000	97,263,200	
1 3 5	2 0 年国債	92,000,000	110,618,960	
1 3 6	2 0 年国債	185,000,000	219,961,300	
1 3 7	2 0 年国債	70,000,000	84,247,100	
1 3 8	2 0 年国債	87,000,000	102,338,100	
1 3 9	2 0 年国債	185,000,000	220,135,200	
1 4 0	2 0 年国債	335,000,000	403,815,700	
1 4 1	2 0 年国債	170,000,000	205,225,700	
1 4 2	2 0 年国債	200,000,000	244,422,000	
1 4 3	2 0 年国債	210,000,000	250,693,800	
1 4 4	2 0 年国債	120,000,000	141,543,600	
1 4 5	2 0 年国債	320,000,000	387,385,600	
1 4 6	2 0 年国債	230,000,000	278,603,600	
1 4 7	2 0 年国債	250,000,000	299,487,500	
1 4 8	2 0 年国債	300,000,000	354,951,000	
1 4 9	2 0 年国債	252,000,000	298,410,840	
1 5 0	2 0 年国債	320,000,000	373,984,000	
1 5 1	2 0 年国債	300,000,000	341,124,000	
1 5 2	2 0 年国債	350,000,000	398,023,500	
1 5 3	2 0 年国債	380,000,000	438,292,000	
1 5 4	2 0 年国債	330,000,000	375,038,400	
1 5 5	2 0 年国債	240,000,000	264,640,800	
1 5 6	2 0 年国債	330,000,000	329,726,100	
1 5 7	2 0 年国債	360,000,000	346,449,600	
1 5 8	2 0 年国債	100,000,000	101,270,000	
1 5 9	2 0 年国債	230,000,000	236,499,800	
1 6 0	2 0 年国債	220,000,000	229,708,600	
1 6 1	2 0 年国債	290,000,000	297,093,400	
1 6 2	2 0 年国債	300,000,000	306,615,000	
1 6 3	2 0 年国債	290,000,000	295,942,100	
1 6 4	2 0 年国債	310,000,000	310,000,000	
2 7	メキシコ国債	100,000,000	99,662,000	
国債証券 合計			62,694,390,280	
地方債証券	6 8 8 東京都公債	100,000,000	102,110,800	
	6 9 9 東京都公債	100,000,000	103,238,900	
	7 1 3 東京都公債	100,000,000	103,183,300	
	7 5 1 東京都公債	100,000,000	102,020,800	
	1 6 東京都 2 0 年	100,000,000	118,713,600	

2 4 - 1	北海道公債	100,000,000	103,670,700	
2 4 - 6	北海道公債	100,000,000	103,363,100	
3 1	神奈川県 2 0 年	100,000,000	108,101,900	
3 6 1	大阪府公債	100,000,000	103,549,700	
4 2 0	大阪府公債	200,000,000	199,813,200	
2 2 - 5	京都府公債	100,000,000	103,151,400	
2 4 - 5	京都府公債	100,000,000	103,370,000	
2 6 - 1 7	兵庫県公債	100,000,000	102,329,600	
3	兵庫県公債 1 2 年	200,000,000	206,083,600	
1 9	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	116,754,100	
2 6 - 1 0	静岡県公債	100,000,000	102,783,200	
2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	103,345,100	
4	埼玉県 3 0 年	100,000,000	112,731,800	
2 9 - 1	福岡県公債	100,000,000	100,312,000	
2 1 - 6	千葉県公債	100,000,000	101,787,300	
1 6	千葉県 2 0 年	100,000,000	116,743,100	
7 6	共同発行地方	50,000,000	50,769,950	
8 1	共同発行地方	100,000,000	101,994,500	
9 0	共同発行地方	100,000,000	102,529,600	
1 0 8	共同発行地方	100,000,000	103,699,500	
1 1 7	共同発行地方	100,000,000	103,123,300	
1 2 6	共同発行地方	100,000,000	104,001,800	
1 3 1	共同発行地方	100,000,000	103,390,100	
2 3 - 2	島根県公債	100,000,000	103,452,200	
2 5 - 6	大阪市公債	200,000,000	206,907,000	
4 7 1	名古屋市債	100,000,000	102,527,100	
2 1 - 5	京都市公債	100,000,000	102,445,600	
2 0 - 1	神戸市 2 0 年	100,000,000	121,577,800	
2 4 - 1 0	神戸市公債	100,000,000	103,332,700	
2 4 - 3	横浜市公債	100,000,000	103,163,900	
2 4 - 5	札幌市公債	100,000,000	103,211,200	
2 3 - 4	福岡市 2 0 年	100,000,000	120,080,100	
2 1 - 3	広島市公債	100,000,000	102,025,100	
2 4 - 4	福井県公債	100,000,000	102,053,300	
2 2 - 1	岡山県公債	100,000,000	102,560,500	
地方債証券 合計			4,460,002,450	
特殊債券	1 9	政保政策投資 C	100,000,000	103,172,600
	6 1	道路機構	100,000,000	102,448,200
	8 1	道路機構	100,000,000	103,456,800

8 6	政保道路機構	100,000,000	119,982,600	
1 1 0	政保道路機構	100,000,000	102,665,900	
1 6 8	政保道路機構	100,000,000	103,478,400	
1 7 3	政保道路機構	100,000,000	103,547,200	
1 7 5	政保道路機構	100,000,000	103,499,300	
1 8 6	政保道路機構	100,000,000	103,170,800	
1 9 0	政保道路機構	100,000,000	103,009,800	
2 2 3	政保道路機構	100,000,000	116,248,200	
2 3 6	政保道路機構	100,000,000	101,889,200	
2 6 1	政保道路機構	200,000,000	204,965,400	
2 8 4	政保道路機構	200,000,000	188,520,800	
3	公営企業 1 5 年	100,000,000	106,456,400	
1 3	地方公共団体	100,000,000	102,548,700	
2 9	地方公共団体	100,000,000	103,304,400	
3 3	地方公共団体	100,000,000	103,659,800	
3 9	政保地方公共団	100,000,000	103,368,000	
F 1 4 3	地方公共団体	100,000,000	110,546,400	
1	地方公共団 1 5 年	100,000,000	110,747,000	
4 8	地方公共団体	100,000,000	103,680,000	
5 1	地方公共団体	100,000,000	103,965,400	
3 1	地方公共団 2 0	100,000,000	118,917,100	
1 4	政保地方公共 6	100,000,000	100,417,700	
6 5	地方公共団体	100,000,000	102,694,800	
7 1	地方公共団体	100,000,000	102,295,200	
2 5	日本政策金融	100,000,000	103,679,300	
2 5	政保日本政策	100,000,000	103,833,400	
1 9	利付商工債	100,000,000	98,205,800	
特殊債券 合計			3,338,374,600	
社債券	2 0	成田国際空港	100,000,000	99,283,000
	1 7	シテイグループ・インク	100,000,000	104,287,000
	8	ドイツ銀行 A G ロンドン	100,000,000	99,705,300
	9	A U S T ・ N Z 銀行	100,000,000	100,401,100
	2 9	東日本高速道	100,000,000	100,268,900
	2 1	西日本高速道	100,000,000	103,433,800
	1 2	アサヒグループ H D	100,000,000	100,279,200
	5	野村不動産 H D	100,000,000	103,748,500
	1 1	セブンアンドアイ	100,000,000	101,699,700
	1 4	武田薬品	100,000,000	100,502,800
	4	J X ホールディングス	100,000,000	104,511,500

2 4	太平洋セメント	100,000,000	100,310,200	
1 7	パナソニック	100,000,000	101,101,300	
1 5	デンソー	100,000,000	99,852,100	
1	三菱UFJFG 劣後	100,000,000	103,400,500	
2 0	東京三菱銀行	100,000,000	105,395,600	
9	三菱UFJ信託BK劣	100,000,000	104,462,700	
1 1	三菱UFJ信託BK	100,000,000	104,741,200	
2 0	三井住友BK劣	100,000,000	102,388,400	
1 5	トヨタファイナンス	100,000,000	103,866,900	
7 8	トヨタファイナンス	100,000,000	99,935,100	
2	イオンFS	100,000,000	100,532,100	
1 6 4	オリックス	100,000,000	101,250,100	
1 7 5	オリックス	100,000,000	104,360,500	
4 4	野村ホールディング	100,000,000	101,543,300	
6 2	東日本旅客鉄道	100,000,000	101,786,900	
7 2	東日本旅客鉄道	100,000,000	103,111,400	
1 0 7	東日本旅客鉄	100,000,000	113,408,700	
4 1	東海旅客鉄道	100,000,000	119,634,400	
5 0 9	関西電力	100,000,000	100,654,700	
3 7 2	中国電力	100,000,000	104,681,300	
2 6 0	北陸電力	100,000,000	104,505,600	
4 2 3	九州電力	100,000,000	101,207,800	
3 0	大阪瓦斯	100,000,000	103,034,300	
4	ファーストリテイリング	100,000,000	103,671,300	
社債券 合計			3,606,957,200	
合計			74,099,724,530	

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。

【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成29年6月16日から平成30年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	28,909
コール・ローン	20,521	2,632,261
親投資信託受益証券	20,270,996	1,397,567,482
流動資産合計	20,291,517	1,400,228,652
資産合計		
20,291,517		
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	834	75,887
未払委託者報酬	15,694	1,366,673
その他未払費用	332	28,417
流動負債合計	16,860	1,470,977
負債合計		
16,860		
純資産の部		
元本等		
元本	1 19,852,947	1 1,403,467,254
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 421,710	2 4,709,579
（分配準備積立金）	274,658	8,026,527
元本等合計	20,274,657	1,398,757,675
純資産合計		
20,274,657		
負債純資産合計		
20,291,517		

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自	平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		291,518		5,990,644
営業収益合計		291,518		5,990,644
営業費用				
支払利息		-		270
受託者報酬		834		78,063
委託者報酬		15,694		1,405,825
その他費用		332		29,166
営業費用合計		16,860		1,513,324
営業利益又は営業損失（ ）		274,658		7,503,968
経常利益又は経常損失（ ）		274,658		7,503,968
当期純利益又は当期純損失（ ）		274,658		7,503,968
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		421,710
剰余金増加額又は欠損金減少額		147,052		2,372,679
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		147,052		2,372,679
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		421,710		4,709,579

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	19,852,947円
期中追加設定元本額	18,852,947円	1,383,614,307円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	19,852,947口	1,403,467,254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4,709,579円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(94,203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(180,455円)、投資信託約款に規定される収益調整金(147,052円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は421,710円(1万口当たり212.42円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,751,869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(23,894,920円)及び分配準備積立金(274,658円)より分配対象額は31,921,447円(1万口当たり227.45円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	<p style="text-align: center;">第2期</p> <p style="text-align: center;">自 平成29年6月16日</p> <p style="text-align: center;">至 平成30年6月15日</p>
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期
	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15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	291,518	5,989,987
合計	291,518	5,989,987

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期	第2期
平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期
自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0212円 (10,212円)	0.9966円 (9,966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	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	1,464,801,889	1,397,567,482	
親投資信託受益証券 合計			1,397,567,482	
合計			1,397,567,482	

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、「外国債券インデックス(為替ヘッジあり)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。

「外国債券インデックス(為替ヘッジあり)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6月15日現在	平成30年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	114,672,896	284,212,058
金銭信託	-	32,356,713
コール・ローン	1,409,220,758	2,946,177,671
国債証券	32,433,686,304	62,822,098,221
派生商品評価勘定	301,875,857	28,448,168
未収利息	184,791,560	420,542,318
前払費用	83,164,813	54,845,725
差入委託証拠金	67,362,570	68,896,960
流動資産合計	34,594,774,758	66,657,577,834
資産合計	34,594,774,758	66,657,577,834
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	33,969,108	856,003,067
その他未払費用	-	24,246
流動負債合計	33,969,108	856,027,313
負債合計	33,969,108	856,027,313
純資産の部		
元本等		
元本	1 35,493,735,600	68,969,365,389
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 932,929,950	3,167,814,868
元本等合計	34,560,805,650	65,801,550,521
純資産合計	34,560,805,650	65,801,550,521
負債純資産合計	34,594,774,758	66,657,577,834

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16日 至 平成30年6月15日
-----	------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 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6月15日現在	平成30年6月15日現在
-----	--------------	--------------

