

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2019年8月23日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【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】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワライフスタイル7 5
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワライフスタイル75

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問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 <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

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

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)
電話番号(コールセンター) 0120-106212
(営業日の9:00~17:00)

(7) 【申込期間】

2019年8月24日から2020年2月21日まで(継続申込期間)
(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

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

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

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

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし
	対象インデックス	その他の指数（合成インデックス）

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

(注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「内外」…目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- ・「資産複合」…目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- ・「インデックス型」…目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」…目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの

- ・「ファミリーファンド」...目論見書等において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するもの
- ・「為替ヘッジなし」...目論見書等において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
- ・「その他の指数」...日経225、TOPIXにあてはまらないすべてのもの

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	
		その他資産 ()	特殊型
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

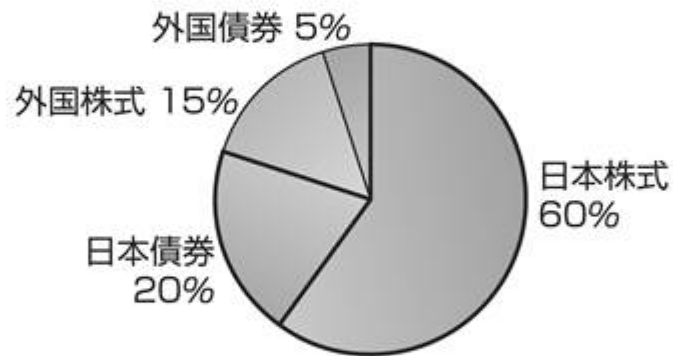
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国内	海外	合計
株式	60%	15%	75%
債券	20%	5%	25%
合計	80%	20%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

2

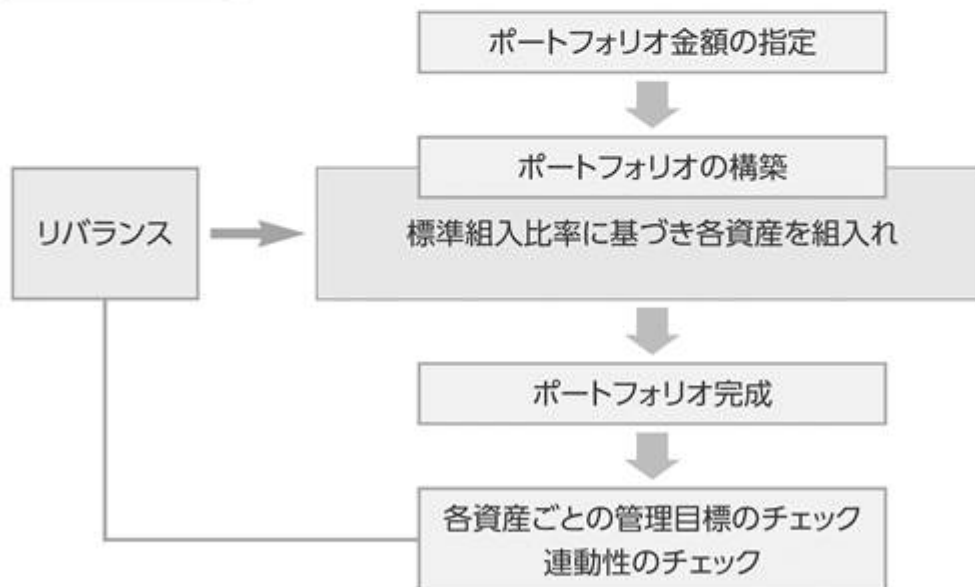
各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



- ・市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。
- ・保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

3

毎年11月30日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

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

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

各マザーファンドの運用プロセス

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

2. 日本債券インデックスマザーファンド

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あげること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、マルチファクターモデル^(注)の使用により効率的なDBI総合指数の複製を行ない同指数と連動するポートフォリオを構築します。またDBI総合指数の構成銘柄変更等に対しては、マルチファクターモデルを使用しポートフォリオのリバランスを行いません。

(注) 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。このモデルを用いることにより、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することができます。

ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数とは

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・インデックスであり、下記の債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

対象：日本で発行されている確定利付公募債券

残存額：50億円以上

期間：残存期間1年以上

種類：国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債

3. 外国株式インデックスマザーファンド

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

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

M S C I コクサイ指数とは

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

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

4. 外国債券インデックスマザーファンド

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

(2) 【ファンドの沿革】

2000年 4月28日

信託契約締結、当初設定、運用開始

2000年12月 1日

ファンドの名称の変更（従来は「ライフスタイル75」）

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ）

お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 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</p> <p style="text-align: right;">など</p>
1	収益分配金、償還金など	お申込金（ 3 ）
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成</p> <p style="text-align: right;">など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3 ）
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算</p> <p style="text-align: right;">など</p>
3	損益	投資
投資対象	<p>東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）、わが国の公社債、外国の株式（預託証券を含みます。）、外国の公社債 など</p> <p>（ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）</p>	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を經由して、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（2019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

トピックス・インデックス・マザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンドおよび外国債券インデックスマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

< 標準組入比率 >

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の60%

日本債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の5%

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

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

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

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

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】

委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から4．までに掲げる親投資信託（以下、総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の5．から25．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券
2. 日本債券インデックスマザーファンド受益証券
3. 外国株式インデックスマザーファンド受益証券
4. 外国債券インデックスマザーファンド受益証券
5. 株券または新株引受権証書
6. 国債証券
7. 地方債証券
8. 特別の法律により法人の発行する債券
9. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー

15. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前5.から前15.までの証券または証書の性質を有するもの
17. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
18. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
19. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
20. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
23. 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。)
24. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
25. 外国の者に対する権利で前24.の有価証券の性質を有するもの

なお、前5.の証券または証書ならびに前16.および前20.の証券または証書のうち前5.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前6.から前10.までの証券ならびに前18.の証券のうち投資法人債券ならびに前16.および前20.の証券または証書のうち前6.から前10.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前17.の証券および前18.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

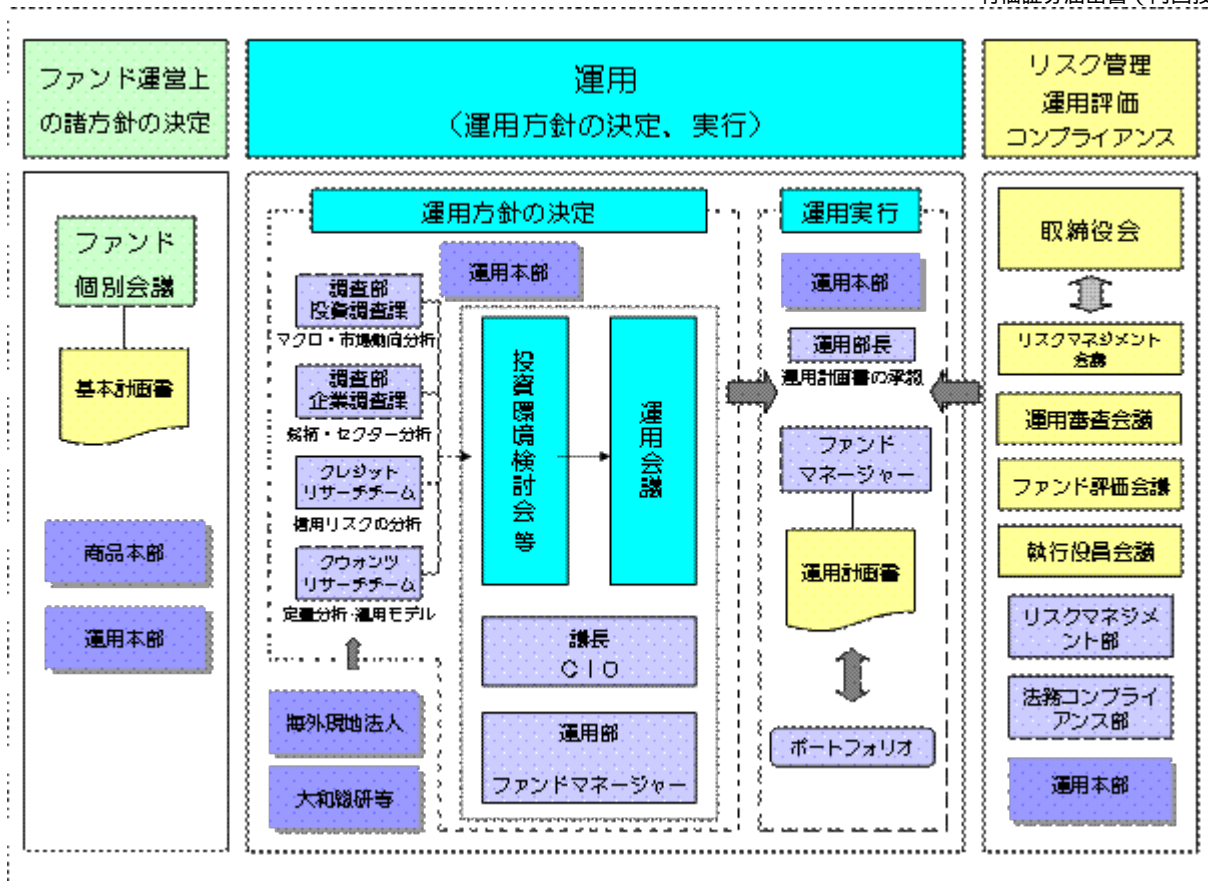
前 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前 1.から4.の金融商品により運用することの指図ができます。

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。

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

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

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2019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。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

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します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等（信託約款）

- イ．委託会社は、取得時において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、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。

投資信託証券（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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。

投資する株式等の範囲（信託約款）

- イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ロ．前イ．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとし、

同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

信用取引（信託約款）

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

ロ．信用取引の指図は、次の1.から6.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.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り、）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

先物取引等（信託約款）

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

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

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

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

引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

八．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これらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

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

スワップ取引(信託約款)

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八.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。

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ホ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ヘ．前ホ.においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ト．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- チ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

デリバティブ取引等（信託約款）

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

同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

ロ．前イ．の1.および2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

外貨建資産（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

信用リスク集中回避（信託約款）

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

資金の借入れ(信託約款)

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または解約代金入金日までの間もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<参考> マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

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。

基本的な投資態度

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

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。

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。

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

(注) 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

2. 日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主としてわが国の公社債に投資し、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。
- 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。

(2) 投資対象

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資は、行ないません。

（注）ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数とは

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・インデックスであり、下記の債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

対 象：日本で発行されている確定利付公募債券

残存額：50億円以上

期 間：残存期間1年以上

種 類：国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債

3. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

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

(2) 投資対象

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

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

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

20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）MSCIコクサイ指数とは

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

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

4. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

イ. 主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

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

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

(2) 投資対象

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注) FTSE世界国債インデックスとは

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

なお、当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。このため、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カンントリー・リスク

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

その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3) その他の留意点

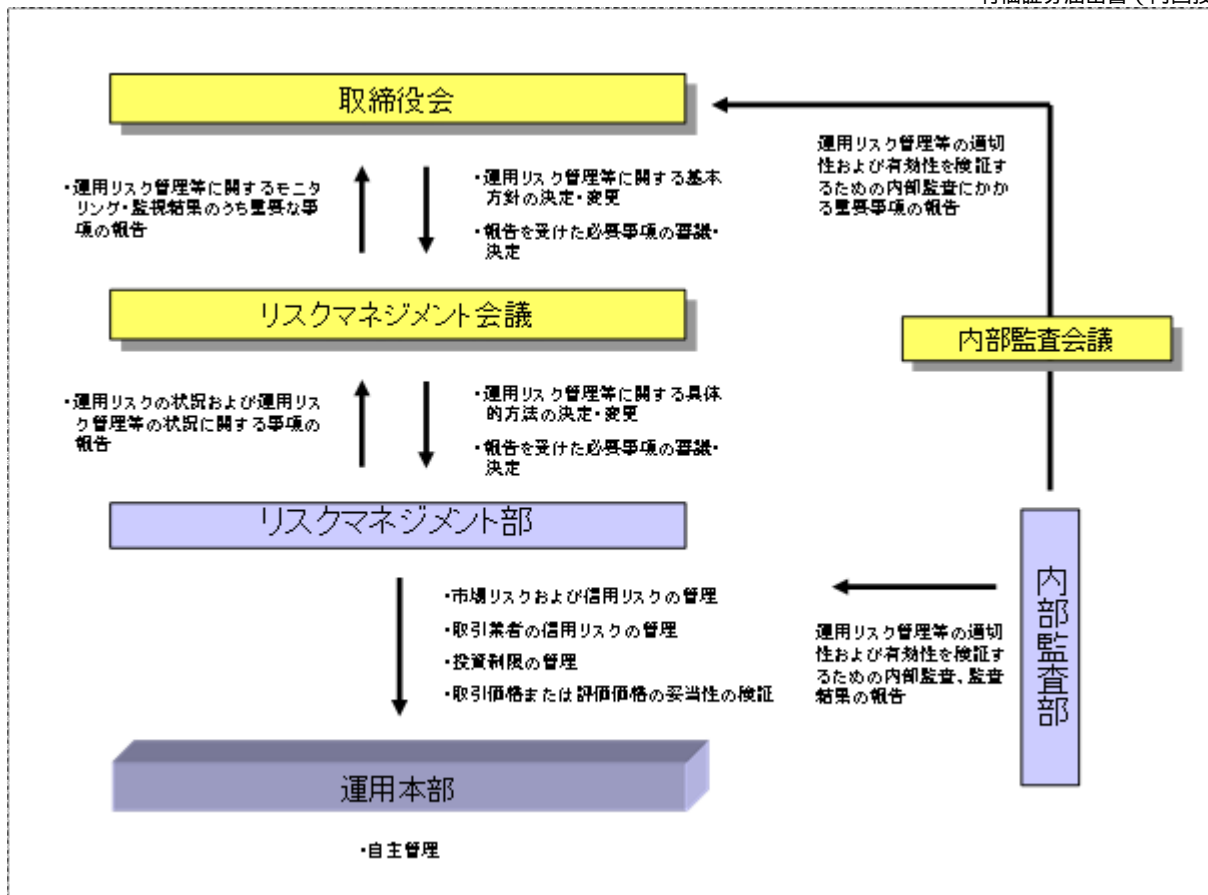
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

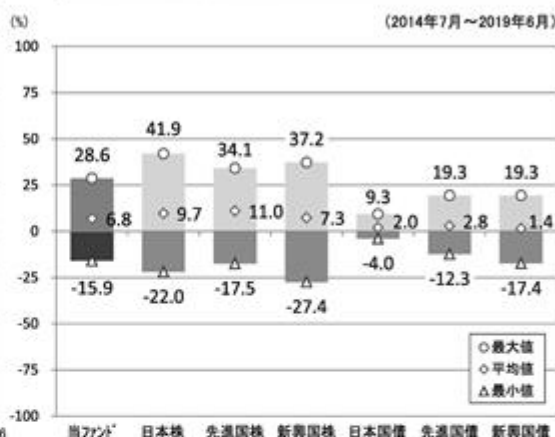
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
日本国債：NOMURA-BPI国債
先進国債：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.