1.	1 期首	平成29年2月16日	平成29年6月16日
	期首元本額	20,898,069,566円	35,493,735,600円
	期中追加設定元本額	14,745,200,020円	37,519,095,983円
	期中一部解約元本額	149,533,986円	4,043,466,194円
	期末元本額の内訳		
	ファンド名		
	ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジあり)	34,623,272,579円	64,035,275,304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 (為替ヘッジあり)	849,644,497円	3,469,288,196円
	ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ダイワ SMA専用)	20,818,524円	1,464,801,889円
	計	35,493,735,600円	68,969,365,389円
2.	期末日における受益権の総数	35,493,735,600口	68,969,365,389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932,929,950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3,167,814,868円であり ます。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用 の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
--	--------------	--------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	183,518,037	1,620,326,653
合計	183,518,037	1,620,326,653

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成28年9月26日から平成29年6月15日まで、及び平成29年6月16日から平成30年6月15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. 債券関連

種 類	平成29年6月15日 現在				平成30年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
債券先物取引								
買 建	1,362,685,934	-	1,367,870,066	5,184,132	1,379,467,016	-	1,382,383,171	2,916,155
合計	1,362,685,934	-	1,367,870,066	5,184,132	1,379,467,016	-	1,382,383,171	2,916,155

(注) 1. 時価の算定方法

債券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。

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

2. 通貨関連

種 類	平成29年6月15日 現在				平成30年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								

為替予約取引								
売 建	32,959,674,657	-	32,696,952,040	262,722,617	62,918,624,746	-	63,749,095,800	830,471,054
アメリカ・ドル	14,496,531,010	-	14,390,480,000	106,051,010	27,240,290,248	-	27,771,494,530	531,204,282
イギリス・ ポンド	2,419,796,610	-	2,371,885,740	47,910,870	4,503,775,286	-	4,569,338,340	65,563,054
オーストラリ ア・ドル	701,380,477	-	709,934,700	8,554,223	1,364,464,868	-	1,370,891,860	6,426,992
カナダ・ドル	676,713,084	-	685,335,420	8,622,336	1,414,734,319	-	1,424,666,220	9,931,901
シンガポー ル・ドル	122,951,598	-	122,661,000	290,598	250,268,736	-	253,360,600	3,091,864
スイス・フラン	50,438,272	-	49,837,410	600,862	92,555,627	-	92,865,150	309,523
スウェーデ ン・クローナ	133,661,048	-	132,165,410	1,495,638	250,277,496	-	257,084,960	6,807,464
デンマーク・ クローネ	200,884,892	-	198,951,840	1,933,052	352,938,868	-	355,556,360	2,617,492
ノルウェー・ クローネ	89,512,605	-	88,793,250	719,355	190,273,514	-	194,805,100	4,531,586
ポーランド・ ズロチ	206,480,388	-	203,916,980	2,563,408	407,585,909	-	414,309,400	6,723,491
マレーシア・ リングギット	104,694,930	-	104,490,000	204,930	278,648,216	-	283,686,480	5,038,264
メキシコ・ ペソ	283,599,744	-	293,785,600	10,185,856	482,197,808	-	471,812,560	10,385,248
ユーロ	13,308,318,959	-	13,173,470,640	134,848,319	25,723,592,209	-	25,936,968,900	213,376,691
南アフリカ・ ランド	164,711,040	-	171,244,050	6,533,010	367,021,642	-	352,255,340	14,766,302
合計	32,959,674,657	-	32,696,952,040	262,722,617	62,918,624,746	-	63,749,095,800	830,471,054

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9737円 (9,737円)	0.9541円 (9,541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	2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	アメリカ・ドル 25,370,000.000	アメリカ・ドル 25,359,090.900	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	10,040,000.000	10,287,385.600	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	11,946,000.000	11,659,415.460	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,700,000.000	6,374,648.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	7,950,000.000	7,782,573.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	11,020,000.000	10,481,011.800	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	7,540,000.000	7,433,912.200	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	3,310,000.000	3,257,238.600	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,905,000.000	5,877,305.550	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	10,580,000.000	10,363,427.400	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	4,990,000.000	4,906,567.200	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	2,250,000.000	2,836,912.500	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	3,000,000.000	3,986,250.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,130,000.000	1,416,466.300	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,250,000.000	1,511,225.000	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	3,330,000.000	3,581,548.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	410,000.000	497,252.100	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	350,000.000	439,029.500	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	670,000.000	857,546.400	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,970,000.000	3,008,045.700	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	8,210,000.000	7,945,720.100	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	1,208,449.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	332,000.000	372,148.760	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	2,600,000.000	2,745,210.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,190,000.000	3,226,110.800	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	12,440,000.000	12,274,174.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	9,810,000.000	9,438,985.800	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	13,150,000.000	12,681,465.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,570,000.000	1,552,086.300	

	2% United States Treasury Note/Bond 20250815	12,320,000.000	11,591,272.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	16,720,000.000	16,013,245.600	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	3,900,000.000	3,724,773.000	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	2,000,000.000	1,820,300.000	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	1,165,000.000	1,057,691.850	
	2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,070,000.000	1,850,704.200	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	1,000,000.000	895,850.000	
	2% United States Treasury Note/Bond 20261115	2,350,000.000	2,185,312.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	2,480,000.000	2,389,108.000	
	1% United States Treasury Note/Bond 20191115	10,500,000.000	10,282,125.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,120,000.000	4,849,152.000	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315	5,500,000.000	5,412,550.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	1,850,000.000	1,767,749.000	
	3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,250,000.000	2,222,032.500	
	2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	6,310,000.000	5,923,007.700	
	3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	2,200,000.000	2,225,256.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 247,571,331.320 (27,401,194,950)	
イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	750,000.000	イギリス・ポンド 793,395.000	

1.5% United Kingdom Gilt 20210122	1,300,000.000	1,325,051.000	
2.5% United Kingdom Gilt 20650722	910,000.000	1,193,920.000	
1.5% United Kingdom Gilt 20260722	525,000.000	534,471.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20220722	250,000.000	245,790.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	850,000.000	840,981.500	
6% United Kingdom Gilt 20281207	863,000.000	1,248,070.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	350,000.000	465,885.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	675,000.000	843,716.250	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,165,000.000	1,618,185.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,090,000.000	1,167,052.100	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	620,000.000	963,914.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	411,000.000	633,844.200	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	1,238,374.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,893,000.000	3,050,758.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,430,000.000	2,063,776.000	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,040,000.000	1,161,336.800	
3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,045,000.000	1,085,065.300	
4% United Kingdom Gilt 20600122	787,000.000	1,361,352.600	
3.75% United Kingdom Gilt 20200907	810,000.000	864,788.400	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	742,000.000	811,770.260	

	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	580,000.000	599,766.400	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,425,000.000	1,853,925.000	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,290,000.000	1,369,283.400	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	748,900.000	1,251,861.240	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	300,000.000	329,304.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,290,000.000	1,759,947.000	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 30,675,585.350 (4,498,881,347)	
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	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,770,000.000	1,949,778.900	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	800,000.000	835,168.000	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,080,000.000	1,226,577.600	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,383,000.000	1,581,100.920	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,089,000.000	1,265,505.120	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	656,000.000	665,689.120	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	920,000.000	964,390.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,200,000.000	1,251,060.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	859,000.000	1,023,026.050	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	998,000.000	1,111,442.660	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	300,000.000	302,961.000	

	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	796,042.750	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	400,000.000	396,752.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	684,000.000	697,043.880	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,158,000.000	2,069,651.480	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	275,000.000	262,982.500	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 16,399,171.980 (1,353,423,664)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	460,000.000	524,073.400	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	707,000.000	942,735.010	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	250,000.000	358,115.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	668,000.000	941,171.920	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	170,000.000	220,394.800	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	5,820,000.000	5,992,679.400	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	400,000.000	409,936.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	880,000.000	1,091,068.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,238,000.000	1,200,439.080	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	230,000.000	233,873.200	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	592,000.000	592,781.440	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	320,000.000	302,652.800	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,959,000.000	1,880,013.120	

	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	834,898.200	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,240,000.000	1,170,522.800	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 16,695,354.170 (1,407,919,217)	
シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	203,000.000	218,468.600	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	125,000.000	125,861.250	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	150,000.000	155,280.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	300,000.000	305,250.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	390,000.000	392,028.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	89,000.000	86,063.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	200,000.000	204,448.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	120,000.000	127,725.600	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	300,000.000	299,277.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	398,400.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	330,000.000	317,862.600	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	60,000.000	54,591.600	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 2,685,255.650 (220,728,014)	
スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	282,000.000	393,051.600	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	120,000.000	127,650.000	

	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	150,000.000	161,911.500	
スイス・フラン	小計		スイス・フラン 682,613.100 (75,715,445)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	2,780,000.000	3,165,141.200	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	1,920,000.000	2,715,417.600	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	2,950,000.000	3,393,857.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	2,150,000.000	2,328,966.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	2,020,000.000	2,342,392.000	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	1,280,000.000	1,344,256.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,592,304.500	
スウェーデン・クローナ	小計		スウェーデン・クローナ 17,882,334.300 (226,032,706)	
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	4,140,000.000	7,011,586.800	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	2,760,000.000	2,942,022.000	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	2,310,000.000	2,580,524.100	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	2,670,000.000	2,896,362.600	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	2,330,000.000	2,597,414.100	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	2,200,000.000	2,211,264.000	
デンマーク・クローネ	小計		デンマーク・クローネ 20,239,173.600 (347,506,611)	

ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	2,620,000.000	2,820,115.600	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	1,150,000.000	1,183,396.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	1,300,000.000	1,407,926.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	151,491.000	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,412,997.300	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	2,999,640.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 9,975,565.900 (135,667,696)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	1,200,000.000	1,367,244.000	
	5.5% Poland Government Bond 20191025	1,120,000.000	1,182,316.800	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	1,340,000.000	1,339,437.200	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	640,000.000	612,768.000	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,000,000.000	2,009,800.000	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	1,520,000.000	1,512,856.000	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,719,712.500	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	800,000.000	801,760.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	742,566.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	710,000.000	760,445.500	
3.25% Poland Government Bond 20250725	1,430,000.000	1,455,983.100		

ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 13,504,889.100 (402,985,891)	
マレーシア・リンギット	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	マレーシア・リンギット 1,760,000.000	マレーシア・リンギット 1,741,344.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,250,000.000	1,207,700.000	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,050,000.000	1,049,412.000	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	600,000.000	541,290.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,128,633.000	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,100,000.000	1,095,226.000	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	600,000.000	595,176.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,374,318.600	
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	400,000.000	399,672.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	990,470.000	
マレーシア・リンギット 小計			マレーシア・リンギット 10,123,241.600 (281,223,652)	
メキシコ・ペソ	5% Mexican Bonos 20191211	メキシコ・ペソ 5,400,000.000	メキシコ・ペソ 5,185,458.000	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	4,200,000.000	3,669,582.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	1,450,000.000	1,445,403.500	
	8% Mexican Bonos 20231207	6,740,000.000	6,747,279.200	
	10% Mexican Bonos 20241205	6,340,000.000	7,004,368.600	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	4,800,000.000	4,664,928.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	3,279,842.500	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,762,340.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	5,246,450.000	
	8% Mexican Bonos 20200611	5,500,000.000	5,519,745.000	
6.5% Mexican Bonos 20210610	13,700,000.000	13,192,141.000		

	7.75% Mexican Bonos 20310529	2,700,000.000	2,652,561.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	8,900,000.000	8,448,592.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	4,750,000.000	4,613,295.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	3,300,000.000	3,228,060.000	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 81,660,045.800 (433,614,843)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	187,150.000	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	181,326.600	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	198,314.000	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	440,000.000	467,117.200	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	499,839.200	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	120,000.000	119,912.400	
	0.5% Austria Government Bond 20270420	400,000.000	397,240.000	
	0.8% Belgium Government Bond 20250622	670,000.000	691,312.700	
	1% Belgium Government Bond 20310622	1,022,000.000	1,016,685.600	
	1.9% Belgium Government Bond 20380622	410,000.000	442,156.300	
	1% Belgium Government Bond 20260622	595,000.000	618,210.950	
	1.6% Belgium Government Bond 20470622	564,000.000	550,943.400	
	0.2% Belgium Government Bond 20231022	400,000.000	403,568.000	
	0.8% Belgium Government Bond 20270622	580,000.000	587,447.200	
	2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	340,550.500	
	0.8% Belgium Government Bond 20280622	680,000.000	681,115.200	