(1) 【申込手数料】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.972%（税抜0.90%）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信託財産中から支弁するものとします。

消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.99%となります。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.35% （税抜）	年率0.47% （税抜）	年率0.08% （税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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。

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

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

少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「N I S A（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたN I S Aをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアN I S A」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

- () 上記は、2019年6月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2019年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	937,801,587	99.71
内 日本	937,801,587	99.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,736,964	0.29
純資産総額	940,538,551	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】（2019年6月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	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	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	562,515,109	1.0531 592,435,642	0.9985 561,671,336	59.72
2	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	130,585,051	1.3983 182,605,417	1.4398 188,016,356	19.99
3	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	55,789,638	2.4431 136,301,916	2.5291 141,097,573	15.00
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	16,751,460	2.7603 46,239,405	2.8067 47,016,322	5.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.71%
合計	99.71%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(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10計算期間末 (2009年11月30日)	275,496,805	275,496,805	0.7254	0.7254
第11計算期間末 (2010年11月30日)	317,352,187	317,352,187	0.7453	0.7453
第12計算期間末 (2011年11月30日)	312,447,792	312,447,792	0.6722	0.6722
第13計算期間末 (2012年11月30日)	362,100,467	362,100,467	0.7401	0.7401
第14計算期間末 (2013年12月2日)	537,151,204	537,151,204	1.0806	1.0806
第15計算期間末 (2014年12月1日)	647,563,978	647,563,978	1.2277	1.2277
第16計算期間末 (2015年11月30日)	734,908,867	734,908,867	1.3210	1.3210
第17計算期間末 (2016年11月30日)	760,338,807	760,338,807	1.2701	1.2701
第18計算期間末 (2017年11月30日)	937,336,300	937,336,300	1.4842	1.4842
2018年6月末日	954,419,185	-	1.4597	-
7月末日	973,467,911	-	1.4785	-
8月末日	985,963,616	-	1.4716	-
9月末日	1,022,396,230	-	1.5255	-
10月末日	954,710,702	-	1.4162	-
第19計算期間末 (2018年11月30日)	964,868,778	964,868,778	1.4329	1.4329

12月末日	887,925,382	-	1.3235	-
2019年1月末日	938,760,046	-	1.3738	-
2月末日	953,348,103	-	1.4079	-
3月末日	947,621,016	-	1.4119	-
4月末日	962,497,496	-	1.4332	-
5月末日	920,442,773	-	1.3637	-
6月末日	940,538,551	-	1.3946	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
2018年12月1日～ 2019年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第10計算期間	5.6
第11計算期間	2.7
第12計算期間	9.8
第13計算期間	10.1
第14計算期間	46.0
第15計算期間	13.6
第16計算期間	7.6
第17計算期間	3.9
第18計算期間	16.9
第19計算期間	3.5
2018年12月1日～ 2019年5月31日	4.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第10計算期間	83,697,312	23,652,130
第11計算期間	81,429,409	35,405,267
第12計算期間	72,376,535	33,373,557
第13計算期間	68,276,957	43,805,781
第14計算期間	106,367,593	98,573,500
第15計算期間	88,503,723	58,126,096
第16計算期間	101,015,060	72,136,389
第17計算期間	85,325,672	42,999,115
第18計算期間	91,122,014	58,225,626
第19計算期間	88,023,270	46,224,810
2018年12月1日～ 2019年5月31日	38,577,332	36,978,671

(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 (2019年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	136,528,797,240	99.28
内 日本	136,528,797,240	99.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	987,472,928	0.72
純資産総額	137,516,270,168	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,209,780,000	0.88
内 日本	1,209,780,000	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。

(2) 投資資産 (2019年6月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	684,700	7,002.13 4,794,358,634	6,688.00 4,579,273,600	3.33
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	502,600	5,432.23 2,730,241,635	5,165.00 2,595,929,000	1.89
3	ソニー	日本	株式	電気機 器	412,300	6,605.26 2,723,352,608	5,648.00 2,328,670,400	1.69
4	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,172,000	694.17 2,896,112,059	512.00 2,136,064,000	1.55
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	412,400	5,132.86 2,116,793,830	5,017.00 2,069,010,800	1.50
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	536,400	4,556.67 2,444,200,308	3,823.00 2,050,657,200	1.49
7	キーエンス	日本	株式	電気機 器	30,200	63,227.90 1,909,482,653	66,130.00 1,997,126,000	1.45
8	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	427,100	4,506.32 1,924,650,475	3,806.00 1,625,542,600	1.18
9	リクルートホールディン グス	日本	株式	サービ ス業	420,600	3,643.31 1,532,380,234	3,594.00 1,511,636,400	1.10
10	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	518,400	3,360.02 1,741,839,491	2,785.00 1,443,744,000	1.05
11	任天堂	日本	株式	その他 製品	35,200	39,807.41 1,401,221,162	39,490.00 1,390,048,000	1.01
12	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	494,300	3,066.57 1,515,807,494	2,743.50 1,356,112,050	0.99
13	みずほフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	8,233,500	196.65 1,619,139,859	156.10 1,285,249,350	0.93
14	花王	日本	株式	化学	149,200	9,005.24 1,343,583,051	8,210.00 1,224,932,000	0.89
15	三菱商事	日本	株式	卸売業	424,700	3,440.64 1,461,240,474	2,840.00 1,206,148,000	0.88
16	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	55,000	23,215.72 1,276,864,735	21,580.00 1,186,900,000	0.86
17	ダイキン工業	日本	株式	機械	83,800	15,440.65 1,293,927,266	14,065.00 1,178,647,000	0.86
18	東京海上HD	日本	株式	保険業	216,600	5,446.76 1,179,768,304	5,399.00 1,169,423,400	0.85

19	ファナック	日本	株式	電気機器	58,400	21,966.60 1,282,849,654	19,930.00 1,163,912,000	0.85
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	109,300	10,625.98 1,161,419,768	10,080.00 1,101,744,000	0.80
21	日立	日本	株式	電気機器	276,500	3,730.31 1,031,431,359	3,949.00 1,091,898,500	0.79
22	日本電産	日本	株式	電気機器	74,000	16,358.09 1,210,498,675	14,725.00 1,089,650,000	0.79
23	信越化学	日本	株式	化学	106,000	9,825.51 1,041,504,206	10,035.00 1,063,710,000	0.77
24	キヤノン	日本	株式	電気機器	330,800	3,520.44 1,164,564,730	3,146.00 1,040,696,800	0.76
25	HOYA	日本	株式	精密機器	123,700	6,647.96 822,352,660	8,254.00 1,021,019,800	0.74
26	資生堂	日本	株式	化学	122,100	7,912.72 966,143,938	8,121.00 991,574,100	0.72
27	第一三共	日本	株式	医薬品	175,800	4,600.86 808,832,455	5,635.00 990,633,000	0.72
28	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	381,800	3,014.14 1,150,801,071	2,512.50 959,272,500	0.70
29	村田製作所	日本	株式	電気機器	193,400	5,930.90 1,147,036,173	4,840.00 936,056,000	0.68
30	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	69,400	11,724.38 813,672,509	13,340.00 925,796,000	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	99.28%
合計	99.28%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.11%
鉱業	0.27%
建設業	2.78%
食料品	4.09%
繊維製品	0.65%

パルプ・紙	0.28%
化学	7.35%
医薬品	5.45%
石油・石炭製品	0.62%
ゴム製品	0.78%
ガラス・土石製品	0.86%
鉄鋼	0.90%
非鉄金属	0.77%
金属製品	0.55%
機械	5.14%
電気機器	13.51%
輸送用機器	7.78%
精密機器	2.12%
その他製品	2.15%
電気・ガス業	1.65%
陸運業	4.69%
海運業	0.16%
空運業	0.54%
倉庫・運輸関連業	0.20%
情報・通信業	8.84%
卸売業	4.92%
小売業	4.52%
銀行業	5.82%
証券、商品先物取引業	0.75%
保険業	2.27%
その他金融業	1.12%
不動産業	2.38%
サービス業	5.24%
合計	99.28%

(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 2019年9月	買建	78	1,198,049,120	1,209,780,000	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。

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2019年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	69,647,848,390	86.42
内 日本	69,647,848,390	86.42
地方債証券	4,263,713,900	5.29
内 日本	4,263,713,900	5.29
特殊債券	2,940,989,700	3.65
内 日本	2,940,989,700	3.65
社債券	3,121,950,600	3.87
内 日本	3,121,950,600	3.87
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	614,297,064	0.76
純資産総額	80,588,799,654	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 (2019年6月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	127 5年国債	日本	国債証券	1,380,000,000	100.54 1,387,462,600	100.54 1,387,493,400	0.100000 2021/03/20	1.72
2	129 5年国債	日本	国債証券	1,020,000,000	100.64 1,026,579,000	100.72 1,027,395,000	0.100000 2021/09/20	1.27
3	128 5年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	100.60 1,006,000,000	100.63 1,006,330,000	0.100000 2021/06/20	1.25

4	125 5年国債	日本	国債証券	940,000,000	100.44 944,145,400	100.36 943,449,800	0.100000 2020/09/20	1.17
5	130 5年国債	日本	国債証券	930,000,000	100.71 936,611,900	100.80 937,505,100	0.100000 2021/12/20	1.16
6	131 5年国債	日本	国債証券	920,000,000	100.76 926,992,000	100.90 928,298,400	0.100000 2022/03/20	1.15
7	135 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.94 888,342,200	101.29 891,387,200	0.100000 2023/03/20	1.11
8	343 10年国債	日本	国債証券	830,000,000	101.05 838,789,700	102.55 851,206,500	0.100000 2026/06/20	1.06
9	342 10年国債	日本	国債証券	830,000,000	101.09 839,105,100	102.46 850,426,300	0.100000 2026/03/20	1.06
10	334 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	103.87 830,992,000	104.33 834,640,000	0.600000 2024/06/20	1.04
11	349 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.66 805,300,500	102.85 822,808,000	0.100000 2027/12/20	1.02
12	346 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.87 806,968,000	102.79 822,352,000	0.100000 2027/03/20	1.02
13	335 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	103.43 806,816,400	104.02 811,379,400	0.500000 2024/09/20	1.01
14	340 10年国債	日本	国債証券	770,000,000	103.13 794,170,300	104.17 802,132,100	0.400000 2025/09/20	1.00
15	126 5年国債	日本	国債証券	790,000,000	100.50 793,960,800	100.46 793,665,600	0.100000 2020/12/20	0.98
16	344 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.07 707,493,800	102.64 718,543,000	0.100000 2026/09/20	0.89
17	312 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	102.73 719,173,000	102.08 714,616,000	1.200000 2020/12/20	0.89
18	136 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.98 706,874,000	101.42 709,961,000	0.100000 2023/06/20	0.88
19	333 10年国債	日本	国債証券	680,000,000	103.75 705,516,600	104.10 707,927,600	0.600000 2024/03/20	0.88
20	339 10年国債	日本	国債証券	680,000,000	103.09 701,012,000	104.00 707,213,600	0.400000 2025/06/20	0.88
21	350 10年国債	日本	国債証券	670,000,000	100.46 673,094,200	102.79 688,746,600	0.100000 2028/03/20	0.85
22	132 5年国債	日本	国債証券	680,000,000	100.80 685,477,800	100.98 686,704,800	0.100000 2022/06/20	0.85
23	138 5年国債	日本	国債証券	650,000,000	101.26 658,236,000	101.62 660,582,000	0.100000 2023/12/20	0.82

24	345 10年国債	日本	国債証券	630,000,000	101.38 638,721,600	102.74 647,274,600	0.100000 2026/12/20	0.80
25	352 10年国債	日本	国債証券	630,000,000	100.38 632,439,300	102.67 646,839,900	0.100000 2028/09/20	0.80
26	330 10年国債	日本	国債証券	612,000,000	104.38 638,854,560	104.48 639,417,600	0.800000 2023/09/20	0.79
27	139 5年国債	日本	国債証券	620,000,000	101.40 628,721,600	101.71 630,657,800	0.100000 2024/03/20	0.78
28	134 5年国債	日本	国債証券	610,000,000	100.92 615,662,500	101.19 617,259,000	0.100000 2022/12/20	0.77
29	348 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	100.70 604,212,000	102.85 617,106,000	0.100000 2027/09/20	0.77
30	351 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	100.52 603,165,000	102.74 616,440,000	0.100000 2028/06/20	0.76

(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	86.42%
地方債証券	5.29%
特殊債券	3.65%
社債券	3.87%
合計	99.24%

(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

該当事項はありません。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2019年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	109,266,313,042	95.77
内 香港	1,579,453,356	1.38
内 シンガポール	511,814,600	0.45
内 イスラエル	237,701,195	0.21
内 ノルウェー	280,092,477	0.25
内 スウェーデン	1,111,219,030	0.97
内 デンマーク	711,862,636	0.62
内 イギリス	6,938,164,230	6.08
内 アイルランド	225,946,989	0.20
内 オランダ	1,500,357,666	1.32
内 ベルギー	403,332,292	0.35
内 フランス	4,632,445,395	4.06
内 ドイツ	3,665,830,557	3.21
内 スイス	3,891,618,788	3.41
内 ポルトガル	60,383,865	0.05
内 スペイン	1,237,195,312	1.08
内 イタリア	963,929,770	0.84
内 フィンランド	415,090,436	0.36
内 オーストリア	88,818,601	0.08
内 カナダ	4,251,221,969	3.73
内 アメリカ	73,814,148,024	64.70
内 オーストラリア	2,644,199,230	2.32
内 ニューゼーランド	101,486,624	0.09
投資証券	3,152,156,649	2.76
内 香港	106,155,972	0.09
内 シンガポール	53,465,838	0.05
内 イギリス	70,300,836	0.06
内 フランス	122,014,003	0.11
内 カナダ	21,101,920	0.02
内 アメリカ	2,414,717,886	2.12
内 オーストラリア	364,400,194	0.32
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,668,371,795	1.46
純資産総額	114,086,841,486	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
---------	-------	---------

株価指数先物取引(買建)		1,816,611,818	1.59
	内 アメリカ	1,816,611,818	1.59
為替予約取引(買建)		527,779,000	0.46
	内 日本	527,779,000	0.46

(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) 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 (2019年6月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	199,600	11,902.06 2,375,657,926	14,460.02 2,886,221,689	2.53
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	129,000	19,311.65 2,491,211,684	21,529.97 2,777,366,723	2.43
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	11,430	180,800.26 2,066,547,297	205,262.34 2,346,148,560	2.06
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	65,150	15,002.85 977,436,260	20,426.20 1,330,767,256	1.17
5	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	73,000	15,672.66 1,144,109,576	15,164.97 1,107,043,182	0.97
6	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	89,870	11,832.00 1,063,342,357	11,731.86 1,054,342,582	0.92
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	8,627	117,298.47 1,011,934,223	115,983.11 1,000,586,358	0.88

8	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	8,200	117,980.68 967,442,316	116,049.94 951,609,571	0.83
9	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必 需品	85,550	9,434.63 807,136,278	11,106.85 950,191,189	0.83
10	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネ ルギー	116,055	8,490.51 985,371,533	8,172.63 948,475,480	0.83
11	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技 術	48,050	15,031.74 722,277,373	18,456.88 886,853,166	0.78
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	35,800	23,396.46 837,597,232	22,853.63 818,160,162	0.72
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	68,667	10,045.70 689,814,225	11,833.18 812,549,397	0.71
14	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	251,101	3,020.81 758,529,732	3,040.75 763,536,847	0.67
15	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	49,412	12,384.74 611,955,791	15,015.14 741,928,444	0.65
16	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技 術	121,050	5,096.95 616,994,078	6,007.13 727,163,898	0.64
17	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	155,313	4,900.34 761,095,859	4,681.31 727,069,807	0.64
18	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	199,991	3,296.11 659,200,646	3,554.91 710,950,846	0.62
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技 術	25,050	21,245.51 532,201,861	28,143.96 705,006,423	0.62
20	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	113,504	6,390.00 725,294,528	6,170.97 700,430,630	0.61
21	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	26,326	30,365.73 799,408,992	26,552.98 699,033,978	0.61
22	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネ ルギー	52,068	12,800.17 666,483,479	13,270.02 690,943,761	0.61

23	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	30,950	18,973.19 587,222,868	22,314.68 690,639,526	0.61
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	70,771	8,393.93 594,048,940	9,036.03 639,489,283	0.56
25	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	123,550	5,140.18 635,069,453	5,115.71 632,046,391	0.55
26	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	111,550	5,276.96 588,646,957	5,505.91 614,184,617	0.54
27	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	120,222	5,805.89 697,997,010	4,989.59 599,859,583	0.53
28	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	19,640	28,152.71 552,920,798	30,213.59 593,395,055	0.52
29	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	60,200	8,773.37 528,161,041	9,853.24 593,165,319	0.52
30	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・サービス	14,740	36,956.12 544,734,664	39,237.71 578,363,931	0.51

(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	95.77%
投資証券	2.76%
合計	98.54%

(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	5.93%
素材	4.46%
資本財・サービス	10.06%
一般消費財・サービス	9.65%
生活必需品	8.45%
ヘルスケア	12.72%
金融	15.93%
情報技術	16.51%

コミュニケーション・サービス	8.10%
公益事業	3.43%
不動産	0.54%
合計	95.77%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2019年9月	買建	115	1,799,081,930	1,816,611,818	1.59%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2019年7 月	買建	4,900,000	528,011,860	527,779,000	0.46%

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2019年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		173,863,649,431	98.33
内 ユーロ		67,306,863,651	38.07
内 シンガポール		691,971,343	0.39
内 マレーシア		812,827,646	0.46
内 ノルウェー		422,431,250	0.24
内 スウェーデン		619,169,833	0.35
内 デンマーク		887,294,456	0.50
内 イギリス		11,083,093,002	6.27

内 ポーランド	1,042,043,221	0.59
内 カナダ	3,370,347,903	1.91
内 アメリカ	81,713,704,513	46.22
内 メキシコ	1,420,336,583	0.80
内 南アフリカ	986,127,716	0.56
内 オーストラリア	3,507,438,314	1.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,944,189,285	1.67
純資産総額	176,807,838,716	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)	1,657,486,540	0.94
内 日本	1,657,486,540	0.94

(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 (2019年6月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,907,000	99.98 852,164,622	100.83 859,386,628	2.250000 2021/04/30	0.49
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	102.66 708,251,520	109.62 756,254,640	3.125000 2028/11/15	0.43
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	99.39 696,384,705	107.32 751,921,482	2.875000 2028/05/15	0.43
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	100.58 715,580,406	105.39 749,759,214	2.625000 2029/02/15	0.42
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,029,000	91.63 694,276,204	98.35 745,162,164	1.625000 2026/05/15	0.42
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	97.75 663,845,302	106.25 721,566,847	2.750000 2028/02/15	0.41
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,000,000	98.64 637,944,336	107.42 694,734,575	2.875000 2028/08/15	0.39

8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,287,000	96.78 655,861,348	100.89 683,707,043	2.000000 2022/11/30	0.39
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,084,000	159.73 603,394,706	179.44 677,873,702	4.500000 2041/04/25	0.38
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,921,000	96.38 615,133,624	102.29 652,878,226	2.250000 2024/11/15	0.37
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,900,000	94.14 598,744,562	102.34 650,861,566	2.250000 2027/08/15	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,840,000	95.58 601,701,457	102.36 644,393,713	2.250000 2025/11/15	0.36
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,700,000	95.35 585,839,404	103.32 634,850,331	2.375000 2027/05/15	0.36
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,788,000	95.23 594,153,993	101.63 634,070,380	2.125000 2025/05/15	0.36
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,087,000	118.72 594,351,180	126.38 632,694,315	2.500000 2030/05/25	0.36
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,420,000	107.50 582,013,257	115.81 627,012,885	1.500000 2031/05/25	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,743,000	94.71 586,340,384	100.97 625,079,780	2.000000 2025/02/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,743,000	94.26 583,536,142	100.91 624,695,977	2.000000 2025/08/15	0.35
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,097,000	121.43 609,409,647	121.21 608,307,210	4.250000 2023/10/25	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,550,000	97.88 585,567,773	101.64 608,045,545	2.125000 2024/03/31	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,500,000	93.94 556,948,235	102.31 606,551,576	2.250000 2027/11/15	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,500,000	93.00 551,387,349	100.68 596,917,845	2.000000 2026/11/15	0.34
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	2,807,000	162.41 558,423,692	173.13 595,282,207	5.750000 2032/10/25	0.34
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,340,000	94.56 544,297,548	102.41 589,493,550	2.250000 2027/02/15	0.33
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,229,000	99.33 559,885,744	104.41 588,512,710	2.750000 2024/02/15	0.33
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,600,000	89.91 542,742,483	97.38 587,821,123	1.500000 2026/08/15	0.33
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,023,000	148.58 550,191,340	154.78 573,149,150	5.500000 2029/04/25	0.32

28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,162,000	97.23 541,021,624	102.89 572,536,799	2.375000 2024/08/15	0.32
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	91.36 528,467,769	98.47 569,586,306	1.625000 2026/02/15	0.32
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	99.46 538,334,333	104.20 563,960,797	2.750000 2023/11/15	0.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.33%
合計	98.33%

(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	豪ドル買/円売 2019年7月	買建	233,000	17,541,638	17,584,510	0.01%
		南アフリカ・ランド買/円売 2019年8月	買建	1,100,000	8,303,779	8,294,000	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2019年8月	買建	639,000	52,483,127	52,474,680	0.03%
		デンマーク・クローネ買/円売 2019年8月	買建	477,000	7,828,953	7,827,570	0.00%
		ユーロ買/円売 2019年8月	買建	3,133,000	383,704,489	383,635,850	0.22%
		ユーロ買/円売 2019年7月	買建	1,592,000	194,916,201	194,988,160	0.11%
		英ポンド買/円売 2019年8月	買建	481,000	65,599,020	65,589,160	0.04%

英ポンド買/円売 2019年7月	買建	326,000	44,566,808	44,515,300	0.03%
メキシコ・ペソ買/円売 2019年8月	買建	3,611,000	20,129,487	20,077,160	0.01%
マレーシア・リングgit 買/円売 2019年7月	買建	522,000	13,587,660	13,572,000	0.01%
ノルウェー・クローネ 買/円売 2019年8月	買建	972,000	12,282,481	12,276,360	0.01%
ポーランド・ズロチ買/ 円売 2019年7月	買建	837,000	23,728,799	24,105,600	0.01%
スウェーデン・クローネ 買/円売 2019年7月	買建	188,000	2,156,276	2,182,680	0.00%
シンガポール・ドル買/ 円売 2019年8月	買建	300,000	23,839,500	23,835,000	0.01%
米ドル買/円売 2019年8 月	買建	4,740,000	509,423,918	509,218,200	0.29%
米ドル買/円売 2019年7 月	買建	2,538,000	273,311,128	273,469,500	0.15%
豪ドル買/円売 2019年8 月	買建	51,000	3,844,074	3,840,810	0.00%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●ダイワライフスタイル75

2019年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	13,946円
純資産総額	9.4億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.3%
3カ月間	-1.2%
6カ月間	5.4%
1年間	-4.5%
3年間	23.6%
5年間	26.5%
設定来	39.5%



※上記の「基準価額の騰落率」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8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	
	07年11月	08年12月	09年11月	10年11月	11年11月	12年11月	13年12月	14年12月	15年11月	16年11月	17年11月	18年11月	
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率	
国内株式・先物	2,127	59.8%	日本円	80.0%	直接利回り(%)	1.1	トヨタ自動車	日本	2.0%
国内債券	352	19.8%	米ドル	12.6%	最終利回り(%)	0.2	ソフトバンクグループ	日本	1.1%
外国株式・先物	1,264	14.6%	ユーロ	3.7%	修正デュレーション	9.1	ソニー	日本	1.0%
外国債券	772	4.9%	英ポンド	1.2%	残存年数	10.2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.9%
外国リート	63	0.4%	カナダ・ドル	0.7%	債券格付別構成	比率	日本電信電話	日本	0.9%
外国投資証券	6	0.0%	スイス・フラン	0.5%	AAA	87.7%	武田薬品	日本	0.9%
			豪ドル	0.5%	AA	5.3%	キーエンス	日本	0.9%
			香港ドル	0.2%	A	4.7%	三井住友フィナンシャルG	日本	0.7%
			スウェーデン・クローネ	0.2%	BBB	0.2%	リクルートホールディングス	日本	0.7%
コール・ローン、その他	1.2%	0.4%	その他	0.4%	BB以下・無格付	2.1%	本田技研	日本	0.6%
合計	4,584	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	9.7%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.1%保有しております。

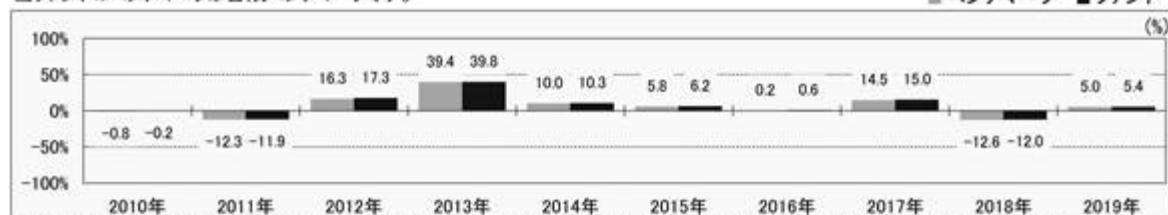
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計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合成ベンチマークです。

■ベンチマーク ■ファンド



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

・2019年は6月28日までの騰落率を表しています。

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

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

2 【換金(解約)手続等】

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

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、販売会社が定める単位（別に定める契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、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 <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情がある
ときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中
止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。
ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該
受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に
準じて計算される価額とします。

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：海外取引所に上場されている株式は原則として海外取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場、海外の店頭市場に登録されている株式は原則として当該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。
- ・公社債等：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問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 <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30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、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意

のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

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

・委託会社のホームページ

アドレス <https://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。

<https://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ます。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

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

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期計算期間(平成29年12月1日から平成30年11月30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】

【財務諸表】

ダイワライフスタイル75

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 平成29年11月30日現在	第19期 平成30年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	3,117,476
コール・ローン	7,412,269	6,062,767
親投資信託受益証券	934,617,626	962,096,913
流動資産合計	942,029,895	971,277,156
資産合計	942,029,895	971,277,156
負債の部		
流動負債		
未払解約金	394,867	1,642,298
未払受託者報酬	378,916	420,125
未払委託者報酬	3,884,383	4,306,592
その他未払費用	35,429	39,363
流動負債合計	4,693,595	6,408,378
負債合計	4,693,595	6,408,378
純資産の部		
元本等		
元本	1 631,550,724	1 673,349,184
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	305,785,576	291,519,594
（分配準備積立金）	273,110,882	254,508,184
元本等合計	937,336,300	964,868,778
純資産合計	937,336,300	964,868,778
負債純資産合計	942,029,895	971,277,156