1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	504,490.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	855,000.000	1,328,131.350	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,146,000.000	1,884,826.200	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	160,000.000	255,089.600	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	370,000.000	591,060.200	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	890,000.000	1,365,064.200	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	720,000.000	1,173,823.200	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	360,000.000	631,076.400	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	1,334,000.000	1,392,962.800	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	306,000.000	451,695.780	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	2,655,000.000	2,890,073.700	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	1,542,000.000	1,675,321.320	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,248,000.000	1,649,993.280	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,150,000.000	1,245,093.500	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	960,000.000	1,068,192.000	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	500,000.000	552,255.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	725,000.000	968,382.500	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	990,000.000	1,080,981.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,225,771.400	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	1,800,000.000	1,914,894.000	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	883,000.000	904,880.740	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	950,000.000	931,218.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,000,000.000	995,360.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	1,000,000.000	1,012,330.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	280,000.000	286,675.200	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	250,000.000	251,687.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,440,000.000	1,458,086.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,900,000.000	1,923,161.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	3,440,000.000	3,509,075.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,500,000.000	1,522,500.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	150,000.000	151,495.500	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,415,000.000	3,429,082.650	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,000,000.000	1,495,820.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	900,000.000	1,473,327.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,310,000.000	2,037,259.600	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,182,000.000	1,904,521.140	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	650,000.000	728,227.500	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,065,000.000	1,579,469.550	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,200,000.000	1,475,880.000	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	743,000.000	1,191,942.890	

3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	860,000.000	910,249.800	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	500,000.000	537,490.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	1,040,000.000	1,294,592.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	4,270,000.000	4,572,614.900	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	1,514,000.000	1,698,874.540	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	1,900,000.000	2,142,668.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	1,710,000.000	2,045,313.900	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	995,000.000	1,101,514.750	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	870,000.000	1,193,561.700	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	1,530,000.000	1,668,771.000	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	1,400,000.000	1,578,654.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,486,000.000	2,942,777.640	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	1,060,000.000	1,166,487.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	1,690,000.000	1,716,211.900	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	1,200,000.000	1,219,632.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	600,000.000	603,900.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	3,000,000.000	3,036,210.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,570,000.000	2,517,829.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	650,000.000	693,439.500	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	900,000.000	971,163.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	1,200,000.000	1,204,872.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	1,300,000.000	1,305,148.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	800,000.000	812,152.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	853,696.200	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	455,000.000	692,368.950	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,170,000.000	1,384,344.000	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	200,000.000	210,124.000	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	175,000.000	190,169.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	430,000.000	672,778.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	492,000.000	549,214.680	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	590,000.000	723,505.200	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	540,000.000	750,351.600	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	380,000.000	424,703.200	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	850,000.000	862,308.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	690,000.000	691,366.200	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	370,000.000	374,480.700	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	420,000.000	425,443.200	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	470,000.000	481,468.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	800,000.000	799,480.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	600,000.000	609,732.000	

7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	800,000.000	1,080,368.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,135,000.000	2,792,942.950	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	705,000.000	684,230.700	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	871,773.600	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	200,000.000	187,670.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	690,000.000	586,010.100	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	600,000.000	553,440.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	500,000.000	482,410.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,500,000.000	1,485,735.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	350,000.000	345,765.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	500,000.000	469,305.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	740,000.000	901,416.200	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,288,000.000	1,682,514.400	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,000,000.000	1,301,070.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,050,000.000	1,290,996.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	770,000.000	852,698.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	702,000.000	756,341.820	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,640,000.000	2,021,250.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	1,570,000.000	1,789,344.700	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	3,470,000.000	3,625,247.800	

5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	1,700,000.000	1,984,461.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	664,000.000	818,048.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	3,050,000.000	3,255,661.500	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	1,850,000.000	2,111,886.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	1,650,000.000	1,767,529.500	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	1,320,000.000	1,465,807.200	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	780,000.000	878,280.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	2,770,000.000	3,206,607.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,480,000.000	1,721,920.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	395,000.000	476,919.050	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	830,000.000	937,153.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,110,000.000	2,295,785.500	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	370,000.000	387,741.500	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	700,000.000	720,111.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	200,000.000	313,622.000	
4% Belgium Government Bond 20220328	550,000.000	640,568.500	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	534,000.000	586,641.720	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	665,000.000	1,018,154.900	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	500,000.000	577,035.000	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	300,000.000	394,080.000	

4.25% Belgium Government Bond 20220928	730,000.000	871,430.200	
3% Belgium Government Bond 20190928	700,000.000	731,934.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	120,000.000	175,332.000	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	800,000.000	916,824.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	377,109.000	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	290,000.000	304,108.500	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	288,000.000	382,584.960	
5% IRISH TREASURY 20201018	910,000.000	1,027,590.200	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	420,000.000	497,926.800	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	100,000.000	118,252.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	774,547.200	
2% IRISH TREASURY 20450218	310,000.000	324,842.800	
1% IRISH TREASURY 20260515	320,000.000	328,521.600	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	170,000.000	173,587.000	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	190,000.000	207,630.100	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	572,986.800	
3.9% Austria Government Bond 20200715	480,000.000	524,563.200	
3.5% Austria Government Bond 20210915	660,000.000	744,394.200	
4.15% Austria Government Bond 20370315	510,000.000	761,924.700	
3.4% Austria Government Bond 20221122	860,000.000	997,926.800	
3.8% Austria Government Bond 20620126	420,000.000	705,658.800	
3.15% Austria Government Bond 20440620	180,000.000	248,643.000	
1.75% Austria Government Bond 20231020	680,000.000	744,307.600	
2.4% Austria Government Bond 20340523	280,000.000	332,976.000	
1.65% Austria Government Bond 20241021	280,000.000	306,275.200	

4.375% Finland Government Bond 20190704	80,000.000	84,221.600	
4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	252,092.000	
3.375% Finland Government Bond 20200415	200,000.000	214,548.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	144,633.600	
1.625% Finland Government Bond 20220915	980,000.000	1,057,263.200	
2.625% Finland Government Bond 20420704	210,000.000	273,365.400	
2% Finland Government Bond 20240415	350,000.000	389,172.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,320,000.000	1,911,703.200	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	500,000.000	527,680.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	610,000.000	632,783.500	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,865,000.000	2,027,348.250	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,000,000.000	1,025,990.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	889,000.000	971,632.550	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	280,000.000	330,232.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,749,000.000	1,777,298.820	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	350,000.000	353,976.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	600,000.000	614,574.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	920,000.000	974,114.400	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	670,000.000	680,043.300	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	350,000.000	351,393.000	

5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	280,000.000	421,685.600	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	800,000.000	1,072,072.000	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	400,000.000	589,088.000	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	1,238,000.000	1,307,303.240	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	943,000.000	1,359,391.080	
4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,600,000.000	1,789,104.000	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	724,000.000	840,296.120	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,140,000.000	1,379,479.800	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	810,000.000	1,000,852.200	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,588,000.000	1,919,812.600	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	600,000.000	815,208.000	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	340,000.000	524,361.600	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	700,000.000	829,199.000	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	1,384,000.000	1,563,795.440	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,480,000.000	1,520,922.000	
ユーロ 小計		ユーロ 201,120,783.010 (25,723,348,147)	
南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	1,210,000.000	1,205,523.000	
10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	5,010,000.000	5,469,417.000	
6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	1,200,000.000	1,166,100.000	

	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	2,610,000.000	1,832,141.700	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	2,900,000.000	2,838,201.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	8,400,000.000	7,536,396.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	5,250,000.000	4,718,542.500	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	2,850,000.000	2,579,221.500	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	2,300,000.000	2,070,276.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	9,700,000.000	8,766,181.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 38,181,999.700 (313,856,038)	
国債証券 合計			62,822,098,221 [62,822,098,221]	
合計			62,822,098,221 [62,822,098,221]	

- (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 45銘柄	100%	43.6%
イギリス・ポンド	国債証券 27銘柄	100%	7.2%
オーストラリア・ドル	国債証券 16銘柄	100%	2.2%
カナダ・ドル	国債証券 15銘柄	100%	2.2%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券 3銘柄	100%	0.1%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	100%	0.6%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングギット	国債証券 10銘柄	100%	0.4%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券 196銘柄	100%	40.9%

南アフリカ・ランド	国債証券	10銘柄	100%	0.5%
-----------	------	------	------	------

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【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)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成29年6月16日から平成30年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	164
コール・ローン	4,837	14,945
親投資信託受益証券	1,005,621	1,001,841
流動資産合計	1,010,458	1,016,950
資産合計	1,010,458	1,016,950
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,500	12,000
未払受託者報酬	30	6
未払委託者報酬	1,266	2,002
その他未払費用	119	182
流動負債合計	3,915	14,190
負債合計	3,915	14,190
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,000	1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,543	2,760
（分配準備積立金）	6,543	15,154
元本等合計	1,006,543	1,002,760
純資産合計	1,006,543	1,002,760
負債純資産合計	1,010,458	1,016,950

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自	平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		10,458		12,605
営業収益合計		10,458		12,605
営業費用				
受託者報酬		30		8
委託者報酬		1,266		4,015
その他費用		119		365
営業費用合計		1,415		4,388
営業利益		9,043		8,217
経常利益		9,043		8,217
当期純利益		9,043		8,217
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		6,543
分配金		1 2,500		1 12,000
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,543		2,760

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,000,000口	1,000,000口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,679円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,364円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は9,043円(1万口当たり90.43円)であり、うち2,500円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(20,611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(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は27,154円(1万口当たり271.54円)であり、うち12,000円(1万口当たり120円)を分配金額としております。</p>
------------	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期 平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15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	10,432	12,331
合計	10,432	12,331

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0065円 (10,065円)	1.0028円 (10,028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	外国債券インデックスマザーファンド	369,220	1,001,841	
親投資信託受益証券 合計			1,001,841	
合計			1,001,841	

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、「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。

「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6月15日現在	平成30年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	295,098,746	450,277,438
金銭信託	-	6,740,515
コール・ローン	271,269,432	613,744,470
国債証券	157,715,672,327	161,781,211,688
派生商品評価勘定	483,079	6,412,552
未収入金	-	2,107,837
未収利息	1,219,737,675	1,200,038,774
前払費用	31,822,020	33,324,989
流動資産合計	159,534,083,279	164,093,858,263
資産合計	159,534,083,279	164,093,858,263
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,007,901	1,138,003
未払金	214,806	-
未払解約金	117,641,472	94,056,724
その他未払費用	-	13,859
流動負債合計	118,864,179	95,208,586
負債合計	118,864,179	95,208,586
純資産の部		
元本等		
元本	1 59,482,440,391	60,439,178,019
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	99,932,778,709	103,559,471,658
元本等合計	159,415,219,100	163,998,649,677
純資産合計	159,415,219,100	163,998,649,677
負債純資産合計	159,534,083,279	164,093,858,263

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16日 至 平成30年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首	平成29年2月16日	平成29年6月16日
期首元本額	58,900,318,961円	59,482,440,391円
期中追加設定元本額	2,380,567,146円	6,470,833,619円
期中一部解約元本額	1,798,445,716円	5,514,095,991円

期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス V A	1,110,049,049円	854,523,679円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	38,189,530円	29,450,309円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	271,112,743円	206,824,310円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	70,431,812円	57,761,758円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	960,266,352円	662,292,154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)	178,516,039円	353,339,336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)	523,704,719円	885,845,515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 エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	160,397,732円	641,273,428円
D-I's 外国債券インデッ クス	868,793円	935,352円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	21,393円	27,099円
iFree 外国債券イン デックス	436,275,378円	435,441,531円
iFree 8資産バランス	151,742,431円	363,248,667円
DCダイワ外国債券インデッ クス	38,800,931,402円	41,138,711,641円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	621,806,232円	718,124,357円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	279,015,554円	345,053,257円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	173,123,939円	224,187,800円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	256,135,124円	301,508,138円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	210,667,807円	246,918,816円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	63,048,060円	78,267,023円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	13,303,552円	11,123,826円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	18,853,262円	18,255,807円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,227,587円	1,700,379円
ダイワ世界バランスファンド40VA	1,187,547,661円	337,001,995円
ダイワ世界バランスファンド60VA	183,319,061円	168,856,742円
ダイワ・バランスファンド35VA	6,777,418,650円	6,143,693,045円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	482,914,265円	83,827,530円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	284,102,807円	27,516,152円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	380,871,234円	349,404,648円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	116,828,231円	139,464,733円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	13,641,314円	26,817,344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)	375,232円	369,220円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,606,590,725円	5,470,401,280円
ダイワライフスタイル25	34,979,224円	35,960,613円
ダイワライフスタイル50	58,616,133円	63,227,770円
ダイワライフスタイル75	15,547,364円	17,822,765円
計	59,482,440,391円	60,439,178,019円
2. 期末日における受益権の総数	59,482,440,391口	60,439,178,019口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年6月15日現在	平成30年6月15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	846,533,657	3,424,903,537
合計	846,533,657	3,424,903,537