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期		第19期	
	自	平成28年12月1日 至 平成29年11月30日	自	平成29年12月1日 至 平成30年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		140,217,012		24,427,713
営業収益合計		140,217,012		24,427,713
営業費用				
支払利息		2,416		3,295
受託者報酬		722,642		830,997
委託者報酬		7,407,971		8,518,509
その他費用		67,574		78,105
営業費用合計		8,200,603		9,430,906
営業利益又は営業損失()		132,016,409		33,858,619
経常利益又は経常損失()		132,016,409		33,858,619
当期純利益又は当期純損失()		132,016,409		33,858,619
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		4,994,817		400,971
期首剰余金又は期首欠損金()		161,684,471		305,785,576
剰余金増加額又は欠損金減少額		33,051,439		41,569,482
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		33,051,439		41,569,482
剰余金減少額又は欠損金増加額		15,971,926		22,377,816
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		15,971,926		22,377,816
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		305,785,576		291,519,594

(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19期	
	自 平成29年12月1日	至 平成30年11月30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18期	第19期
	平成29年11月30日現在	平成30年11月30日現在
1. 1 期首元本額	598,654,336円	631,550,724円
期中追加設定元本額	91,122,014円	88,023,270円
期中一部解約元本額	58,225,626円	46,224,810円
2. 計算期間末日における受益権の総数	631,550,724口	673,349,184口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第18期	第19期
	自 平成28年12月1日 至 平成29年11月30日	自 平成29年12月1日 至 平成30年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(108,260,931円)、投資信託約款に規定される収益調整金(246,370,423円)及び分配準備積立金(164,849,951円)より分配対象額は519,481,305円(1万口当たり8,225.49円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(299,354,117円)及び分配準備積立金(254,508,184円)より分配対象額は553,862,301円(1万口当たり8,225.48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19期</p> <p style="text-align: center;">自 平成29年12月1日</p> <p style="text-align: center;">至 平成30年11月30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	<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>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第19期
	平成30年11月30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18期	第19期
	平成29年11月30日現在	平成30年11月30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	134,810,851	25,285,338
合計	134,810,851	25,285,338

（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18期	第19期
平成29年11月30日現在	平成30年11月30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19期
自 平成29年12月1日
至 平成30年11月30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18期	第19期
	平成29年11月30日現在	平成30年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.4842円	1.4329円
（1万口当たり純資産額）	（14,842円）	（14,329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	544,757,466	575,972,068	
	日本債券インデックスマザーファンド	138,475,066	193,505,057	
	外国株式インデックスマザーファンド	58,841,550	144,138,260	
	外国債券インデックスマザーファンド	17,567,044	48,481,528	
親投資信託受益証券 合計			962,096,913	
合計			962,096,913	

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年11月30日現在	平成30年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		

流動資産		
金銭信託		-
コール・ローン		5,748,360,758
株式	2 3	11,179,224,344
派生商品評価勘定		141,293,259,400
未収入金		81,277,080
未収配当金		26,461,940
未収利息		-
前払金		76,903,429
その他未収収益	4	779,613,672
流動資産合計		327,444
資産合計		-
		21,520,000
		9,771,083
		30,930,674
		147,440,843,945
		158,689,676,464
		147,440,843,945
		158,689,676,464
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,080
前受金		7,672,420
未払金		69,750,000
未払解約金		-
受入担保金		452,160
その他未払費用		1,030,901,154
流動負債合計		254,453,100
負債合計		23,803,900
純資産の部		
元本等		
元本	1	3,958,464,457
剰余金		15,009,839,092
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		-
元本等合計		174,575
純資産合計		4,283,120,797
負債純資産合計		16,072,391,141
		4,283,120,797
		16,072,391,141
		128,627,233,302
		134,890,694,102
		14,530,489,846
		7,726,591,221
		143,157,723,148
		142,617,285,323
		143,157,723,148
		142,617,285,323
		147,440,843,945
		158,689,676,464

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12月1日 至 平成30年11月30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、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> <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。</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、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11月30日現在	平成30年11月30日現在
1. 1 期首	平成28年12月1日	平成29年12月1日
期首元本額	141,237,185,956円	128,627,233,302円
期中追加設定元本額	15,344,235,430円	18,705,077,077円
期中一部解約元本額	27,954,188,084円	12,441,616,277円
期末元本額の内訳 ファンド名		

トピックス・インデックス ファンド	4,364,412,056円	4,208,196,163円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	11,109,078,226円	8,873,990,627円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドVA2	63,469,755円	50,893,960円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	80,019,243円	65,059,832円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,411,218,462円	1,060,778,978円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	70,073,352円	59,055,392円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,949,560,771円	1,449,339,094円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	4,513,952円
D-I's TOPIXイン デックス	28,367,467円	39,579,272円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	25,160,362円	19,750,054円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	571,628円	687,039円
iFree TOPIXイン デックス	294,793,376円	766,287,386円
iFree 8資産バランス	624,779,967円	1,279,701,333円
iFree 年金バランス	- 円	18,821,903円
DCダイワ日本株式インデッ クス	60,695,276,446円	65,506,653,858円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,195,311,787円	2,604,113,138円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,320,693,161円	2,907,019,868円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,181,670,247円	2,813,203,474円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,033,420,970円	4,626,136,087円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	17,249,227円	15,110,700円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	51,964,735円	52,614,491円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	13,124,314円	16,862,669円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	- 円	9,822,989円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	364,602円	350,718円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	362,318円	359,201円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	690,983円	712,052円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	6,930,943円	4,149,572円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	19,322,872円	4,912,940円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	15,921,448円	9,756,807円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	359,581,980円	184,587,297円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	168,953,117円	162,072,230円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	11,001,597,589円	9,658,927,568円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	227,225,197円	11,433,435円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	239,347,643円	14,487,998円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	895,003,489円	823,275,779円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	144,200,065円	129,734,372円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	242,040,229円	221,128,598円
ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	70,307,122円	140,301,263円

	ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	5,865,224,891円	8,504,620,250円
	ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	4,249,531円	292,440,998円
	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	1,175,567,763円	1,905,520,921円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,188,177,701円	1,400,114,800円
	ダイワライフスタイル25	176,027,159円	181,369,214円
	ダイワライフスタイル50	628,315,358円	649,148,174円
	ダイワライフスタイル75	505,576,948円	544,757,466円
	DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	14,162,028,802円	13,598,340,190円
	計	128,627,233,302円	134,890,694,102円
2.	期末日における受益権の総数	128,627,233,302口	134,890,694,102口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 3,819,839,950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 14,441,000,290円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 704,400,000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 680,300,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分8,686,485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28,279,195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12月1日 至 平成30年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年11月30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11月30日現在	平成30年11月30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	9,624,573,051	9,360,479,994

合計	9,624,573,051	9,360,479,994
----	---------------	---------------

(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9月20日から平成29年11月30日まで、及び平成30年9月20日から平成30年11月30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11月30日 現在				平成30年11月30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	1,715,670,000	-	1,797,000,000	81,330,000	1,849,310,000	-	1,868,160,000	18,850,000
合計	1,715,670,000	-	1,797,000,000	81,330,000	1,849,310,000	-	1,868,160,000	18,850,000

(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11月30日現在	平成30年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1130円	1.0573円
(1万口当たり純資産額)	(11,130円)	(10,573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	2,600	3,225.00	8,385,000	
日本水産	81,100	686.00	55,634,600	
マルハニチロ	11,700	4,105.00	48,028,500	
ハウスイ	500	911.00	455,500	
カネコ種苗	2,200	1,437.00	3,161,400	
サカタのタネ	9,900	3,895.00	38,560,500	
ホクト	6,700	2,019.00	13,527,300	
ホクリヨウ	1,000	752.00	752,000	
ヒノキヤグループ	1,700	2,113.00	3,592,100	
ショーボンドHD	6,300	8,700.00	54,810,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ミライト・ホールディングス	20,500	1,664.00	34,112,000	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
タマホーム	5,200	1,111.00	5,777,200	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	1,400	875.00	1,225,000	貸付株式数 400株
日本アクア	2,000	390.00	780,000	貸付株式数 800株
ファーストコーポレーション	2,300	1,066.00	2,451,800	貸付株式数 900株
ベステラ	1,500	1,565.00	2,347,500	
スペースバリューHD	9,800	1,046.00	10,250,800	
住石ホールディングス	16,400	115.00	1,886,000	
日鉄鉱業	1,800	5,560.00	10,008,000	
三井松島HLDGS	3,300	1,612.00	5,319,600	
国際石油開発帝石	324,500	1,205.00	391,022,500	
石油資源開発	11,600	2,354.00	27,306,400	
K&Oエナジーグループ	3,900	1,636.00	6,380,400	
ダイセキ環境ソリューション	1,500	865.00	1,297,500	
第一カッター興業	900	2,140.00	1,926,000	
安藤・間	51,500	686.00	35,329,000	
東急建設	23,600	1,145.00	27,022,000	
コムシスホールディングス	28,700	2,930.00	84,091,000	
ミサワホーム	6,800	831.00	5,650,800	
ビーアールホールディングス	6,500	397.00	2,580,500	
高松コンストラクションGP	5,100	2,899.00	14,784,900	
東建コーポレーション	2,500	7,780.00	19,450,000	

ソネック	800	778.00	622,400	
ヤマウラ	3,000	902.00	2,706,000	貸付株式数 1,500株
大成建設	66,500	4,990.00	331,835,000	
大林組	200,300	1,132.00	226,739,600	
清水建設	204,400	970.00	198,268,000	
飛鳥建設	5,600	1,560.00	8,736,000	
長谷工コーポレーション	83,700	1,374.00	115,003,800	
松井建設	7,300	853.00	6,226,900	
銭高組	800	5,500.00	4,400,000	
鹿島建設	156,400	1,571.00	245,704,400	
不動テトラ	5,000	1,952.00	9,760,000	
大末建設	2,300	1,190.00	2,737,000	
鉄建建設	4,000	3,020.00	12,080,000	
西松建設	14,400	2,618.00	37,699,200	
三井住友建設	48,000	705.00	33,840,000	
大豊建設	4,600	3,775.00	17,365,000	
前田建設	47,600	1,192.00	56,739,200	
佐田建設	4,000	433.00	1,732,000	
ナカノフドー建設	4,900	625.00	3,062,500	貸付株式数 1,000株
奥村組	11,000	3,785.00	41,635,000	
東鉄工業	8,000	3,340.00	26,720,000	
イチケン	1,200	2,165.00	2,598,000	貸付株式数 100株
富士ピー・エス	2,000	517.00	1,034,000	
浅沼組	2,400	3,475.00	8,340,000	
戸田建設	77,800	764.00	59,439,200	
熊谷組	9,600	3,595.00	34,512,000	
青木あすなろ建設	3,600	1,028.00	3,700,800	
北野建設	1,400	4,075.00	5,705,000	
植木組	800	2,453.00	1,962,400	
矢作建設	9,100	764.00	6,952,400	
ピーエス三菱	7,000	711.00	4,977,000	
日本ハウスHLDGS	12,600	504.00	6,350,400	貸付株式数 3,100株
大東建託	23,900	14,830.00	354,437,000	
新日本建設	8,200	1,210.00	9,922,000	
NIPPON	17,700	1,935.00	34,249,500	
東亜道路	1,200	3,250.00	3,900,000	貸付株式数 800株
前田道路	21,100	2,230.00	47,053,000	
日本道路	1,800	6,170.00	11,106,000	
東亜建設	5,800	1,576.00	9,140,800	
若築建設	3,400	1,723.00	5,858,200	貸付株式数 1,000株

東洋建設	24,200	423.00	10,236,600	
五洋建設	79,300	716.00	56,778,800	
世紀東急	9,400	674.00	6,335,600	
福田組	2,200	5,410.00	11,902,000	貸付株式数 600株
日本ドライケミカル	1,500	1,318.00	1,977,000	
住友林業	47,300	1,675.00	79,227,500	
日本基礎技術	6,600	346.00	2,283,600	
巴コーポレーション	8,300	451.00	3,743,300	貸付株式数 4,600株
大和ハウス	185,100	3,575.00	661,732,500	
ライト工業	12,900	1,545.00	19,930,500	
積水ハウス	205,200	1,711.00	351,097,200	
日特建設	5,600	700.00	3,920,000	
北陸電気工事	3,100	1,000.00	3,100,000	
ユアテック	10,700	936.00	10,015,200	貸付株式数 500株
四電工	1,000	2,738.00	2,738,000	
中電工	8,600	2,524.00	21,706,400	
関電工	30,500	1,178.00	35,929,000	貸付株式数 6,800株
きんでん	44,600	1,966.00	87,683,600	
東京エネシス	6,700	965.00	6,465,500	貸付株式数 3,200株
トーエネック	1,900	3,140.00	5,966,000	
住友電設	4,600	2,079.00	9,563,400	貸付株式数 2,000株
日本電設工業	11,500	2,482.00	28,543,000	
協和エクシオ	26,100	2,860.00	74,646,000	
新日本空調	5,700	2,063.00	11,759,100	
日本工営	3,800	2,731.00	10,377,800	
九電工	13,200	4,415.00	58,278,000	
三機工業	15,100	1,221.00	18,437,100	
日揮	57,500	1,658.00	95,335,000	
中外炉工業	1,900	2,468.00	4,689,200	
ヤマト	5,900	636.00	3,752,400	
太平電業	4,400	2,790.00	12,276,000	
高砂熱学	16,900	2,037.00	34,425,300	
三晃金属	800	3,010.00	2,408,000	
NEC ネットエスアイ	6,500	2,528.00	16,432,000	
朝日工業社	1,400	3,330.00	4,662,000	
明星工業	12,000	845.00	10,140,000	貸付株式数 1,000株
大気社	9,100	3,190.00	29,029,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
ダイダン	4,400	2,553.00	11,233,200	
日比谷総合設備	6,300	1,926.00	12,133,800	貸付株式数 1,000株

東芝プラントシステム	14,500	2,483.00	36,003,500	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
日本製粉	19,700	1,937.00	38,158,900	
日清製粉G本社	67,700	2,385.00	161,464,500	
日東富士製粉	400	5,620.00	2,248,000	
昭和産業	5,400	2,837.00	15,319,800	貸付株式数 700株
鳥越製粉	5,300	948.00	5,024,400	貸付株式数 1,000株
中部飼料	7,200	1,405.00	10,116,000	
フィード・ワン	39,500	210.00	8,295,000	貸付株式数 5,000株
東洋精糖	900	1,173.00	1,055,700	
日本甜菜糖	3,400	1,967.00	6,687,800	
三井製糖	4,700	3,020.00	14,194,000	
塩水港精糖	6,500	251.00	1,631,500	
日新製糖	2,900	2,385.00	6,916,500	
L I F U L L	19,800	897.00	17,760,600	
ジェイエイシーリクルート メント	4,600	2,315.00	10,649,000	貸付株式数 1,800株
日本M&Aセンター	42,500	2,647.00	112,497,500	
メンバーズ	1,900	1,030.00	1,957,000	
中広	500	621.00	310,500	
タケエイ	5,800	866.00	5,022,800	
E・Jホールディングス	700	1,186.00	830,200	貸付株式数 200株
トラスト・テック	2,700	3,260.00	8,802,000	貸付株式数 1,000株
コシダカホールディングス	15,300	1,535.00	23,485,500	
アルトナー	1,000	781.00	781,000	
パソナグループ	5,400	1,397.00	7,543,800	貸付株式数 500株 (500株)
C D S	1,400	1,329.00	1,860,600	貸付株式数 700株
リンクアンドモチベーショ ン	10,500	1,041.00	10,930,500	貸付株式数 4,100株
G C A	5,700	802.00	4,571,400	
エス・エム・エス	20,900	1,870.00	39,083,000	
パーソルホールディングス	56,900	2,126.00	120,969,400	
リニカル	3,200	1,616.00	5,171,200	
クックパッド	17,800	413.00	7,351,400	貸付株式数 8,200株
エスクリ	1,600	669.00	1,070,400	
アイ・ケイ・ケイ	2,800	724.00	2,027,200	
森永製菓	15,000	4,990.00	74,850,000	
中村屋	1,600	4,515.00	7,224,000	
江崎グリコ	18,000	5,530.00	99,540,000	貸付株式数 1,000株

名糖産業	2,900	1,475.00	4,277,500	
井村屋グループ	2,600	3,115.00	8,099,000	
不二家	3,200	2,514.00	8,044,800	
山崎製パン	49,000	2,383.00	116,767,000	貸付株式数 5,200株
第一屋製パン	1,100	1,144.00	1,258,400	貸付株式数 400株
モロゾフ	1,000	5,470.00	5,470,000	
亀田製菓	3,700	5,360.00	19,832,000	
寿スピリッツ	6,300	4,850.00	30,555,000	
カルビー	27,200	3,760.00	102,272,000	貸付株式数 10,300株
森永乳業	11,900	3,325.00	39,567,500	
六甲バター	4,300	2,383.00	10,246,900	
ヤクルト	44,300	8,550.00	378,765,000	
明治ホールディングス	42,400	8,930.00	378,632,000	
雪印メグミルク	14,400	3,160.00	45,504,000	
プリマハム	8,300	2,156.00	17,894,800	
日本ハム	25,800	4,210.00	108,618,000	
林兼産業	1,800	672.00	1,209,600	
丸大食品	6,300	2,021.00	12,732,300	
S Foods	5,300	4,905.00	25,996,500	
伊藤ハム米久HLDGS	38,100	755.00	28,765,500	貸付株式数 3,000株
学情	2,300	1,536.00	3,532,800	
スタジオアリス	2,900	2,598.00	7,534,200	
シミックホールディングス	3,200	2,177.00	6,966,400	
システナ	20,900	1,461.00	30,534,900	
NJS	1,200	1,719.00	2,062,800	
デジタルアーツ	3,100	6,490.00	20,119,000	貸付株式数 1,200株
新日鉄住金SOL	8,800	3,245.00	28,556,000	
総合警備保障	22,700	5,340.00	121,218,000	
キューブシステム	3,100	771.00	2,390,100	貸付株式数 1,000株
いちご	74,000	389.00	28,786,000	
エイジア	1,200	1,404.00	1,684,800	貸付株式数 400株
日本駐車場開発	75,600	160.00	12,096,000	
コア	2,400	1,401.00	3,362,400	
カカクコム	42,900	2,284.00	97,983,600	
アイロムグループ	2,200	2,193.00	4,824,600	
セントケア・ホールディング	3,100	585.00	1,813,500	
グ				
サイネックス	900	763.00	686,700	
ルネサンス	3,100	2,372.00	7,353,200	
ディップ	9,100	2,550.00	23,205,000	

SBSホールディングス	6,100	1,369.00	8,350,900	貸付株式数	1,000株
オプトホールディング	3,500	2,117.00	7,409,500	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
新日本科学	7,900	711.00	5,616,900		
ツクイ	13,300	1,021.00	13,579,300	貸付株式数	400株
キャリアデザインセンター	1,400	1,302.00	1,822,800		
エムスリー	120,100	1,834.00	220,263,400		
ツカダ・グローバルHOLD	3,800	628.00	2,386,400	貸付株式数	1,000株
プラス	500	632.00	316,000		
アウトソーシング	30,000	1,423.00	42,690,000		
ウェルネット	5,700	1,145.00	6,526,500	貸付株式数	3,600株
ワールドホールディングス	1,600	2,736.00	4,377,600	貸付株式数	100株
ディー・エヌ・エー	30,800	2,106.00	64,864,800	貸付株式数	3,700株
博報堂DYHLDGS	79,400	1,738.00	137,997,200		
ぐるなび	8,100	842.00	6,820,200	貸付株式数	1,300株
エスアールジータカミヤ	6,100	695.00	4,239,500		
ジャパンベストレスキュー	4,400	1,624.00	7,145,600	貸付株式数	1,700株
ファンコミュニケーションズ	15,600	705.00	10,998,000	貸付株式数	6,300株
ライク	2,200	1,662.00	3,656,400	貸付株式数	800株
ビジネス・ブレークスルー	2,300	377.00	867,100		
WDBホールディングス	2,600	2,878.00	7,482,800		
ティア	2,600	690.00	1,794,000	貸付株式数	1,000株
CDG	500	1,461.00	730,500		
バリューコマース	3,900	1,486.00	5,795,400	貸付株式数	1,500株
インフォマート	31,300	1,394.00	43,632,200	貸付株式数	12,300株
サッポロホールディングス	21,900	2,585.00	56,611,500	貸付株式数	8,600株
アサヒグループホールディング	125,300	4,754.00	595,676,200		
麒麟HD	270,900	2,665.00	721,948,500		
宝ホールディングス	45,000	1,447.00	65,115,000		
オエノンホールディングス	16,800	386.00	6,484,800	貸付株式数	4,500株
養命酒	1,900	2,423.00	4,603,700		
コカ・コーラボトラーズJHD	45,900	3,250.00	149,175,000		
サントリー食品インター	40,000	4,760.00	190,400,000		
ダイドーグループHD	3,400	6,180.00	21,012,000	貸付株式数	800株
伊藤園	19,900	5,210.00	103,679,000		

キーコーヒー	5,900	2,149.00	12,679,100		
ユニカフェ	1,800	1,268.00	2,282,400		
ジャパンフーズ	800	1,233.00	986,400		
日清オイリオグループ	7,700	3,520.00	27,104,000		
不二製油グループ	14,600	3,630.00	52,998,000		
かどや製油	600	5,840.00	3,504,000		
J - オイルミルズ	3,100	4,050.00	12,555,000		
ローソン	14,800	7,430.00	109,964,000		
サンエー	4,400	4,765.00	20,966,000		
カワチ薬品	4,500	2,209.00	9,940,500		
エービーシー・マート	9,200	6,380.00	58,696,000		
ハードオフコーポレーション	2,300	915.00	2,104,500		
高千穂交易	2,200	1,079.00	2,373,800		
アスクル	5,100	2,965.00	15,121,500	貸付株式数	2,000株
ゲオホールディングス	8,900	1,911.00	17,007,900	貸付株式数	3,500株
アダストリア	8,100	1,859.00	15,057,900	貸付株式数	800株 (100株)
ジーフット	3,900	752.00	2,932,800	貸付株式数	1,000株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	700	744.00	520,800		
伊藤忠食品	1,400	5,320.00	7,448,000		
くらコーポレーション	3,400	7,140.00	24,276,000		
キャンドウ	2,700	1,684.00	4,546,800		
エレマテック	2,700	2,261.00	6,104,700		
パルグループHLDGS	3,000	3,080.00	9,240,000		
JALUX	1,700	2,862.00	4,865,400	貸付株式数	200株
エディオン	24,900	1,248.00	31,075,200	貸付株式数	9,000株
あらた	3,200	4,930.00	15,776,000		
サーラコーポレーション	11,800	661.00	7,799,800		
ワッツ	1,900	815.00	1,548,500	貸付株式数	100株
トーメンデバイス	800	2,461.00	1,968,800		
ハローズ	2,200	2,598.00	5,715,600		
J Pホールディングス	16,100	309.00	4,974,900	貸付株式数	6,400株 (2,000株)
あみやき亭	1,300	4,100.00	5,330,000		
東京エレクトロデバイス	2,100	1,911.00	4,013,100		
ひらまつ	11,600	369.00	4,280,400	貸付株式数	5,900株
フィールズ	5,100	916.00	4,671,600	貸付株式数	1,200株
双日	324,700	402.00	130,529,400		

アルフレッサホールディングス	65,200	3,020.00	196,904,000	
大黒天物産	1,400	4,485.00	6,279,000	貸付株式数 400株
ハニーズホールディングス	5,600	909.00	5,090,400	
ファーマライズHD	1,400	603.00	844,200	貸付株式数 500株 (500株)
キッコーマン	39,500	6,620.00	261,490,000	
味の素	135,500	1,962.50	265,918,750	貸付株式数 20,600株
キューピー	33,300	2,756.00	91,774,800	
ハウス食品G本社	22,900	4,025.00	92,172,500	
カゴメ	23,900	3,315.00	79,228,500	
焼津水産化工	2,900	1,092.00	3,166,800	貸付株式数 1,000株
アリアケジャパン	5,500	9,810.00	53,955,000	
ピエトロ	700	1,643.00	1,150,100	
エバラ食品工業	1,400	2,228.00	3,119,200	
ニチレイ	31,100	3,205.00	99,675,500	
横浜冷凍	15,200	948.00	14,409,600	
東洋水産	30,700	3,890.00	119,423,000	
イトアンド	2,000	1,771.00	3,542,000	
大冷	700	1,825.00	1,277,500	
ヨシムラ・フード・HLD GS	1,600	671.00	1,073,600	
日清食品HD	25,400	7,330.00	186,182,000	
永谷園ホールディングス	3,100	2,787.00	8,639,700	
一正蒲鉾	2,300	1,096.00	2,520,800	貸付株式数 800株
フジッコ	6,400	2,494.00	15,961,600	
ロックフィールド	6,400	1,687.00	10,796,800	
日本たばこ産業	345,600	2,823.50	975,801,600	
ケンコーマヨネーズ	3,300	2,300.00	7,590,000	貸付株式数 200株
わらべや日洋HD	3,900	1,957.00	7,632,300	貸付株式数 600株
なとり	3,300	1,875.00	6,187,500	
イフジ産業	1,000	713.00	713,000	
ピクルスコーポレーション	1,400	2,256.00	3,158,400	
北の達人コーポ	23,500	525.00	12,337,500	貸付株式数 7,900株
ユーグレナ	24,500	698.00	17,101,000	貸付株式数 9,400株 (5,800株)
片倉工業	7,200	1,218.00	8,769,600	
グンゼ	4,200	4,455.00	18,711,000	
ヒューリック	124,000	1,038.00	128,712,000	

神 栄	700	1,161.00	812,700		
ラサ商事	3,200	973.00	3,113,600		
アルペン	4,500	1,947.00	8,761,500	貸付株式数	1,700株
ハブ	1,900	955.00	1,814,500		
ラクーンホールディングス	3,400	705.00	2,397,000	貸付株式数	300株
クオールホールディングス	8,600	2,030.00	17,458,000	貸付株式数	2,700株
アルコニックス	6,200	1,305.00	8,091,000	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
神戸物産	8,900	3,480.00	30,972,000		
ソリトンシステムズ	3,300	906.00	2,989,800	貸付株式数	1,300株
ジンズ	4,000	7,020.00	28,080,000		
ビックカメラ	31,400	1,596.00	50,114,400	貸付株式数	8,900株 (8,900株)
D C Mホールディングス	31,600	1,126.00	35,581,600	貸付株式数	12,500株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	4,600	4,100.00	18,860,000	貸付株式数	1,800株 (300株)
Monotaro	37,200	3,075.00	114,390,000	貸付株式数	14,700株
東京一番フーズ	1,400	633.00	886,200	貸付株式数	500株 (500株)
DDホールディングス	1,300	2,466.00	3,205,800	貸付株式数	500株
あい ホールディングス	9,400	2,263.00	21,272,200	貸付株式数	3,700株
ディービーエックス	2,200	1,220.00	2,684,000		
きちり	1,500	825.00	1,237,500	貸付株式数	600株
アークランドサービスHD	4,200	2,514.00	10,558,800		
J. フロント リテイリング	75,200	1,550.00	116,560,000	貸付株式数	26,800株
ドトール・日レスHD	10,200	2,215.00	22,593,000		
マツモトキヨシHLDGS	24,300	4,215.00	102,424,500		
ブロンコビリー	3,100	2,981.00	9,241,100	貸付株式数	1,400株 (900株)
ZOZO	63,400	2,525.00	160,085,000	貸付株式数	22,500株
トレジャー・ファクトリー	1,700	745.00	1,266,500		
物語コーポレーション	1,700	11,070.00	18,819,000		
ココカラファイン	6,600	6,480.00	42,768,000	貸付株式数	2,600株
三越伊勢丹HD	110,000	1,313.00	144,430,000	貸付株式数	43,400株
東洋紡	24,700	1,643.00	40,582,100		
ユニチカ	17,000	548.00	9,316,000		
富士紡ホールディングス	3,000	3,110.00	9,330,000		
日清紡ホールディングス	32,900	1,033.00	33,985,700		