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成28年12月1日から平成29年6月15日まで、及び平成29年12月1日から平成30年6月15日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成29年6月15日 現在				平成30年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	185,672,372	-	185,147,550	524,822	586,277,111	-	591,551,660	5,274,549
アメリカ・ドル	49,506,712	-	49,214,890	291,822	267,833,163	-	272,345,920	4,512,757
イギリス・ ポンド	19,863,522	-	19,580,400	283,122	-	-	-	-
オーストラ リア・ドル	13,992,093	-	14,137,200	145,107	16,985,074	-	17,065,080	80,006
カナダ・ドル	4,856,784	-	4,887,560	30,776	10,541,009	-	10,615,500	74,491
デンマーク・ クローネ	1,665,518	-	1,656,000	9,518	-	-	-	-
ノルウェー・ クローネ	524,081	-	520,400	3,681	-	-	-	-
メキシコ・ ペソ	-	-	-	-	15,871,398	-	15,544,320	327,078

ユーロ	81,672,315	-	81,259,200	413,115	254,923,461	-	256,439,500	1,516,039
南アフリカ・ ランド	13,591,347	-	13,891,900	300,553	20,123,006	-	19,541,340	581,666
合計	185,672,372	-	185,147,550	524,822	586,277,111	-	591,551,660	5,274,549

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.6800円	2.7134円
(1万口当たり純資産額)	(26,800円)	(27,134円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,621,000.000	2,656,724.230	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,069,124.400	

3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	4,280,000.000	4,356,055.600	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,125,917.060	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,854,542.260	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,507,061.130	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,176,432.640	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,582,071.180	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,488,565.380	
2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,101,349.530	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,139,112.080	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,365,435.050	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,357,500.950	
1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,348,806.960	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,784,000.000	1,753,600.640	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,426,556.030	
1% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,872,000.000	1,839,820.320	
1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,173,623.800	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	869,316.760	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,014,161.920	
1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,323,612.840	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,854,112.360	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,341,070.500	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,197,054.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,925,392.800	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,130,953.600	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,455,856.650	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,412,911.250	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,404,470.830	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,101,016.830	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,792,086.550	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	2,768,000.000	2,723,878.080	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	1,972,272.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,858,930.450	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,297,349.600	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	4,997,451.510	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,462,484.600	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	1,992,359.200	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,199,142.410	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,624,600.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,703,776.380	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,788,586.710	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	3,912,000.000	3,831,921.360	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,378,404.840	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,241,000.000	2,223,385.740	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,678,316.200	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2,885,000.000	2,862,785.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,426,730.800	
8.125% United States Treasury Note/Bond 20190815	724,000.000	771,313.400	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	724,330.080	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,464,988.760	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	761,550.300	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,036,815.750	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	797,932.800	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	893,942.650	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	856,023.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	889,459.740	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	571,956.330	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,280,915.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	991,000.000	1,242,228.410	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,626,000.000	1,965,801.480	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	706,182.470	

4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	659,950.920	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	635,567.400	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,343,349.460	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,335,649.080	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	760,000.000	935,803.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,467,500.100	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,144,972.700	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,795,873.460	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,806,405.490	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,757,746.640	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,244,979.680	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,665,723.150	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,526,651.930	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,468,690.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,643,790.630	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,341,580.680	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,641,334.200	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,492,319.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,326,000.000	2,353,237.460	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,798,000.000	3,675,742.380	

3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,366,079.760	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,014,050.330	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	3,977,831.920	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	3,861,243.450	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,296,631.420	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,795,032.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,162,000.000	5,013,179.540	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	3,771,212.280	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190831	2,989,000.000	2,959,438.790	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,272,130.810	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,372,342.800	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,555,871.250	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,147,477.300	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,111,780.160	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,697,067.780	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,654,420.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,804,037.600	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,262,633.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,102,134.100	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,174,025.600	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,882,788.880	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,321,935.170	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,429,374.770	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,376,389.380	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,733,104.280	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,744,545.330	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,734,401.040	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,785,276.130	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,503,519.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	3,791,242.650	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,550,375.960	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,513,632.080	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,730,820.320	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,951,082.850	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,943,770.930	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,750,475.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,072,049.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,112,257.230	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,403,301.550	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,448,195.110	

1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,355,977.550	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,792,026.680	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,367,508.560	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,796,449.840	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,577,608.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,025,667.160	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,665,530.520	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,461,256.440	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,021,231.600	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,078,208.730	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	2,975,719.270	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	2,492,000.000	2,419,956.280	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,024,154.920	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	4,883,864.900	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,444,141.570	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,067,785.760	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,175,845.840	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,016,594.040	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,887,053.420	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	1,998,592.200	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,029,000.000	5,473,668.810	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,361,555.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	1,957,764.600	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,060,367.380	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,598,750.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,362,100.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190615	2,100,000.000	2,069,382.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,385,525.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,796,300.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190715	2,500,000.000	2,456,150.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,016,760.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	2,946,829.200	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,500,000.000	2,451,850.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,519,033.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,525,101.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,570,832.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,230,680.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190915	2,600,000.000	2,549,300.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,324,940.600	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,888,683.200	

1% United States Treasury Note/Bond 20191015	2,147,000.000	2,105,133.500	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,114,560.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,857,020.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,348,025.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,650,000.000	3,516,227.500	
1% United States Treasury Note/Bond 20191115	1,400,000.000	1,370,950.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,398,741.500	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,321,232.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20191215	1,440,000.000	1,415,865.600	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	1,949,200.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,422,250.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200115	1,500,000.000	1,473,210.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,057,514.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	2,918,285.300	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,401,136.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,875,000.000	3,827,763.750	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,130,000.000	2,089,466.100	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	2,915,937.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,210,507.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315	1,900,000.000	1,869,790.000	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	2,550,000.000	2,448,586.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,806,649.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200415	850,000.000	833,892.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,446,578.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	3,456,495.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	2,900,850.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,858,670.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	4,000,000.000	3,920,120.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	2,884,680.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190531	4,000,000.000	3,958,560.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	2,000,000.000	1,904,060.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615	2,700,000.000	2,643,570.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190630	4,000,000.000	3,953,880.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	2,881,860.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,282,808.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715	2,000,000.000	1,955,840.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,000,000.000	988,470.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,569,954.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815	1,300,000.000	1,269,983.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,797,340.000	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,872,500.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	3,566,946.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,100,000.000	2,003,022.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190831	600,000.000	591,492.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,886,560.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915	2,500,000.000	2,432,500.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,407,600.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190930	1,000,000.000	985,970.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,400,000.000	3,250,434.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015	1,000,000.000	977,380.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,418,150.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,186,280.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,100,000.000	2,909,629.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,369,275.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201115	3,600,000.000	3,525,300.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20191130	2,800,000.000	2,769,480.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	1,962,560.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,055,232.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,000,000.000	990,190.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	1,300,000.000	1,249,924.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,262,165.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20200131	2,300,000.000	2,280,496.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,433,815.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,195,609.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,800,000.000	1,791,342.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,473,125.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,273,930.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,538,250.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,675,295.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	3,553,560.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,174,368.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,500,000.000	1,491,735.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,859,661.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,849,917.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,478,800.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	1,200,000.000	1,213,776.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	1,400,000.000	1,391,684.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	2,994,240.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,200,000.000	1,195,728.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,492,575.000	

	2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,896,428.000	
	2.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	1,400,000.000	1,398,082.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	1,900,000.000	1,896,428.000	
	2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,492,575.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 649,694,575.810 (71,908,195,650)	
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	2,340,853.200	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,926,363.060	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,524,731.790	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,582,000.000	2,075,584.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,491,428.600	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	1,300,000.000	1,278,108.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	910,000.000	857,493.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	400,000.000	399,480.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,130,000.000	1,173,279.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,210,000.000	1,197,161.900	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	1,000,000.000	985,000.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	500,000.000	507,300.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	430,000.000	442,771.000	
	8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,337,321.080	

6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,372,443.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,783,674.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,839,926.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,822,448.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,215,659.900	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,845,869.560	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,958,256.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,243,104.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,551,790.240	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,596,000.000	2,461,351.200	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,480,000.000	2,019,608.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,454,466.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,798,227.200	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,543,237.940	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,620,000.000	2,269,296.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,428,000.000	1,482,749.520	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,244,000.000	2,151,871.200	
3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,916,413.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,307,466.400	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	878,506.090	

	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,352,000.000	2,077,348.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,318,407.360	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,966,000.000	2,557,766.000	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,061,355.320	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,709,663.600	
	1.75% United Kingdom Gilt 20190722	2,251,000.000	2,278,709.810	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,527,970.560	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	2,897,773.200	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 77,882,234.730 (11,422,208,545)	
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	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,420,000.000	2,665,799.400	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,409,000.000	2,514,899.640	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,455,426.640	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,364,220.320	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,008,625.120	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,509,526.210	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,074,000.000	2,174,070.500	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,500,034.900	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,358,000.000	1,617,310.100	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,171,732.160	

	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	2,011,000.000	2,030,848.570	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,222,062.870	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	536,936.860	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,177,176.600	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	712,000.000	725,577.840	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,522,000.000	2,529,994.740	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,978,000.000	1,897,020.680	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,132,000.000	1,082,531.600	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,787,778.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,200,000.000	2,203,630.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	300,000.000	299,154.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	600,000.000	599,028.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 42,073,384.750 (3,472,316,443)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	425,000.000	484,198.250	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	564,413.060	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,310,761.690	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,614,382.420	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,566,741.280	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1,524,000.000	1,553,016.960	

4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,767,047.720	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,876,000.000	1,931,660.920	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	989,020.240	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,794,494.840	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	1,935,405.850	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,214,983.980	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,428,660.200	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,627,000.000	1,625,926.180	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,197,000.000	1,314,425.700	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,157,525.920	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,719,000.000	1,707,293.610	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,831,000.000	1,783,357.380	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,067,796.910	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,237,000.000	1,196,203.740	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,420,326.400	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,113,197.600	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840,000.000	792,934.800	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,400,000.000	1,337,784.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190801	1,360,000.000	1,344,713.600	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20191101	500,000.000	495,990.000	

	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	585,330.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,572,080.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,600,000.000	1,583,376.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200501	700,000.000	697,690.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	600,000.000	595,026.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	300,000.000	279,516.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200801	300,000.000	298,692.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 40,123,973.250 (3,383,654,664)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	715,070.400	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	830,826.400	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	455,607.600	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	599,000.000	603,127.110	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	644,929.600	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	365,282.500	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	497,574.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	386,800.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	501,919.840	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	368,000.000	391,691.840	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	128,062.500	

	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	415,000.000	413,999.850	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	124,000.000	123,504.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	224,221.760	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	568,000.000	547,108.960	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	243,875.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	190,000.000	184,965.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	197,160.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	150,000.000	136,479.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	200,000.000	196,214.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	300,000.000	301,161.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 8,089,580.360 (664,963,506)	
スイス・フラン	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	404,000.000	489,910.600	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	497,000.000	692,718.600	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	327,000.000	347,846.250	
	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	362,000.000	390,746.420	
	スイス・フラン 小計		スイス・フラン 1,921,221.870 (213,101,930)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,095,000.000	10,355,021.300	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,876,333.400	

	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,738,643.900	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,609,761.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,908,162.000	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	5,965,136.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,625,484.500	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 50,078,542.100 (632,992,773)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	19,496,953.440	デンマーク・クローネ
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	9,168,235.950	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	5,550,000.000	6,199,960.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,256,843.880	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	8,363,000.000	9,322,821.510	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	4,800,000.000	4,824,576.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	1,500,000.000	1,529,115.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 55,798,506.280 (958,060,353)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,532,507.240	ノルウェー・クローネ
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	6,024,000.000	6,198,936.960	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,434,966.900	