倉敷紡績	5,500	2,900.00	15,950,000	
ダイワボウHD	5,400	6,360.00	34,344,000	
シキボウ	3,200	1,164.00	3,724,800	
日東紡績	8,800	2,174.00	19,131,200	
トヨタ紡織	20,800	1,749.00	36,379,200	
マクニカ・富士エレHLDGS	16,200	1,752.00	28,382,400	貸付株式数 4,300株
Hamee	1,500	1,831.00	2,746,500	貸付株式数 100株
ラクト・ジャパン	1,300	7,960.00	10,348,000	
ウエルシアHD	15,600	5,750.00	89,700,000	
クリエイトSDH	8,700	3,095.00	26,926,500	
バイタルKSKHD	11,000	1,212.00	13,332,000	貸付株式数 4,400株
八洲電機	6,000	835.00	5,010,000	貸付株式数 1,000株
メディアスホールディングス	3,100	827.00	2,563,700	
UKCホールディングス	3,800	2,436.00	9,256,800	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ジューテックHD	1,300	1,065.00	1,384,500	
丸善CHI HD	6,600	346.00	2,283,600	
大光	1,400	683.00	956,200	貸付株式数 500株
OCHIホールディングス	1,800	1,267.00	2,280,600	
TOKAIホールディングス	30,900	1,004.00	31,023,600	
黒谷	1,000	513.00	513,000	貸付株式数 300株
ミサワ	1,000	495.00	495,000	
ティーライフ	800	980.00	784,000	
Cominix	900	841.00	756,900	
エー・ピーカンパニー	900	540.00	486,000	
三洋貿易	3,000	2,023.00	6,069,000	
チムニー	1,700	2,751.00	4,676,700	貸付株式数 600株
シュッピン	4,000	1,095.00	4,380,000	
ビューティガレージ	800	1,798.00	1,438,400	
ウイン・パートナーズ	3,700	1,162.00	4,299,400	貸付株式数 1,000株
ネクステージ	9,000	1,199.00	10,791,000	貸付株式数 3,500株
ジョイフル本田	17,200	1,731.00	29,773,200	貸付株式数 4,600株
鳥貴族	1,900	2,242.00	4,259,800	貸付株式数 900株
麒麟堂ホールディングス	2,300	1,615.00	3,714,500	
ホットランド	3,000	1,483.00	4,449,000	貸付株式数 1,400株 (1,300株)

すかいらーくHD	54,600	1,860.00	101,556,000	貸付株式数 21,100株 (2,800株)
綿半ホールディングス	2,200	2,717.00	5,977,400	貸付株式数 700株
日本毛織	19,700	919.00	18,104,300	
ダイトウボウ	12,700	101.00	1,282,700	貸付株式数 3,800株
トーア紡コーポレーション	2,600	544.00	1,414,400	
ダイドーリミテッド	6,900	366.00	2,525,400	貸付株式数 1,000株
ヨシックス	1,000	3,325.00	3,325,000	
ユナイテッド・スーパー マーケ	17,200	1,319.00	22,686,800	
三栄建築設計	2,600	1,575.00	4,095,000	
野村不動産HLDGS	40,300	2,242.00	90,352,600	
三重交通グループHD	12,500	614.00	7,675,000	貸付株式数 3,000株
サムティ	8,300	1,516.00	12,582,800	貸付株式数 3,200株
エー・ディー・ワークス	96,100	41.00	3,940,100	
日本商業開発	4,200	1,732.00	7,274,400	貸付株式数 1,900株
プレサンスコーポレーショ ン	9,600	1,416.00	13,593,600	貸付株式数 3,600株
ユニゾホールディングス	9,100	2,312.00	21,039,200	貸付株式数 3,500株
日本管理センター	4,100	1,019.00	4,177,900	
サンセイランディック	1,900	1,017.00	1,932,300	
エストラスト	1,300	797.00	1,036,100	
フージャースHD	13,500	656.00	8,856,000	貸付株式数 6,000株
オープンハウス	9,600	4,040.00	38,784,000	貸付株式数 3,800株
東急不動産HD	160,200	637.00	102,047,400	
飯田GHD	49,600	2,003.00	99,348,800	貸付株式数 3,000株
イーランド	1,100	740.00	814,000	
帝国繊維	6,600	2,454.00	16,196,400	
日本コークス工業	49,400	106.00	5,236,400	
ゴルフダイジェスト・オン	2,300	806.00	1,853,800	貸付株式数 900株
ミタチ産業	1,400	787.00	1,101,800	貸付株式数 500株
B E E N O S	1,400	1,639.00	2,294,600	
あさひ	4,800	1,461.00	7,012,800	
日本調剤	2,100	3,670.00	7,707,000	貸付株式数 400株 (100株)
コスモス薬品	3,000	23,030.00	69,090,000	貸付株式数 1,100株
シップヘルスケアHD	12,200	4,270.00	52,094,000	
トーエル	2,800	813.00	2,276,400	
一六堂	1,200	513.00	615,600	
ソフトクリエイイトHD	2,500	1,739.00	4,347,500	

オンリー	1,000	1,080.00	1,080,000		
セブン&アイ・HLDGS	246,300	4,943.00	1,217,460,900		
薬王堂	2,500	3,400.00	8,500,000	貸付株式数	1,000株
クリエイイト・レストランツ・ホール	15,700	1,325.00	20,802,500	貸付株式数	6,200株
明治電機工業	1,800	2,126.00	3,826,800		
ツルハホールディングス	12,700	11,200.00	142,240,000	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
デリカフーズHLDGS	1,000	1,452.00	1,452,000		
スターティアホールディングス	1,100	723.00	795,300		
サンマルクホールディングス	4,600	2,774.00	12,760,400	貸付株式数	400株
フェリシモ	1,300	1,212.00	1,575,600	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	7,200	2,212.00	15,926,400	貸付株式数	2,800株 (800株)
帝人	47,400	1,960.00	92,904,000		
東レ	453,200	890.30	403,483,960		
クラレ	98,300	1,764.00	173,401,200		
旭化成	415,300	1,243.00	516,217,900	貸付株式数	37,900株
サカイオーベックス	1,400	2,467.00	3,453,800		
TOKYO BASE	5,200	696.00	3,619,200	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
稲葉製作所	3,200	1,357.00	4,342,400		
宮地エンジニアリングG	1,800	2,148.00	3,866,400		
トーカロ	15,000	990.00	14,850,000	貸付株式数	6,000株
アルファCO	2,000	1,395.00	2,790,000	貸付株式数	800株
SUMCO	65,200	1,740.00	113,448,000	貸付株式数	25,500株
川田テクノロジーズ	1,300	8,530.00	11,089,000		
RS TECHNOLOGIES	1,200	5,040.00	6,048,000	貸付株式数	400株
ビーロット	1,000	1,369.00	1,369,000	貸付株式数	300株
ファーストブラザーズ	1,600	1,360.00	2,176,000	貸付株式数	600株
ハウストゥ	2,300	1,248.00	2,870,400	貸付株式数	800株
シーアールイー	2,600	1,009.00	2,623,400		
プロパティエージェント	800	1,033.00	826,400	貸付株式数	200株
ケイアイスター不動産	1,800	1,881.00	3,385,800		
アグレ都市デザイン	1,000	635.00	635,000		
ジェイ・エス・ビー	200	4,495.00	899,000		
テンポイノベーション	500	1,536.00	768,000		

住江織物	1,600	2,730.00	4,368,000	貸付株式数	500株
日本フェルト	2,900	480.00	1,392,000		
イチカワ	800	1,508.00	1,206,400		
エコナックホールディングス	10,400	116.00	1,206,400		
日東製網	600	1,512.00	907,200		
芦森工業	1,200	1,719.00	2,062,800		
アツギ	4,800	1,071.00	5,140,800		
ウイルプラスHLDGS	500	968.00	484,000		
ジャパンミート	2,200	1,988.00	4,373,600		
コメダホールディングス	13,500	2,370.00	31,995,000		
サツドラホールディングス	1,000	1,964.00	1,964,000		
デファクトスタンダード	400	623.00	249,200		
ダイユー・リックHLDGS	3,100	1,191.00	3,692,100		
パロックジャパン	4,700	1,073.00	5,043,100		
クスリのアオキHLDGS	4,700	8,400.00	39,480,000	貸付株式数	400株
ダイニック	2,200	807.00	1,775,400		
共和レザー	3,400	888.00	3,019,200	貸付株式数	1,300株
力の源HD	1,600	966.00	1,545,600		
スシローグローバルHLDGS	6,400	6,220.00	39,808,000		
LIXILピバ	4,900	1,779.00	8,717,100	貸付株式数	1,000株
セーレン	14,400	1,898.00	27,331,200		
ソトー	2,200	988.00	2,173,600		
東海染工	700	1,123.00	786,100		
小松マテーレ	9,600	905.00	8,688,000		
ワコールホールディングス	17,000	3,095.00	52,615,000		
ホギメディカル	7,200	3,425.00	24,660,000		
レナウン	16,300	117.00	1,907,100		
クラウディアHLDGS	1,400	495.00	693,000		
T S Iホールディングス	21,400	753.00	16,114,200	貸付株式数	100株
マツオカコーポレーション	1,800	3,245.00	5,841,000		
ワールド	6,000	1,975.00	11,850,000	貸付株式数	2,400株
T I S	19,500	5,240.00	102,180,000		
ネオス	2,100	1,335.00	2,803,500		
電算システム	2,200	2,273.00	5,000,600		
グリー	31,400	496.00	15,574,400		
コーエーテクモHD	12,000	1,884.00	22,608,000		
三菱総合研究所	2,300	3,860.00	8,878,000		

ボルテージ	1,200	680.00	816,000	貸付株式数	400株
電算	700	2,127.00	1,488,900		
A G S	3,300	786.00	2,593,800		
ファインデックス	4,900	722.00	3,537,800	貸付株式数	1,900株
ヒト・コミュニケーションズ	1,300	1,959.00	2,546,700		
ブレインパッド	1,300	7,370.00	9,581,000		
K L a b	10,400	1,188.00	12,355,200	貸付株式数	4,100株
ポルトゥウィン・ピットクル	3,900	2,625.00	10,237,500	貸付株式数	1,200株
イーブックイニシアティブ	900	1,757.00	1,581,300	貸付株式数	300株
ネクソン	148,900	1,342.00	199,823,800		
アイスタイル	14,900	1,163.00	17,328,700	貸付株式数	6,000株
エムアップ	2,000	2,203.00	4,406,000	貸付株式数	800株
エイチーム	3,600	1,695.00	6,102,000	貸付株式数	1,700株
テクノスジャパン	4,900	1,022.00	5,007,800	貸付株式数	2,000株
e n i s h	2,000	578.00	1,156,000		
コロプラ	16,600	855.00	14,193,000	貸付株式数	4,500株 (4,500株)
オルトプラス	3,600	422.00	1,519,200	貸付株式数	1,400株
ブロードリーフ	28,900	635.00	18,351,500	貸付株式数	11,400株
クロス・マーケティングG	1,700	432.00	734,400		
デジタルハーツHLDGS	2,600	1,670.00	4,342,000	貸付株式数	1,100株
メディアドゥHLDGS	1,800	2,771.00	4,987,800	貸付株式数	900株
じげん	6,300	669.00	4,214,700		
ブイキューブ	3,100	524.00	1,624,400		
サイバーリンクス	900	1,043.00	938,700	貸付株式数	300株
ディー・エル・イー	3,800	309.00	1,174,200	貸付株式数	1,000株
フィックスターズ	5,600	1,353.00	7,576,800	貸付株式数	2,200株
VOYAGE GROUP	3,100	1,264.00	3,918,400		
オプティム	1,300	4,775.00	6,207,500	貸付株式数	500株
セレス	1,900	2,134.00	4,054,600		
特種東海製紙	3,700	4,625.00	17,112,500		
ベリサーブ	600	5,530.00	3,318,000		
ティーガイア	5,900	2,422.00	14,289,800		
セック	900	4,390.00	3,951,000		
日本アジアグループ	6,400	368.00	2,355,200		
豆蔵ホールディングス	4,000	1,072.00	4,288,000	貸付株式数	1,700株
テクマトリックス	4,100	1,890.00	7,749,000		
プロシップ	800	2,490.00	1,992,000		