	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,428,746.300	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,300,287.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,449,586.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 28,345,030.800 (385,492,419)	
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	2,630,805.330	
	5.5% Poland Government Bond 20191025	1,912,000.000	2,018,383.680	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,478,000.000	2,476,959.240	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,233,308.650	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,137,422.300	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,036,660.300	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,370,000.000	2,245,575.000	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,325,104.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	1,700,000.000	1,707,650.000	
	Poland Government Bond 20200725	300,000.000	289,950.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,023,503.470	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,443,699.200	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,215,543.400	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,383,086.250	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	800,000.000	771,320.000	

	3.25% Poland Government Bond 20190725	1,840,000.000	1,878,492.800	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,638,078.470	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 34,455,542.090 (1,028,153,376)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	647,000.000	663,272.050	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	535,222.110	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	784,375.920	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,622,941.320	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,165,513.200	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,941,578.600	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,520,373.940	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,241,773.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	858,777.500	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	706,262.960	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	580,790.220	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,044,000.000	1,043,415.360	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	980,419.440	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	927,000.000	836,293.050	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	563,151.860	
	3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	660,054.080	

4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	603,804.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,060,678.360	
4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	865,030.090	
3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	648,000.000	649,976.400	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	723,306.540	
3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	701,820.000	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,155,961.260	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	766,544.200	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	696,355.920	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	900,081.900	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	630,188.000	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	351,711.360	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500,000.000	501,425.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	747,435.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	350,000.000	338,887.500	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	850,000.000	841,899.500	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,187,808.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	500,000.000	498,490.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 28,925,617.640 (803,553,658)	
メキシコ・ペソ 5% Mexican Bonos 20191211	メキシコ・ペソ 21,447,000.000	メキシコ・ペソ 20,594,910.690	

	5.75% Mexican Bonos 20260305	13,290,000.000	11,611,605.900	
	8% Mexican Bonos 20471107	7,000,000.000	6,977,810.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	9,788,700.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	10,633,000.000	10,644,483.640	
	10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	24,436,850.010	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	14,668,000.000	14,255,242.480	
	10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	8,198,413.580	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	9,200,943.840	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	10,171,817.260	
	8% Mexican Bonos 20200611	18,928,000.000	18,995,951.520	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	27,826,000.000	26,794,490.180	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	12,786,326.450	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	17,099,000.000	16,231,738.720	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	18,117,137.880	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	6,792,620.800	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 225,599,042.950 (1,197,930,919)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	440,847.360	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	407,790.000	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	290,288.340	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	414,029.070	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	200,172.000	
	Finland Government Bond 20220415	270,000.000	272,751.300	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	297,471.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	374,284.600	
	0.25% Austria Government Bond 20191018	527,000.000	532,649.440	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	926,802.990	

0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,148,610.080	
1.5% Austria Government Bond 20470220	734,000.000	733,464.180	
1.5% Austria Government Bond 20861102	150,000.000	132,915.000	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	901,359.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	575,998.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	250,000.000	270,457.500	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	403,656.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	500,000.000	502,580.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,443,502.190	
1% Belgium Government Bond 20310622	924,000.000	919,195.200	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	601,763.940	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,333,049.830	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,044,000.000	1,019,831.400	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	340,000.000	359,128.400	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	150,000.000	151,338.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,417,976.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	650,000.000	660,744.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	260,000.000	285,623.000	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	303,072.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	600,000.000	600,984.000	

1.25% Belgium Government Bond 20330422	300,000.000	302,694.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,319,185.600	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,567,000.000	2,434,130.790	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,035,127.640	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,783,875.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,564,109.700	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,308,560.880	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,835,491.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,176,458.380	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	1,997,129.750	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,452,433.010	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,590,660.200	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,203,235.000	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,072,600.000	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	2,175,815.620	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,536,863.640	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,518,496.830	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,867,865.940	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,540,284.100	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	3,051,152.860	

1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,414,114.120	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,828,000.000	2,416,817.080	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,772,018.280	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,526,592.900	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,971,045.260	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,779,207.300	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,724,140.110	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,959,000.000	2,616,636.300	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,740,488.600	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,638,436.680	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,259,951.640	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,270,213.220	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,221,723.040	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,793,655.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,592,576.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,328,359.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	800,000.000	819,072.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,200,000.000	1,208,100.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20190614	400,000.000	402,732.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20190913	100,000.000	100,874.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20191213	1,000,000.000	1,010,210.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200313	700,000.000	707,903.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200612	800,000.000	810,088.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,165,456.560	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,752,100.890	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,477,075.840	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,602,159.180	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,421,994.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	360,000.000	365,400.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,127,258.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	500,000.000	504,985.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	733,599.790	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,398,680.300	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,295,227.750	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	3,923,535.860	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,595,143.210	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,209,000.000	3,435,348.440	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,364,000.000	2,197,772.280	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,618,730.500	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,824,000.000	4,188,189.680	

4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,697,000.000	4,546,940.300	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	4,947,445.320	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	3,263,000.000	3,453,657.090	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,380,000.000	3,633,432.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	1,925,433.300	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,916,140.800	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,333,618.310	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,550,000.000	3,983,490.500	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	4,093,623.600	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,499,000.000	4,185,118.910	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,982,392.700	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,238,000.000	3,070,334.580	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,650,572.900	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,479,804.460	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,299,083.380	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,740,463.540	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2,322,000.000	2,358,014.220	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,345,857.120	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3,070,000.000	3,101,559.600	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,101,000.000	2,203,549.810	

0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,232,868.740	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	3,420,000.000	3,639,598.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,737,000.000	2,754,790.500	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,009,000.000	2,002,169.400	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	787,000.000	763,106.680	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,803,433.900	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,743,160.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	2,000,000.000	2,019,280.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	620,000.000	661,434.600	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200225	700,000.000	706,496.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,591,675.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,700,000.000	1,834,419.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	1,700,000.000	1,706,902.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	2,600,000.000	2,610,296.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	1,400,000.000	1,416,156.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	450,000.000	456,835.500	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	743,241.440	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,823,671.710	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,061,889.950	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	935,911.200	

4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,147,000.000	1,205,061.140	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,245,335.280	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,349,000.000	2,110,645.400	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,633,132.270	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,589,493.300	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,432,295.040	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,517,129.000	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,084,000.000	1,506,261.360	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,692,106.960	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,393,895.520	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,293,556.180	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,354,203.180	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,215,552.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,229,280.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	800,000.000	799,480.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	750,000.000	762,165.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,500,786.700	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,499,010.600	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,129,142.640	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,848,919.500	

1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,453,828.950	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,386,901.660	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,620,561.780	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,598,567.460	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,512,569.700	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,509,141.470	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,591,000.000	1,549,363.530	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,493,832.960	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	769,108.320	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,267,444.800	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,272,778.550	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,206,473.760	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,644,453.900	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	814,090.200	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,422,960.000	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	656,845.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,320,315.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	648,000.000	550,339.920	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191015	858,000.000	852,543.120	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	700,000.000	645,680.000	

2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,010,000.000	1,939,288.200	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	300,000.000	295,764.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	350,000.000	346,671.500	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	970,000.000	961,764.700	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,432,455.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,000,000.000	947,970.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	681,289.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	700,000.000	668,941.000	
0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015	1,900,000.000	1,868,669.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	800,000.000	759,336.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	600,000.000	563,166.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	867,609.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	900,000.000	849,969.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	500,000.000	485,750.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,454,000.000	2,989,291.020	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,721,648.700	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,655,000.000	2,153,270.850	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,037,835.220	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,071,340.960	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,089,646.000	

3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,945,638.940	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	2,506,843.980	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,565,487.210	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	2,531,000.000	2,644,236.940	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,472,404.940	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,516,976.000	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,712,550.400	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,363,290.020	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,363,029.200	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,296,717.120	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,532,959.260	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,265,512.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,912,791.090	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,211,054.200	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,810,000.000	2,105,862.600	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,129,954.520	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,613,000.000	1,947,520.070	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,477,245.400	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,856,531.040	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,394,798.050	

3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,030,927.100	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,638,766.890	
1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	1,246,000.000	1,261,089.060	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,491,220.620	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,672,059.440	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	1,021,415.590	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	1,907,134.880	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,562,994.440	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,668,785.220	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,314,913.600	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,570,961.840	
4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	939,012.000	
3% Belgium Government Bond 20190928	1,123,000.000	1,174,231.260	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,494,960.780	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	753,000.000	1,100,208.300	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,724,775.150	
3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	750,446.910	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	684,000.000	717,276.600	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	570,000.000	618,752.100	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,502,443.020	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	863,853.300	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	597,512.160	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	717,789.640	

2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	866,809.440	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	534,746.280	
2% IRISH TREASURY 20450218	681,000.000	713,606.280	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,101,573.990	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	350,000.000	357,385.000	
IRISH TREASURY 20221018	50,000.000	50,108.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	498,515.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	688,912.000	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	735,000.000	803,200.650	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,243,984.500	
3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,363,864.320	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,507,962.190	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,073,000.000	1,603,029.810	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,178,572.500	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	917,896.930	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	1,011,851.360	
3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	534,284.520	
1.95% Austria Government Bond 20190618	138,000.000	141,455.520	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	860,581.050	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,049,692.630	
2.4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	738,493.200	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,019,458.880	
4.375% Finland Government Bond 20190704	416,000.000	437,952.320	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	840,726.820	

3.375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	677,971.680	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	510,559.470	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	468,853.920	
1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	660,250.080	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	480,667.580	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	529,808.180	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	588,205.680	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,952,000.000	2,827,003.520	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,841,603.200	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,552,000.000	1,609,967.200	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,947,993.600	
1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,650,000.000	1,697,322.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,853,166.220	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,792,404.530	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,052,000.000	1,149,783.400	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	850,000.000	1,002,490.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,730,000.000	1,757,991.400	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	1,380,000.000	1,395,676.800	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	1,843,722.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,450,000.000	1,535,289.000	

1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,800,000.000	1,826,982.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	300,000.000	301,125.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,000,000.000	1,010,790.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,100,000.000	2,108,358.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	650,000.000	677,339.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	700,000.000	697,795.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	2,980,413.580	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,216,508.860	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,608,000.000	2,368,133.760	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,078,733.340	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	1,882,000.000	1,987,354.360	
4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,888,972.750	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,373,000.000	1,979,261.880	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,267,399.200	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,789,000.000	2,260,777.190	
4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,879,677.390	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,918,984.450	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,703,368.400	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,393,518.460	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,222,496.960	

	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,601,000.000	1,935,528.950	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,404,863.600	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,499,000.000	2,311,817.760	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,333,602.900	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,369,421.270	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,952,535.000	
	ユーロ 小計		ユーロ 506,484,996.620 (64,779,431,067)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,746,658.400	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	16,434,000.000	17,940,997.800	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	5,440,981.480	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,491,428.500	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,250,340.880	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,413,826.150	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	5,539,000.000	5,420,963.910	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	15,452,000.000	13,863,379.880	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,905,344.170	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	8,862,000.000	8,020,021.380	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	11,944,000.000	10,751,033.280	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	8,243,000.000	7,449,446.390	

	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	6,166,000.000	5,771,684.300	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	5,179,000.000	4,813,259.020	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 113,279,365.540 (931,156,385)	
国債証券 合計			161,781,211,688 [161,781,211,688]	
合計			161,781,211,688 [161,781,211,688]	

- (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 246銘柄	100%	44.6%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	100%	7.1%
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 33銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 21銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券 4銘柄	100%	0.1%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.6%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 17銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券 34銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券 303銘柄	100%	40.0%
南アフリカ・ランド	国債証券 14銘柄	100%	0.6%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

【ダイワJ - REITインデックス（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成29年6月16日から平成30年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワJ - REITインデックス（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	7,438
コール・ローン	9,599	677,242
親投資信託受益証券	3,467,337	321,845,235
未収入金	-	17,400
流動資産合計	3,476,936	322,547,315
資産合計	3,476,936	322,547,315
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	17,667	1,433,724
未払受託者報酬	170	3,957
未払委託者報酬	2,500	57,519
その他未払費用	119	1,056
流動負債合計	20,456	1,496,256
負債合計	20,456	1,496,256
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,533,441	1 318,605,408
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 76,961	2 2,445,651
（分配準備積立金）	2,574	108,267
元本等合計	3,456,480	321,051,059
純資産合計	3,456,480	321,051,059
負債純資産合計	3,476,936	322,547,315