ガンホー・オンライン・エ ンター	141,300	252.00	35,607,600	貸付株式数	54,900株
GMOペイメントゲート ウェイ	9,700	6,990.00	67,803,000	貸付株式数	3,800株
ザッパラス	2,800	400.00	1,120,000		
システムリサーチ	800	3,605.00	2,884,000		
インターネットイニシア ティブ	9,600	2,792.00	26,803,200		
さくらインターネット	7,000	592.00	4,144,000	貸付株式数	1,000株
ヴィンクス	2,000	1,836.00	3,672,000	貸付株式数	700株
GMOクラウド	1,300	4,010.00	5,213,000		
S R Aホールディングス	3,100	3,040.00	9,424,000		
M I N O R I ソリュショ ンズ	1,100	1,625.00	1,787,500		
システムインテグレータ	1,600	1,003.00	1,604,800	貸付株式数	600株
朝日ネット	4,800	546.00	2,620,800		
e B A S E	1,700	1,729.00	2,939,300		
アバント	1,600	1,377.00	2,203,200		
アドソル日進	2,000	1,962.00	3,924,000		
フリービット	4,000	988.00	3,952,000		
コムチュア	3,300	3,325.00	10,972,500		
サイバーコム	1,000	1,719.00	1,719,000		
アステリア	2,900	904.00	2,621,600		
王子ホールディングス	263,000	664.00	174,632,000		
日本製紙	28,000	2,110.00	59,080,000	貸付株式数	600株
三菱製紙	9,400	586.00	5,508,400	貸付株式数	4,300株
北越コーポレーション	38,500	575.00	22,137,500	貸付株式数	1,000株
中越パルプ	2,600	1,599.00	4,157,400		
巴川製紙	1,900	1,140.00	2,166,000		
大王製紙	28,500	1,394.00	39,729,000	貸付株式数	9,200株 (6,200株)
阿波製紙	1,500	588.00	882,000	貸付株式数	500株
マークラインズ	2,000	1,524.00	3,048,000		
メディカル・データ・ビジ	5,200	1,026.00	5,335,200	貸付株式数	2,000株
g u m i	6,700	742.00	4,971,400	貸付株式数	2,600株
ショーケース・ティービー	1,200	941.00	1,129,200	貸付株式数	400株
モバイルファクトリー	1,600	1,354.00	2,166,400	貸付株式数	600株
デジタル・インフォメー ション	2,600	1,613.00	4,193,800	貸付株式数	1,000株
P C Iホールディングス	1,000	2,794.00	2,794,000		

パイプドHD	900	1,035.00	931,500		
アイビーシー	900	1,365.00	1,228,500	貸付株式数	300株
ネオジャパン	1,100	906.00	996,600	貸付株式数	400株
PR TIMES	400	2,331.00	932,400	貸付株式数	100株
ランドコンピュータ	700	1,021.00	714,700		
オープンドア	2,900	3,325.00	9,642,500		
マイネット	1,800	1,848.00	3,326,400		
アカツキ	2,100	5,540.00	11,634,000	貸付株式数	400株
ベネフィットジャパン	300	923.00	276,900		
UBICOMホールディングス	1,100	1,149.00	1,263,900	貸付株式数	400株
LINE	17,800	4,080.00	72,624,000	貸付株式数	7,000株 (2,100株)
カナミックネットワーク	900	1,970.00	1,773,000		
ノムラシステムコーポレーション	500	1,014.00	507,000		
レンゴー	60,400	963.00	58,165,200		
トーモク	3,500	1,885.00	6,597,500	貸付株式数	1,400株
ザ・パック	4,400	3,230.00	14,212,000		
チェンジ	400	7,420.00	2,968,000	貸付株式数	100株
シンクロ・フード	2,400	636.00	1,526,400	貸付株式数	900株
オークネット	3,000	1,120.00	3,360,000		
AOI TYO HOLDINGS	6,400	1,050.00	6,720,000	貸付株式数	1,000株
マクロミル	7,300	1,781.00	13,001,300	貸付株式数	2,000株
ビーグリー	1,100	1,010.00	1,111,000		
オロ	600	3,805.00	2,283,000	貸付株式数	200株
昭和電工	38,800	4,550.00	176,540,000		
住友化学	459,000	616.00	282,744,000		
住友精化	2,900	4,820.00	13,978,000		
日産化学	35,900	6,160.00	221,144,000		
ラサ工業	2,100	1,663.00	3,492,300	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,400	7,950.00	42,930,000		
多木化学	900	9,670.00	8,703,000	貸付株式数	300株
テイカ	4,800	2,040.00	9,792,000		
石原産業	11,200	1,247.00	13,966,400		
片倉コープアグリ	2,200	1,197.00	2,633,400		
日東エフシー	4,600	782.00	3,597,200		
日本曹達	9,200	2,708.00	24,913,600		
東ソー	90,000	1,600.00	144,000,000		

トクヤマ	16,800	3,110.00	52,248,000	貸付株式数	3,500株
セントラル硝子	12,700	2,798.00	35,534,600		
東亜合成	36,600	1,242.00	45,457,200		
大阪ソーダ	6,400	2,657.00	17,004,800	貸付株式数	2,600株
関東電化	13,900	944.00	13,121,600		
デンカ	22,900	3,660.00	83,814,000		
イビデン	36,600	1,579.00	57,791,400	貸付株式数	14,400株
信越化学	102,900	10,135.00	1,042,891,500	貸付株式数	40,600株
日本カ - バイド	2,000	1,937.00	3,874,000		
堺 化 学	3,900	2,778.00	10,834,200		
第一稀元素化学工	4,800	1,046.00	5,020,800		
エア・ウォーター	47,500	1,837.00	87,257,500	貸付株式数	2,000株
大陽日酸	48,200	1,912.00	92,158,400		
日本化学工業	2,000	2,748.00	5,496,000		
東邦アセチレン	1,000	1,436.00	1,436,000		
日本パ - カライジング	31,700	1,487.00	47,137,900		
高压ガス	9,600	887.00	8,515,200		
チタン工業	800	2,571.00	2,056,800		
四国化成	9,900	1,246.00	12,335,400		
戸田工業	1,300	2,455.00	3,191,500		
ステラ ケミファ	3,400	3,215.00	10,931,000	貸付株式数	900株
保土谷化学	2,000	2,589.00	5,178,000		
日本触媒	9,800	7,570.00	74,186,000	貸付株式数	2,800株
大日精化	4,900	3,320.00	16,268,000		
カネカ	15,500	4,250.00	65,875,000		
協和発酵キリン	74,600	2,327.00	173,594,200		
三菱瓦斯化学	59,700	1,864.00	111,280,800		
三井化学	52,800	2,881.00	152,116,800		
J S R	58,300	1,817.00	105,931,100		
東京応化工業	10,000	3,615.00	36,150,000		
大阪有機化学	5,400	1,395.00	7,533,000	貸付株式数	1,700株
三菱ケミカルH L D G S	389,200	928.60	361,411,120	貸付株式数	161,600株
K H ネオケム	8,900	3,045.00	27,100,500		
ダイセル	90,400	1,270.00	114,808,000		
住友ベ - クライト	10,000	4,120.00	41,200,000		
積水化学	127,500	1,842.00	234,855,000		
日本ゼオン	52,600	1,154.00	60,700,400		
アイカ工業	17,500	3,825.00	66,937,500		
宇部興産	29,300	2,587.00	75,799,100		
積水樹脂	9,700	2,236.00	21,689,200		

タキロンシーアイ	12,600	639.00	8,051,400	
旭有機材	4,000	1,851.00	7,404,000	貸付株式数 700株
日立化成	26,800	1,796.00	48,132,800	
ニチバン	3,000	2,262.00	6,786,000	
リケンテクノス	16,300	512.00	8,345,600	貸付株式数 6,400株
大倉工業	2,900	2,153.00	6,243,700	
積水化成品	8,700	1,081.00	9,404,700	
群栄化学	1,700	3,150.00	5,355,000	貸付株式数 600株
タイガース ポリマー	2,800	690.00	1,932,000	
ミライアル	1,600	972.00	1,555,200	
ダイキアクシス	2,000	1,181.00	2,362,000	
ダイキョーニシカワ	12,200	1,148.00	14,005,600	
竹本容器	1,000	2,783.00	2,783,000	
森六ホールディングス	3,200	3,015.00	9,648,000	
日本化薬	37,000	1,495.00	55,315,000	
カーリットホールディングス	6,300	922.00	5,808,600	貸付株式数 2,400株
E P Sホールディングス	8,500	2,185.00	18,572,500	
ソルクシーズ	2,400	829.00	1,989,600	
レグス	1,500	1,105.00	1,657,500	
プレステージ・インター	10,700	1,441.00	15,418,700	
フェイス	2,300	1,193.00	2,743,900	
ハイマックス	700	1,811.00	1,267,700	
アミューズ	3,400	2,737.00	9,305,800	
野村総合研究所	37,300	4,985.00	185,940,500	
ドリームインキュベータ	1,700	1,895.00	3,221,500	貸付株式数 800株
サイバネットシステム	4,800	676.00	3,244,800	貸付株式数 1,900株
クイック	3,500	1,517.00	5,309,500	
T A C	3,100	266.00	824,600	
C Eホールディングス	1,500	762.00	1,143,000	
ケネディクス	53,800	535.00	28,783,000	
日本システム技術	900	1,998.00	1,798,200	貸付株式数 300株
電通	69,500	5,060.00	351,670,000	貸付株式数 400株 (400株)
インテージホールディングス	7,400	1,019.00	7,540,600	
テイクアンドギヴニーズ	2,200	1,929.00	4,243,800	
東邦システムサイエンス	1,800	905.00	1,629,000	
ぴあ	1,600	5,110.00	8,176,000	貸付株式数 700株
イオンファンタジー	1,800	3,170.00	5,706,000	貸付株式数 700株

ソースネクスト	22,700	736.00	16,707,200	
シーティーエス	6,400	757.00	4,844,800	
ネクシィーズグループ	1,700	1,803.00	3,065,100	
メディカルシステムネット ワーク	6,200	460.00	2,852,000	
日本精化	4,900	1,108.00	5,429,200	貸付株式数 1,300株
扶桑化学工業	5,900	2,374.00	14,006,600	
トリケミカル	1,300	4,490.00	5,837,000	
F I G	5,100	405.00	2,065,500	貸付株式数 2,000株
A D E K A	28,600	1,799.00	51,451,400	
日油	22,500	3,750.00	84,375,000	
ミヨシ油脂	2,800	1,278.00	3,578,400	貸付株式数 1,000株
新日本理化	11,300	189.00	2,135,700	
ハリマ化成グループ	5,000	1,168.00	5,840,000	
花 王	144,800	8,358.00	1,210,238,400	
第一工業製薬	2,200	2,753.00	6,056,600	貸付株式数 800株
石原ケミカル	1,600	2,137.00	3,419,200	
日華化学	2,100	1,227.00	2,576,700	
ニイタカ	900	1,737.00	1,563,300	貸付株式数 300株
三洋化成	4,000	5,620.00	22,480,000	
武田薬品	235,400	4,255.00	1,001,627,000	貸付株式数 93,200株 (800株)
アステラス製薬	549,800	1,744.50	959,126,100	貸付株式数 217,600株
大日本住友製薬	44,300	3,700.00	163,910,000	
塩野義製薬	78,000	7,508.00	585,624,000	
田辺三菱製薬	62,000	1,743.00	108,066,000	
わかもと製薬	7,100	298.00	2,115,800	
あすか製薬	7,200	1,230.00	8,856,000	
日本新薬	15,600	7,760.00	121,056,000	
ビオフェルミン製薬	1,000	2,758.00	2,758,000	
中外製薬	62,200	7,770.00	483,294,000	
科研製薬	10,700	5,810.00	62,167,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
エーザイ	71,400	10,415.00	743,631,000	
理研ビタミン	2,800	3,870.00	10,836,000	
ロート製薬	30,600	3,585.00	109,701,000	
小野薬品	140,700	2,745.50	386,291,850	
久光製薬	17,600	7,250.00	127,600,000	
有機合成薬品	6,700	249.00	1,668,300	
持田製薬	4,500	10,310.00	46,395,000	

参天製薬	112,900	1,943.00	219,364,700	
扶桑薬品	2,100	2,842.00	5,968,200	
日本ケミファ	800	4,135.00	3,308,000	
ツムラ	18,400	3,515.00	64,676,000	
日医工	14,500	1,744.00	25,288,000	
テ ル モ	84,400	6,685.00	564,214,000	
みらかホールディングス	15,800	2,625.00	41,475,000	
キッセイ薬品工業	10,500	3,510.00	36,855,000	
生化学工業	11,500	1,560.00	17,940,000	
栄研化学	10,400	2,605.00	27,092,000	貸付株式数 3,800株
日水製薬	2,500	1,218.00	3,045,000	貸付株式数 200株
鳥居薬品	3,200	2,630.00	8,416,000	貸付株式数 300株
J C R ファーマ	4,200	5,810.00	24,402,000	
東和薬品	2,800	8,440.00	23,632,000	貸付株式数 1,100株
富士製薬工業	4,000	1,923.00	7,692,000	
沢井製薬	12,100	6,000.00	72,600,000	
ゼリア新薬工業	11,700	2,104.00	24,616,800	
第一三共	170,700	4,167.00	711,306,900	
キョーリン製薬HD	15,100	2,728.00	41,192,800	
大幸薬品	2,700	2,010.00	5,427,000	貸付株式数 1,000株
ダイト	3,400	3,420.00	11,628,000	
大塚ホールディングス	113,700	5,535.00	629,329,500	
大正製薬HD	13,400	13,120.00	175,808,000	
ペプチドリーム	27,400	4,650.00	127,410,000	貸付株式数 10,800株
大日本塗料	7,000	1,121.00	7,847,000	貸付株式数 2,000株
日本ペイントHOLD	48,200	4,025.00	194,005,000	貸付株式数 19,000株
関西ペイント	65,600	2,127.00	139,531,200	貸付株式数 25,900株
神東塗料	7,900	184.00	1,453,600	貸付株式数 1,000株
中国塗料	19,200	1,042.00	20,006,400	貸付株式数 2,000株
日本特殊塗料	4,300	1,772.00	7,619,600	
藤倉化成	8,700	634.00	5,515,800	
太陽ホールディングス	4,900	3,655.00	17,909,500	
D I C	26,400	3,605.00	95,172,000	
サカタインクス	12,800	1,353.00	17,318,400	貸付株式数 5,100株
東洋インキSCホールディングン	12,500	2,807.00	35,087,500	
T & K T O K A	5,000	1,205.00	6,025,000	貸付株式数 2,000株
アルプス技研	5,000	2,098.00	10,490,000	
サニックス	10,000	231.00	2,310,000	貸付株式数 2,200株
ダイオーズ	1,200	1,390.00	1,668,000	