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自	平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		23,063		857,208
営業収益合計		23,063		857,208
営業費用				
支払利息		-		6
受託者報酬		170		4,309
委託者報酬		2,500		62,657
その他費用		119		1,239
営業費用合計		2,789		68,211
営業利益又は営業損失（ ）		25,852		788,997
経常利益又は経常損失（ ）		25,852		788,997
当期純利益又は当期純損失（ ）		25,852		788,997
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		76,961
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		3,167,339
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		3,167,339
剰余金減少額又は欠損金増加額		33,442		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		33,442		-
分配金		1 17,667		1 1,433,724
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		76,961		2,445,651

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	3,533,441円
期中追加設定元本額	2,533,441円	315,071,967円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,533,441口	318,605,408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76,961円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(20,241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(294円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は20,535円(1万口当たり58.12円)であり、うち17,667円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(689,840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(53,064円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,133,897円)及び分配準備積立金(2,574円)より分配対象額は3,879,375円(1万口当たり121.76円)であり、うち1,433,724円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>
------------	---	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期
	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15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	23,048	857,487
合計	23,048	857,487

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期	第2期
平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期
自 平成29年6月16日
至 平成30年6月15日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9782円 (9,782円)	1.0077円 (10,077円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワJ-REITマザーファンド	127,599,903	321,845,235	
親投資信託受益証券 合計			321,845,235	
合計			321,845,235	

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、「ダイワJ-REIT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。

「ダイワJ-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	38,099,261
コール・ローン	2,293,417,200	3,469,054,314
投資証券	264,868,804,800	209,017,190,580
派生商品評価勘定	-	18,885,600
未収入金	2,453,515,649	1,060,294,414
未収配当金	1,657,088,978	1,315,936,685
前払金	62,221,600	-
流動資産合計	271,335,048,227	214,919,460,854
資産合計	271,335,048,227	214,919,460,854
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,843,744	-
前受金	-	16,380,000
未払解約金	2,436,389,000	2,702,297,400
その他未払費用	-	36,292
流動負債合計	2,452,232,744	2,718,713,692
負債合計	2,452,232,744	2,718,713,692
純資産の部		
元本等		
元本	110,682,384,557	84,131,299,324
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	158,200,430,926	128,069,447,838
元本等合計	268,882,815,483	212,200,747,162
純資産合計	268,882,815,483	212,200,747,162
負債純資産合計	271,335,048,227	214,919,460,854

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16日 至 平成30年6月15日
-----	------------------------------

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首	平成29年2月16日	平成29年6月16日
期首元本額	114,478,528,235円	110,682,384,557円
期中追加設定元本額	3,701,453,047円	4,835,703,556円
期中一部解約元本額	7,497,596,725円	31,386,788,789円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ - REITオープン	10,314,714,780円	8,634,387,920円
ダイワJ - REITオープン （毎月分配型）	94,364,992,161円	68,030,957,225円
ダイワJ - REITオープン （年1回決算型）	402,276,940円	427,102,393円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	22,838円	29,232円
iFree J - REITイ ンデックス	48,401,408円	123,106,225円
iFree 8資産バランス	168,276,361円	390,865,743円

	DC・ダイワJ-REIT オープン	3,307,573,527円	3,554,437,382円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,682,373円	2,995,920円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,661,688円	5,407,352円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,090,705円	1,334,004円
	ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	56,096,535円	54,950,461円
	ダイワファンドラップ J- REITインデックス	502,936,354円	931,979,260円
	ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	1,427,299円	127,599,903円
	ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	86,482,432円	351,216,953円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,418,749,156円	1,494,929,351円
	計	110,682,384,557円	84,131,299,324円
2.	期末日における受益権の総数	110,682,384,557口	84,131,299,324口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 353,400,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 371,400,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

投資証券	5,035,457,245	6,566,853,993
合計	5,035,457,245	6,566,853,993

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成29年3月16日から平成29年6月15日まで、及び平成30年3月16日から平成30年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	平成29年6月15日 現在				平成30年6月15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								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	3,764,081,600	-	3,748,472,000	15,609,600	3,079,620,000	-	3,098,700,000	19,080,000
合計	3,764,081,600	-	3,748,472,000	15,609,600	3,079,620,000	-	3,098,700,000	19,080,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.4293円	2.5223円
(1万口当たり純資産額)	(24,293円)	(25,223円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	8,491	4,169,081,000	
	MCUBS MidCity投資法人	28,509	2,366,247,000	
	森ヒルズリート	27,448	3,845,464,800	
	産業ファンド	29,675	3,584,740,000	
	アドバンス・レジデンス	23,657	6,564,817,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	12,998	2,106,975,800	
	API投資法人	11,559	5,606,115,000	
	GLP投資法人	53,043	6,328,029,900	
	コンフォリア・レジデンシャル	9,685	2,511,320,500	
	日本プロロジスリート	34,056	7,819,257,600	
	星野リゾート・リート	4,038	2,269,356,000	
	ONEリート投資法人	2,793	702,998,100	
	イオンリート投資	24,264	2,977,192,800	
	ヒューリックリート投資法	17,353	2,929,186,400	
	日本リート投資法人	6,865	2,244,855,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	150,554	2,198,088,400	
	日本ヘルスケア投資法	1,239	211,373,400	
	積水ハウス・リート投資	64,017.4	4,397,995,380	
	トーセイ・リート投資法人	4,108	460,917,600	
	ケネディクス商業リート	9,291	2,276,295,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	3,148	345,020,800	
	サムティ・レジデンシャル	4,437	427,283,100	
	野村不動産マスターF	75,614	11,886,520,800	
	いちごホテルリート投資	3,998	530,934,400	
	ラサールロジポート投資	19,276	2,141,563,600	
	スターアジア不動産投	5,993	634,658,700	
	マリモ地方創生リート	2,046	239,382,000	
	三井不ロジパーク	4,833	1,635,970,500	
	大江戸温泉リート	4,289	374,429,700	
	さくら総合リート	6,143	565,770,300	
	投資法人みらい	3,730	697,510,000	
	森トラスト・ホテルリート投	5,534	816,818,400	
三菱地所物流REIT	2,368	639,360,000		
CREロジスティクスファンド	2,558	291,356,200		
ザイマックス・リート	2,356	268,584,000		

日本ビルファンド	24,743	15,315,917,000	
ジャパンリアルエステイト	25,424	14,542,528,000	
日本リテールファンド	48,248	9,683,373,600	
オリックス不動産投資	50,697	8,831,417,400	
日本プライムリアルティ	16,132	6,517,328,000	
プレミア投資法人	23,079	2,444,066,100	
東急リアル・エステート	17,131	2,545,666,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	16,228	1,785,080,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	56,354	9,721,065,000	
森トラスト総合リート	18,261	2,921,760,000	
インヴィンシブル投資法人	70,077	3,559,911,600	
フロンティア不動産投資	8,692	3,920,092,000	
平和不動産リート	15,912	1,715,313,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	17,022	3,835,056,600	
福岡リート投資法人	13,215	2,296,767,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	7,884	5,392,656,000	
いちごオフィスリート投資法人	19,785	1,646,112,000	
大和証券オフィス投資法人	5,510	3,515,380,000	
阪急リート投資法人	11,154	1,534,790,400	
スタートアップシード投資法人	4,026	654,627,600	
大和ハウスリート投資法人	29,730	7,786,287,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	73,747	5,973,507,000	
日本賃貸住宅投資法人	28,740	2,509,002,000	
ジャパンエクセレント投資法人	22,881	3,304,016,400	
投資証券 合計		209,017,190,580	
合計		209,017,190,580	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド

600口

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成29年6月16日から平成30年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	2,235
コール・ローン	47,398	203,473
親投資信託受益証券	10,153,245	286,108,769
派生商品評価勘定	99,621	163,778
未収入金	504	-
流動資産合計	10,300,768	286,478,255
資産合計	10,300,768	286,478,255
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,333	3,195,512
未払金	96	50,562
未払収益分配金	80,000	3,126,671
未払受託者報酬	696	8,554
未払委託者報酬	13,214	161,191
その他未払費用	119	2,072
流動負債合計	105,458	6,544,562
負債合計	105,458	6,544,562
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,000,000	1 284,242,850
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 195,310	2 4,309,157
（分配準備積立金）	195,310	6,871,704
元本等合計	10,195,310	279,933,693
純資産合計	10,195,310	279,933,693
負債純資産合計	10,300,768	286,478,255

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自	平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		13,245		13,340,524
為替差損益		297,694		5,030,100
営業収益合計		310,939		8,310,424
営業費用				
支払利息		-		30
受託者報酬		696		9,632
委託者報酬		13,214		181,596
その他費用		1 21,719		1 13,055
営業費用合計		35,629		204,313
営業利益		275,310		8,106,111
経常利益		275,310		8,106,111
当期純利益		275,310		8,106,111
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		-		1,967
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		195,310
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		62,576
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		62,576
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		9,544,516
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		9,544,516
分配金		2 80,000		2 3,126,671
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		195,310		4,309,157

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首元本額	10,000,000円	10,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	275,571,977円
期中一部解約元本額	- 円	1,329,127円
2. 計算期間末日における受益権の総数	10,000,000口	284,242,850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4,309,157円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

1. 1	その他費用	主に、LEI指定に係る手数料であります。	主に、LEI指定に係る手数料であります。
2. 2	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(118,840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(156,470円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は275,310円(1万口当たり275.31円)であり、うち80,000円(1万口当たり80円)を分配金額としております。	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(1,880,047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(6,224,097円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,063,638円)及び分配準備積立金(188,774円)より分配対象額は14,356,556円(1万口当たり505.08円)であり、うち3,126,671円(1万口当たり110円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>	

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期 平成30年6月15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	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15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	13,302	13,320,360
合計	13,302	13,320,360

(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	第1期 平成29年6月15日 現在				第2期 平成30年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	9,853,640	-	9,765,352	88,288	276,901,589	-	279,933,323	3,031,734
アメリカ・ドル	7,033,564	-	6,958,330	75,234	196,032,522	-	198,826,755	2,794,233
イギリス・ポンド	556,808	-	545,415	11,393	16,194,789	-	16,342,555	147,766
イスラエル・ シェケル	6,269	-	6,228	41	125,495	-	125,501	6
オーストラリア・ ドル	797,176	-	806,361	9,185	22,594,154	-	22,522,653	71,501
カナダ・ドル	180,664	-	182,204	1,540	5,039,436	-	5,036,356	3,080
シンガポール・ ドル	304,194	-	302,632	1,562	9,277,669	-	9,340,704	63,035
ニュージー ランド・ドル	47,036	-	47,622	586	1,254,495	-	1,259,356	4,861
ユーロ	723,100	-	714,096	9,004	20,350,057	-	20,374,470	24,413
香港・ドル	204,829	-	202,464	2,365	6,032,972	-	6,104,973	72,001
合計	9,853,640	-	9,765,352	88,288	276,901,589	-	279,933,323	3,031,734

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 計算期間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。

計算期間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。

計算期間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。

- ・ 計算期間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。
- ・ 計算期間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) 計算期間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、計算期間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。

（関連当事者との取引に関する注記）

<p>第2期</p> <p>自 平成29年6月16日</p> <p>至 平成30年6月15日</p>
<p>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。</p>

（1口当たり情報）

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0195円 (10,195円)	0.9848円 (9,848円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	129,954,928	286,108,769	
親投資信託受益証券 合計			286,108,769	
合計			286,108,769	

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

「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。

（参考）

当ファンドは、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	61,378,229	49,907,321
金銭信託	-	1,711,640
コール・ローン	64,855,389	155,850,086
投資信託受益証券	-	137,679,722
投資証券	10,197,556,471	16,471,872,345
派生商品評価勘定	31,851	828,281
未収入金	573,219	197,007
未収配当金	18,929,834	32,903,547
差入委託証拠金	-	37,424,658
流動資産合計	10,343,324,993	16,888,374,607
資産合計	10,343,324,993	16,888,374,607
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	44,204	702,774
未払金	50,043,748	28,930,016
未払解約金	506,000	20,267,000
その他未払費用	-	2,034
流動負債合計	50,593,952	49,901,824
負債合計	50,593,952	49,901,824
純資産の部		
元本等		
元本	1	4,755,388,415
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,537,342,626	9,190,210,570

元本等合計	10,292,731,041	16,838,472,783
純資産合計	10,292,731,041	16,838,472,783
負債純資産合計	10,343,324,993	16,888,374,607

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16日 至 平成30年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(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 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 原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 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6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首	平成29年2月16日	平成29年6月16日
期首元本額	3,427,075,799円	4,755,388,415円
期中追加設定元本額	1,391,440,898円	3,327,846,253円
期中一部解約元本額	63,128,282円	434,972,455円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジあり）	2,420,500,015円	3,999,701,535円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジなし）	281,704,790円	540,038,266円

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	82,319,560円	323,038,547円
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	58,830,623円	227,561,132円
D-I's グローバルREITインデックス	1,195,511円	1,222,466円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	26,742円	35,023円
iFree 外国REITインデックス	54,511,259円	70,112,709円
iFree 8資産バランス	190,292,808円	453,719,542円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	1,334,908,648円	1,576,902,629円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	4,159,179円	3,424,485円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,461,836円	6,256,261円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,077,486円	1,336,304円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	288,484,097円	284,483,123円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	21,606,670円	25,922,759円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	4,691,021円	129,954,928円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	4,618,170円	4,552,504円
計	4,755,388,415円	7,648,262,213円
2. 期末日における受益権の総数	4,755,388,415口	7,648,262,213口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
--	--------------	--------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	-	3,726,817
投資証券	432,473,006	252,937,558
合計	432,473,006	249,210,741

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成28年12月1日から平成29年6月15日まで、及び平成29年12月1日から平成30年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	平成29年6月15日 現在				平成30年6月15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								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	-	-	-	-	164,465,621	-	164,086,117	379,504
合計	-	-	-	-	164,465,621	-	164,086,117	379,504

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	平成29年6月15日 現在			平成30年6月15日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	50,128,853	-	50,116,500	12,353	108,411,289	-	108,916,300	505,011
アメリカ・ドル	18,652,638	-	18,650,700	1,938	82,330,999	-	82,893,700	562,701
イギリス・ポンド	6,995,465	-	6,995,000	465	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	9,119,635	-	9,146,500	26,865	-	-	-	-
カナダ・ドル	4,970,034	-	4,969,800	234	-	-	-	-
シンガポール・ドル	10,391,081	-	10,354,500	36,581	10,666,392	-	10,674,600	8,208
ユーロ	-	-	-	-	15,413,898	-	15,348,000	65,898
合計	50,128,853	-	50,116,500	12,353	108,411,289	-	108,916,300	505,011

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.1644円	2.2016円
(1万口当たり純資産額)	(21,644円)	(22,016円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	15,600.000	アメリカ・ドル 1,243,944.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 1,243,944.000 (137,679,722)	
投資信託受益証券 合計				137,679,722 [137,679,722]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	9,200	アメリカ・ドル 367,724.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	10,100	75,447.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	13,482	299,030.760	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	13,800	337,548.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	18,400	3,094,512.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	41,547	6,815,785.350	
		BOSTON PROPERTIES INC	20,500	2,457,540.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	20,755	859,049.450	
		GGP INC	83,877	1,738,770.210	
		VORNADO REALTY TRUST	23,064	1,659,224.160	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	5,600	110,656.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	6,100	180,316.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	2,400	65,112.000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	6,400	257,472.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	49,200	3,136,500.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	27,900	522,846.000	
		EPR PROPERTIES	8,600	547,218.000	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,700	15,436.000	
		CITY OFFICE REIT INC	3,800	46,588.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	8,333	161,576.870	

FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8,029	184,586.710	
CHATHAM LODGING TRUST	5,400	110,052.000	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8,000	254,800.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,100	133,393.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6,600	552,288.000	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	35,200	711,392.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14,100	264,798.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,300	63,802.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	43,926.840	
HOST HOTELS & RESORTS INC	97,500	2,079,675.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	33,208	698,696.320	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	21,395	590,929.900	
CORESITE REALTY CORP	4,500	485,055.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	20,400	719,304.000	
RLJ LODGING TRUST	23,371	523,744.110	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	26,071.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	23,500	357,670.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	5,200	76,128.000	
CYRUSONE INC	12,800	751,744.000	
KIMCO REALTY CORP	56,500	933,945.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,800	16,236.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	27,050	677,332.000	
WHITESTONE REIT	4,400	53,284.000	
TIER REIT INC	6,400	146,816.000	
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	237	905.340	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,000	30,930.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	26,500	933,860.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17,700	341,964.000	
QUALITY CARE PROPERTIES	11,800	260,072.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	26,500	814,610.000	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	68,711	418,449.990	
INVITATION HOMES INC	37,897	849,650.740	
JBG SMITH PROPERTIES	12,132	457,861.680	
ALEXANDER & BALDWIN INC	8,433	177,177.330	
CLIPPER REALTY INC	1,400	13,902.000	
GLADSTONE LAND CORP	900	11,475.000	
INFRAREIT INC	4,700	97,666.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	6,000	130,020.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2,500	54,975.000	

SPIRIT MTA REIT	5,870	59,287.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	24,160	188,689.600	
CORECIVIC INC	15,524	328,953.560	
STORE CAPITAL CORP	21,800	585,984.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	12,800	182,016.000	
LIFE STORAGE INC	6,200	578,274.000	
SELECT INCOME REIT	8,200	176,136.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,400	201,528.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	9,982	100,119.460	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	4,200	61,908.000	
PARAMOUNT GROUP INC	26,500	399,885.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16,500	279,015.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	10,200	321,300.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	15,200	337,440.000	
STAG INDUSTRIAL INC	12,500	330,750.000	
VENTAS INC	47,579	2,588,773.390	
CARETRUST REIT INC	9,803	163,514.040	
GEO GROUP INC/THE	16,300	406,522.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	40,200	697,470.000	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	13,100	188,640.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	23,387	500,014.060	
UMH PROPERTIES INC	4,200	61,992.000	
IRON MOUNTAIN INC	37,400	1,271,226.000	
TERRENO REALTY CORP	7,100	267,599.000	
VEREIT INC	128,408	929,673.920	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	58,700	477,231.000	
SUN COMMUNITIES INC	10,600	1,023,112.000	
ACADIA REALTY TRUST	11,111	302,663.640	
ALEXANDER'S INC	500	191,520.000	
PROLOGIS INC	71,246	4,589,667.320	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,500	1,723,410.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	23,100	372,141.000	
SAUL CENTERS INC	1,300	65,234.000	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	124,132.450	
MACK-CALI REALTY CORP	11,600	228,404.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	12,300	1,108,968.000	
COUSINS PROPERTIES INC	55,807	541,327.900	
DDR CORP	19,578	337,720.500	
DUKE REALTY CORP	47,100	1,344,705.000	

EASTGROUP PROPERTIES INC	4,600	434,286.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,867	2,082,237.610	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	16,000	532,160.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,700	1,174,573.000	
GETTY REALTY CORP	4,203	111,463.560	
WELLTOWER INC	49,200	2,835,888.000	
HCP INC	62,700	1,496,649.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13,700	662,258.000	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	22,000	625,680.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	16,700	452,403.000	
EQUITY COMMONWEALTH	16,575	512,830.500	
KILROY REALTY CORP	13,000	987,870.000	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	14,600	518,592.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	19,600	867,888.000	
LTC PROPERTIES INC	5,100	216,342.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	27,700	238,774.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,128	1,465,449.360	
MACERICH CO/THE	14,500	813,740.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,800	1,082,650.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,300	394,850.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	20,200	851,834.000	
REALTY INCOME CORP	37,717	1,998,623.830	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	13,100	358,809.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	96,750.000	
PUBLIC STORAGE	20,000	4,289,200.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,700	334,125.000	
REGENCY CENTERS CORP	19,520	1,171,395.200	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	10,100	128,977.000	
ISTAR INC	8,400	91,140.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	11,800	263,258.000	
SL GREEN REALTY CORP	12,000	1,174,080.000	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	31,600	552,368.000	
TAUBMAN CENTERS INC	7,800	435,396.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,500	76,475.000	
UDR INC	35,600	1,320,760.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,600	101,280.000	
WP CAREY INC	14,100	944,277.000	
WASHINGTON REIT	10,400	302,848.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	15,400	462,154.000	

ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,300	80,230.000	
AGREE REALTY CORP	3,900	209,859.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	26,050	814,583.500	
CUBESMART	23,900	749,504.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30,126	498,886.560	
DIGITAL REALTY TRUST INC	27,478	2,929,979.140	
CEDAR REALTY TRUST INC	6,900	30,636.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	16,700	1,628,751.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,475	93,751.250	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	13,300	75,145.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	10,550	172,809.000	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	9,700	149,962.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,500	38,640.000	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	17,900	765,404.000	
EDUCATION REALTY TRUST INC	10,100	407,131.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,600	67,572.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	25,642	314,627.340	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	6,849	97,598.250	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	48,100	664,742.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,700	106,860.000	
DOUGLAS EMMETT INC	20,900	809,457.000	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	12,500	820,625.000	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	29,500	383,205.000	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	151,527	133,343.760	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 105,938,122.460 (11,725,231,394)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
ASSURA PLC	313,840	177,947.280	
CAPITAL & REGIONAL PLC	59,270	32,302.150	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	75,350	64,801.000	
REGIONAL REIT LTD	35,960	34,162.000	
NEWRIVER REIT PLC	38,200	110,016.000	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	22,490	23,164.700	
LXI REIT PLC	21,160	23,487.600	
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	7,570	6,934.120	
RDI REIT PLC	173,260	61,334.040	
LAND SECURITIES GROUP PLC	101,931	972,115.940	

	HANSTEEN HOLDINGS PLC	50,320	54,244.960	
	SEGRO PLC	134,140	898,738.000	
	HAMMERSON PLC	107,610	576,143.940	
	UNITE GROUP PLC	35,490	307,698.300	
	BRITISH LAND CO PLC	134,840	933,092.800	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	37,001	260,080.020	
	INTU PROPERTIES PLC	117,040	225,770.160	
	DERWENT LONDON PLC	14,950	458,068.000	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	95,870	109,483.540	
	WORKSPACE GROUP PLC	15,500	174,685.000	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	28,240	162,944.800	
	SHAFTESBURY PLC	33,350	310,822.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	19,300	189,912.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	89,220	167,822.820	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	58,830	37,004.070	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	193,330	298,888.180	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 6,671,663.420 (978,466,158)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	9,340	136,737.600	イスラエル・シュケル
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 136,737.600 (4,186,905)	
オーストラリ ア・ドル	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	29,900	81,029.000	オーストラリア・ドル
	CROMWELL PROPERTY GROUP	207,420	228,162.000	
	RURAL FUNDS GROUP	31,950	67,734.000	
	VIVA ENERGY REIT	56,900	120,059.000	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	22,520	97,511.600	
	PROPERTYLINK GROUP	49,060	51,513.000	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	98,450	243,171.500	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	31,830	112,996.500	
	NATIONAL STORAGE REIT	70,710	111,014.700	
	INDUSTRIA REIT	11,760	29,988.000	
	GDI PROPERTY GROUP	69,120	88,473.600	
	SCENTRE GROUP	722,520	3,041,809.200	
	ARENA REIT	35,380	79,605.000	

	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15,310	49,298.200	
	BWP TRUST	63,710	207,694.600	
	DEXUS	136,950	1,314,720.000	
	GPT GROUP	244,920	1,227,049.200	
	INVESTA OFFICE FUND	67,500	347,625.000	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	43,440	183,751.200	
	MIRVAC GROUP	505,600	1,127,488.000	
	STOCKLAND	330,360	1,370,994.000	
	ABACUS PROPERTY GROUP	40,470	154,190.700	
	GOODMAN GROUP	217,510	2,064,169.900	
	VICINITY CENTRES	438,510	1,157,666.400	
	CHARTER HALL GROUP	62,340	397,729.200	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	22,530	60,605.700	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 14,016,049.200 (1,156,744,541)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,000	119,340.000	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	12,400	177,940.000	
	SLATE RETAIL REIT - U	1,700	21,930.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5,300	79,447.000	
	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2,700	36,801.000	
	SLATE OFFICE REIT	2,800	21,112.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	5,600	63,224.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	4,500	38,655.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,000	159,360.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	5,200	54,392.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,900	64,428.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	17,600	212,080.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,700	26,316.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5,200	67,756.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	8,500	256,955.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,300	395,529.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	10,790	134,767.100	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	18,766	377,571.920	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2,300	30,406.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21,400	511,032.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	129,222.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,800	129,976.000	

	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3,100	80,972.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	4,900	63,308.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	6,000	247,020.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 3,499,540.020 (295,116,210)	
シンガポール・ ドル	KEPPEL DC REIT	124,928	171,151.360	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	66,800	92,184.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	283,500	328,860.000	
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	73,900	102,721.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	201,450	213,537.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	368,075	603,643.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	325,900	853,858.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	363,000	736,890.000	
	SUNTEC REIT	301,000	511,700.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	271,400	333,822.000	
	KEPPEL REIT	235,000	263,200.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	78,460	108,274.800	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	166,500	181,485.000	
	ESR-REIT	175,437	84,209.760	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	97,600	157,136.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	72,000	159,120.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	176,900	117,638.500	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	74,000	113,960.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	49,400	129,922.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	208,800	65,772.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	158,180	306,869.200	
	CACHE LOGISTICS TRUST	145,200	111,804.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	250,500	393,285.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	94,900	63,583.000	
	SPH REIT	70,500	70,500.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	64,900	42,185.000	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	78,100	33,973.500		
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	84,800	65,720.000		
QUE HOSPITALITY TRUST	140,673	110,428.300		
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 6,527,432.420 (536,554,946)	

ニュージーランド ド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	40,300	73,346.000	
	INVESTORE PROPERTY LTD	23,130	34,926.300	
	ARGOSY PROPERTY LTD	109,000	116,630.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	188,730	257,616.450	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	44,560	90,456.800	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	137,750	194,916.250	
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	131,170	171,832.700		
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 939,724.500 (72,293,006)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	18,700	243,661.000	
	HAMBORNER REIT AG	10,680	99,003.600	
	WERELDHAVE NV	5,200	172,484.000	
	UNIBAIL GROUP STAPLED	18,170	3,479,555.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	6,410	231,016.400	
	NSI NV	2,391	86,912.850	
	VASTNED RETAIL NV	2,050	83,640.000	
	ICADE	5,990	492,378.000	
	ALTAREA	470	93,906.000	
	GECINA SA	6,451	926,363.600	
	KLEPIERRE	27,800	927,964.000	
	COVIVIO	7,260	650,496.000	
	MERCIALYS	7,050	108,640.500	
	AEDIFICA	2,408	190,713.600	
	COFINIMMO	2,650	285,670.000	
	BEFIMMO	2,970	155,628.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1,740	37,149.000	
	RETAIL ESTATES	980	75,950.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,160	229,824.000	
	BENI STABILI SPA	127,410	97,086.420	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	45,233.760	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11,970	110,004.300	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	43,160	403,546.000		
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	14,090	248,547.600		
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	1,290	21,930.000		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	44,690	538,961.400		
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	40,860	54,752.400		

	GREEN REIT PLC	89,970	137,654.100	
	HIBERNIA REIT PLC	86,690	132,809.080	
ユーロ	小計		ユーロ 10,361,480.610 (1,325,233,370)	
香港・ドル			香港・ドル	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	146,000	798,620.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	132,000	728,640.000	
	FORTUNE REIT	188,000	1,769,080.000	
	PROSPERITY REIT	158,000	513,500.000	
	LINK REIT	296,000	21,134,400.000	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	106,000	355,100.000	
	CHAMPION REIT	277,000	1,512,420.000	
香港・ドル	小計		香港・ドル 26,811,760.000 (378,045,815)	
投資証券	合計		16,471,872,345 [16,471,872,345]	
合計			16,609,552,067 [16,609,552,067]	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 投資証券 1銘柄 161銘柄	1.2%	98.8%	71.4%
イギリス・ポンド	投資証券 26銘柄	-%	100%	5.9%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 26銘柄	-%	100%	7.0%
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券 29銘柄	-%	100%	3.2%
ニュージーランド・ドル	投資証券 7銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 29銘柄	-%	100%	8.0%
香港・ドル	投資証券 7銘柄	-%	100%	2.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成29年6月16日から平成30年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	234
コール・ローン	15,000	21,279
親投資信託受益証券	9,995,567	10,022,792
流動資産合計	10,010,567	10,044,305
資産合計	10,010,567	10,044,305
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	100,000	330,000
未払受託者報酬	673	982
未払委託者報酬	13,021	19,350
その他未払費用	119	182
流動負債合計	113,813	350,514
負債合計	113,813	350,514
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,000,000	1 10,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 103,246	2 306,209
（分配準備積立金）	19,574	39,991
元本等合計	9,896,754	9,693,791
純資産合計	9,896,754	9,693,791
負債純資産合計	10,010,567	10,044,305

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自	平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		10,567		169,225
営業収益合計		10,567		169,225
営業費用				
受託者報酬		673		2,063
委託者報酬		13,021		39,760
その他費用		119		365
営業費用合計		13,813		42,188
営業利益又は営業損失()		3,246		127,037
経常利益又は経常損失()		3,246		127,037
当期純利益又は当期純損失()		3,246		127,037
期首剰余金又は期首欠損金()		-		103,246
分配金		1 100,000		1 330,000
期末剰余金又は期末欠損金()		103,246		306,209

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期	
	自 平成29年6月16日	至 平成30年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年6月15日現在	平成30年6月15日現在
1. 1 期首元本額	10,000,000円	10,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	10,000,000口	10,000,000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103,246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306,209円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 平成29年2月16日 至 平成29年6月15日	自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

<p>1 分配金の計算過程</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（119,574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（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は119,574円（1万口当たり119.57円）であり、うち100,000円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（350,417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（0円）及び分配準備積立金（19,574円）より分配対象額は369,991円（1万口当たり369.99円）であり、うち330,000円（1万口当たり330円）を分配金額としております。</p>
-------------------	--	---

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第2期 平成30年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15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	10,712	169,330
合計	10,712	169,330

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 平成29年6月16日 至 平成30年6月15日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第1期 平成29年6月15日現在	第2期 平成30年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9897円 (9,897円)	0.9694円 (9,694円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	4,552,504	10,022,792	
親投資信託受益証券 合計			10,022,792	
合計			10,022,792	

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、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)」に記載のとおりであります。

2 【ファンドの現況】

ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）

【純資産額計算書】

平成30年6月29日

資産総額	97,437,933円
負債総額	12,803円
純資産総額（ - ）	97,425,130円
発行済数量	86,142,897口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1310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30年6月29日

資産総額	155,156,224,427円
負債総額	11,773,371,253円
純資産総額（ - ）	143,382,853,174円
発行済数量	131,699,076,824口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0887円

ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	26,622,491円
負債総額	3,489円
純資産総額（ - ）	26,619,002円
発行済数量	22,987,038口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1580円

(参考) ストックインデックス225・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	156,048,961,812円
------	------------------

負債総額	2,441,728,417円
純資産総額(-)	153,607,233,395円
発行済数量	56,259,753,379口
1単位当たり純資産額(/)	2.7303円

ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	578,360,259円
負債総額	144,407円
純資産総額(-)	578,215,852円
発行済数量	519,022,943口
1単位当たり純資産額(/)	1.1140円

(参考) 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	34,983,974,219円
負債総額	430,618,942円
純資産総額(-)	34,553,355,277円
発行済数量	18,728,215,582口
1単位当たり純資産額(/)	1.8450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)

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	1,096,159円
負債総額	196円
純資産総額(-)	1,095,963円
発行済数量	1,000,000口
1単位当たり純資産額(/)	1.0960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30年6月29日

資産総額	101,247,191,104円
負債総額	48,839,841円
純資産総額(-)	101,198,351,263円
発行済数量	41,980,030,940口
1単位当たり純資産額(/)	2.4106円

ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	2,277,241,721円
負債総額	49,295円
純資産総額(-)	2,277,192,426円
発行済数量	2,248,607,841口
1単位当たり純資産額(/)	1.0127円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	76,376,217,059円
負債総額	117,173,015円
純資産総額(-)	76,259,044,044円
発行済数量	54,369,117,216口
1単位当たり純資産額(/)	1.4026円

ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	2,005,916,165円
負債総額	245,661円
純資産総額(-)	2,005,670,504円
発行済数量	2,003,320,323口
1単位当たり純資産額(/)	1.0012円

(参考) 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	67,877,253,117円
負債総額	766,746,475円
純資産総額(-)	67,110,506,642円
発行済数量	70,010,611,552口
1単位当たり純資産額(/)	0.9586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)

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	1,005,640円
負債総額	168円
純資産総額(-)	1,005,472円
発行済数量	1,000,000口
1単位当たり純資産額(/)	1.0055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30年6月29日

資産総額	165,013,463,720円
負債総額	116,261,364円
純資産総額(-)	164,897,202,356円
発行済数量	60,597,290,881口
1単位当たり純資産額(/)	2.7212円

ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	152,708,047円
負債総額	26,105円
純資産総額(-)	152,681,942円

発行済数量	149,230,565口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0231円

(参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	216,892,282,186円
負債総額	678,774,678円
純資産総額（ - ）	216,213,507,508円
発行済数量	84,411,394,066口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.5614円

ダイワ外国R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	162,378,636円
負債総額	2,637,858円
純資産総額（ - ）	159,740,778円
発行済数量	159,085,081口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0041円

(参考) ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	17,152,172,999円
負債総額	55,385,551円
純資産総額（ - ）	17,096,787,448円
発行済数量	7,641,438,592口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.2374円

ダイワ外国R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

純資産額計算書

平成30年6月29日

資産総額	9,851,373円
負債総額	1,596円
純資産総額（ - ）	9,849,777円
発行済数量	10,000,000口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9850円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）」の記載と同じ。

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2018年6月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年6月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	81	186,533
追加型株式投資信託	708	15,390,018
株式投資信託 合計	789	15,576,552
単位型公社債投資信託	25	99,407
追加型公社債投資信託	14	1,494,843
公社債投資信託 合計	39	1,594,250
総合計	828	17,170,801

3 【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1 229	1 213
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066
投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45
その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

（単位:百万円）

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2 4,946	2 4,476
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
固定負債		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	264	216

評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973
賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316
役員退職慰労引当金繰入額	60	46

固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-

当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物 10～18年

器具備品 4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

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

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				

普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成29年3月31日)

(単位:百万円)

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

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金・預金	28,709	28,709	-
(2)未収委託者報酬	12,368	12,368	-
(3)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,631	7,631	-
資産計	48,709	48,709	-
(1)未払手数料	(5,202)	(5,202)	-
(2)その他未払金	(4,476)	(4,476)	-
(3)未払費用(*2)	(3,286)	(3,286)	-
負債計	(12,965)	(12,965)	-

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1)金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成29年3月31日）

(単位：百万円)

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

当事業年度（平成30年3月31日）

(単位：百万円)

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

合計	41,078	5,302	1,801	117
----	--------	-------	-------	-----

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成29年3月31日)

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

当事業年度(平成30年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成29年3月31日)

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

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

当事業年度(平成30年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	134	55	79
(2) その他			
証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他 証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,209百万円	2,318百万円
勤務費用	202	159

退職給付の支払額	122	166
その他	29	38
退職給付債務の期末残高	2,318	2,350

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

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		719

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

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

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,701	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

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

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

<日経225インデックス>

名称 みずほ信託銀行株式会社

資本金の額 247,369百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容

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

<その他各ファンド>

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 (2018年3月 末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	(注)

(注) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

<日経225インデックス>

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

資本金の額：50,000百万円（2018年3月末日現在）

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

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

<その他各ファンド>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2018年3月末日現在）

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

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

第3 【参考情報】

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

（提出年月日）	（書類名）
2017年9月8日	有価証券報告書、有価証券届出書の訂正届出書
2018年1月22日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年3月8日	半期報告書、有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

平成30年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の平成29年6月16日から平成30年6月15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TOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の平成29年6月16日から平成30年6月15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、ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の平成29年6月16日から平成30年6月15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、ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている「ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）」の平成29年6月16日から平成30年6月15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J-REITインデックス（ダイワSMA専用）」の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の平成29年6月16日から平成30年6月15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、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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）の平成29年6月16日から平成30年6月15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、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の平成29年6月16日から平成30年6月15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、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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）の平成29年6月16日から平成30年6月15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、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の平成29年6月16日から平成30年6月15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、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の平成29年6月16日から平成30年6月15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、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。