日本空調サービス	6,300	761.00	4,794,300	貸付株式数	600株
オリエンタルランド	67,400	11,295.00	761,283,000		
フォーカスシステムズ	3,900	1,114.00	4,344,600		
ダスキン	15,200	2,617.00	39,778,400		
パーク24	34,300	3,065.00	105,129,500	貸付株式数	9,700株
明光ネットワークジャパン	7,200	1,039.00	7,480,800	貸付株式数	2,900株
ファルコホールディングス	3,100	1,666.00	5,164,600	貸付株式数	1,000株
クレスコ	1,800	3,850.00	6,930,000		
フジ・メディア・HD	60,900	1,769.00	107,732,100		
秀英予備校	1,500	496.00	744,000	貸付株式数	600株
田谷	1,400	649.00	908,600		
ラウンドワン	17,600	1,260.00	22,176,000		
リゾートトラスト	24,200	1,867.00	45,181,400	貸付株式数	3,000株
オービック	20,300	9,810.00	199,143,000		
ジャストシステム	8,300	2,551.00	21,173,300	貸付株式数	3,800株
TDCソフト	5,100	973.00	4,962,300	貸付株式数	1,000株
ヤフー	380,700	325.00	123,727,500		
ビー・エム・エル	7,300	2,885.00	21,060,500		
ワタベウェディング	1,000	1,095.00	1,095,000		
トレンドマイクロ	31,200	6,510.00	203,112,000	貸付株式数	3,900株 (3,800株)
りらいあコミュニケーション	10,200	1,061.00	10,822,200	貸付株式数	3,800株 (3,800株)
インフォメーションディベ ロ	1,600	1,445.00	2,312,000		
リソー教育	28,800	390.00	11,232,000		
日本オラクル	9,500	7,370.00	70,015,000	貸付株式数	2,400株
早稲田アカデミー	800	2,295.00	1,836,000		
アルファシステムズ	1,900	2,666.00	5,065,400		
フューチャー	8,000	1,753.00	14,024,000		
CAC HOLDINGS	4,400	1,074.00	4,725,600	貸付株式数	1,000株
ソフトバンク・テクノ	2,500	2,118.00	5,295,000	貸付株式数	1,000株
トーセ	1,600	938.00	1,500,800	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	69,600	2,014.00	140,174,400		
オービックビジネスC	3,000	9,940.00	29,820,000		
伊藤忠テクノソリューションズ	26,700	2,189.00	58,446,300		
アイティフォー	7,000	855.00	5,985,000	貸付株式数	2,800株
東京個別指導学院	2,000	1,333.00	2,666,000		
東計電算	900	3,395.00	3,055,500		
サイバーエージェント	35,100	5,140.00	180,414,000	貸付株式数	9,500株

楽天	265,800	914.00	242,941,200		
エックスネット	1,100	916.00	1,007,600		
クリーク・アンド・リバー社	3,300	1,186.00	3,913,800	貸付株式数	1,300株
テー・オー・ダブリュー	5,400	896.00	4,838,400		
大塚商会	31,700	3,820.00	121,094,000		
サイボウズ	6,800	700.00	4,760,000		
ソフトブレーン	4,500	528.00	2,376,000	貸付株式数	1,000株
セントラルスポーツ	2,100	3,790.00	7,959,000		
パラカ	1,500	1,936.00	2,904,000	貸付株式数	800株
電通国際情報S	3,600	3,840.00	13,824,000	貸付株式数	900株
デジタルガレージ	11,400	3,105.00	35,397,000	貸付株式数	4,500株
イーエムシステムズ	4,700	1,172.00	5,508,400	貸付株式数	1,800株
ウェザーニューズ	1,900	3,215.00	6,108,500	貸付株式数	700株 (700株)
C I J	4,500	753.00	3,388,500	貸付株式数	1,000株
東洋ビジネスエンジ	600	2,210.00	1,326,000	貸付株式数	200株
日本エンタープライズ	5,700	230.00	1,311,000	貸付株式数	2,200株
WOWOW	2,800	3,320.00	9,296,000	貸付株式数	1,200株
スカラ	4,700	843.00	3,962,100		
フルキャストホールディングス	5,700	2,311.00	13,172,700		
エン・ジャパン	6,200	4,580.00	28,396,000	貸付株式数	2,400株
富士フイルムHLDGS	123,900	4,510.00	558,789,000		
コニカミノルタ	130,300	1,022.00	133,166,600		
資生堂	118,600	7,224.00	856,766,400	貸付株式数	6,500株
ライオン	83,000	2,239.00	185,837,000		
高砂香料	4,100	3,890.00	15,949,000		
マンダム	13,400	3,330.00	44,622,000	貸付株式数	2,900株 (2,900株)
ミルボン	7,400	4,920.00	36,408,000		
ファンケル	26,600	2,962.00	78,789,200		
コーセー	10,100	16,930.00	170,993,000		
コタ	2,800	1,566.00	4,384,800		
シーズ・ホールディングス	7,400	5,860.00	43,364,000		
シーボン	700	2,712.00	1,898,400		
ポーラ・オルビスHD	25,400	3,205.00	81,407,000		
ノエビアホールディングス	3,800	5,290.00	20,102,000		
アジュバンコスメジャパン	1,300	1,027.00	1,335,100	貸付株式数	500株
エステー	4,200	2,182.00	9,164,400		

アグロカネショウ	2,400	2,468.00	5,923,200	
コニシ	10,600	1,873.00	19,853,800	
長谷川香料	7,200	1,568.00	11,289,600	貸付株式数 2,800株
星光PMC	4,300	916.00	3,938,800	
小林製薬	16,700	7,900.00	131,930,000	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
荒川化学工業	5,400	1,631.00	8,807,400	貸付株式数 200株
メック	4,100	1,340.00	5,494,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	2,000	2,387.00	4,774,000	
タカラバイオ	15,600	2,838.00	44,272,800	
JCU	7,700	1,848.00	14,229,600	
新田ゼラチン	3,700	747.00	2,763,900	貸付株式数 2,000株
OATアグリオ	800	2,239.00	1,791,200	
デクセリアルズ	15,400	991.00	15,261,400	貸付株式数 300株
アース製薬	4,500	5,590.00	25,155,000	貸付株式数 200株
北興化学	6,500	558.00	3,627,000	
大成ラミック	1,900	3,090.00	5,871,000	
クミアイ化学	24,600	726.00	17,859,600	
日本農薬	14,600	558.00	8,146,800	
昭和シエル石油	55,400	1,759.00	97,448,600	
富士興産	2,200	629.00	1,383,800	
ニチレキ	7,500	1,144.00	8,580,000	貸付株式数 1,000株
ユシロ化学	3,000	1,356.00	4,068,000	貸付株式数 1,900株
ビーピー・カストロール	2,100	1,505.00	3,160,500	貸付株式数 800株
富士石油	14,100	340.00	4,794,000	
MORESCO	2,400	1,664.00	3,993,600	
出光興産	46,200	4,130.00	190,806,000	貸付株式数 18,100株 (18,100株)
JXTGホールディングス	1,008,300	686.30	691,996,290	
コスモエネルギーHLDGS	17,200	2,649.00	45,562,800	貸付株式数 6,800株 (4,500株)
横浜ゴム	34,600	2,376.00	82,209,600	
東洋ゴム	30,600	1,793.00	54,865,800	
ブリヂストン	183,400	4,600.00	843,640,000	
住友ゴム	53,600	1,517.00	81,311,200	貸付株式数 3,800株
藤倉ゴム	4,900	512.00	2,508,800	貸付株式数 1,000株
オカモト	4,200	5,970.00	25,074,000	
アキレス	4,200	2,256.00	9,475,200	
フコク	2,500	931.00	2,327,500	

ニッタ	6,700	3,910.00	26,197,000	貸付株式数	1,500株
クリエートメディック	1,800	1,101.00	1,981,800		
住友理工	11,700	1,112.00	13,010,400	貸付株式数	2,500株
三ツ星ベルト	7,800	2,461.00	19,195,800	貸付株式数	3,000株
バンドー化学	11,400	1,233.00	14,056,200		
A G C	59,700	3,855.00	230,143,500		
日本板硝子	28,300	968.00	27,394,400		
石塚硝子	800	2,149.00	1,719,200	貸付株式数	300株
有沢製作所	9,300	821.00	7,635,300	貸付株式数	2,300株
日本山村硝子	2,300	1,782.00	4,098,600		
日本電気硝子	25,800	3,050.00	78,690,000		
オハラ	2,400	2,389.00	5,733,600	貸付株式数	900株
住友大阪セメント	12,000	5,100.00	61,200,000	貸付株式数	300株
太平洋セメント	37,700	3,840.00	144,768,000		
リソルホールディングス	600	4,035.00	2,421,000		
日本ヒユ - ム	5,900	960.00	5,664,000		
日本コンクリート	12,700	308.00	3,911,600		
三谷セキサン	2,800	2,841.00	7,954,800		
アジアパイルHD	8,300	694.00	5,760,200	貸付株式数	2,900株
東海カーボン	54,100	1,576.00	85,261,600	貸付株式数	21,400株
日本カーボン	2,800	5,420.00	15,176,000	貸付株式数	1,100株
東洋炭素	3,500	2,737.00	9,579,500		
ノリタケ	3,600	5,630.00	20,268,000		
T O T O	45,900	4,395.00	201,730,500	貸付株式数	18,100株
日本碍子	72,500	1,683.00	122,017,500		
日本特殊陶業	50,400	2,332.00	117,532,800		
ダントーホールディングス	5,600	127.00	711,200		
M A R U W A	2,000	6,420.00	12,840,000		
品川リフラクトリーズ	1,600	4,305.00	6,888,000		
黒崎播磨	1,200	6,750.00	8,100,000	貸付株式数	400株 (400株)
ヨータイ	5,100	686.00	3,498,600	貸付株式数	1,900株
イソライト	3,000	547.00	1,641,000		
東京窯業	7,500	466.00	3,495,000	貸付株式数	1,000株
ニッカトー	2,700	1,079.00	2,913,300		
フジインコーポレーテッド	5,300	2,436.00	12,910,800		
クニミネ工業	2,000	983.00	1,966,000		
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,143.00	1,257,300		
ニチアス	16,300	2,203.00	35,908,900		

新日鐵住金	263,900	2,076.00	547,856,400	
神戸製鋼所	108,100	934.00	100,965,400	
中山製鋼所	7,700	585.00	4,504,500	
合同製鐵	2,800	1,946.00	5,448,800	
J F Eホールディングス	159,200	2,001.50	318,638,800	
日新製鋼	14,400	1,465.00	21,096,000	
東京製鐵	31,500	978.00	30,807,000	
共英製鋼	6,700	2,200.00	14,740,000	貸付株式数 2,600株
大和工業	12,500	2,968.00	37,100,000	
東京鐵鋼	2,300	1,371.00	3,153,300	貸付株式数 600株
大阪製鐵	4,000	2,001.00	8,004,000	
淀川製鋼所	7,900	2,429.00	19,189,100	貸付株式数 2,000株
丸一鋼管	20,900	3,370.00	70,433,000	
モリ工業	1,700	2,716.00	4,617,200	
大同特殊鋼	9,600	4,595.00	44,112,000	
日本高周波	2,000	686.00	1,372,000	
日本冶金工	48,700	282.00	13,733,400	貸付株式数 19,900株
山陽特殊製鋼	7,400	2,580.00	19,092,000	
愛知製鋼	3,300	3,995.00	13,183,500	
日立金属	63,600	1,278.00	81,280,800	貸付株式数 3,000株
日本金属	1,400	1,397.00	1,955,800	
大平洋金属	4,000	3,320.00	13,280,000	貸付株式数 1,400株
新日本電工	35,000	268.00	9,380,000	貸付株式数 13,900株
栗本鉄工所	2,900	1,645.00	4,770,500	
虹 技	700	1,601.00	1,120,700	
日本鑄鉄管	500	1,274.00	637,000	貸付株式数 200株
日本製鋼所	17,900	2,074.00	37,124,600	
三菱製鋼	4,300	2,029.00	8,724,700	
日亜鋼業	8,400	337.00	2,830,800	
日本精線	800	3,510.00	2,808,000	貸付株式数 200株
エンビプロHD	1,200	582.00	698,400	
大紀アルミニウム	9,600	651.00	6,249,600	貸付株式数 4,600株
日本軽金属HD	159,700	254.00	40,563,800	
三井金属	15,900	2,593.00	41,228,700	
東邦亜鉛	3,200	3,830.00	12,256,000	
三菱マテリアル	39,000	3,185.00	124,215,000	
住友鉱山	80,800	3,305.00	267,044,000	
DOWAホールディングス	13,800	3,740.00	51,612,000	貸付株式数 4,700株
古河機金	9,700	1,439.00	13,958,300	貸付株式数 3,900株
エス・サイエンス	26,400	69.00	1,821,600	

大阪チタニウム	6,900	2,119.00	14,621,100	貸付株式数 2,500株 (1,800株)
東邦チタニウム	10,600	1,395.00	14,787,000	
U A C J	8,900	2,377.00	21,155,300	貸付株式数 3,400株
C Kサンエツ	1,100	2,760.00	3,036,000	
古河電工	17,000	3,315.00	56,355,000	
住友電工	220,500	1,592.50	351,146,250	
フジクラ	70,700	493.00	34,855,100	
昭和電線H L D G S	6,800	697.00	4,739,600	貸付株式数 3,000株
東京特殊電線	700	1,961.00	1,372,700	
タツタ電線	11,600	537.00	6,229,200	
カナレ電気	1,000	2,028.00	2,028,000	
平河ヒューテック	2,400	1,324.00	3,177,600	
リョービ	7,200	3,095.00	22,284,000	貸付株式数 500株
アールステイ	7,200	730.00	5,256,000	
アサヒHD	11,000	2,351.00	25,861,000	
東洋製罐グループHD	37,800	2,585.00	97,713,000	
ホッカンホールディングス	2,900	1,717.00	4,979,300	
コロナ	3,200	1,141.00	3,651,200	
横河ブリッジH L D G S	10,900	1,860.00	20,274,000	貸付株式数 3,000株
O S J B H D	29,000	338.00	9,802,000	
駒井ハルテック	1,100	2,177.00	2,394,700	
高田機工	500	2,751.00	1,375,500	
三和ホールディングス	60,900	1,378.00	83,920,200	
文化シャッター-	17,200	784.00	13,484,800	
三協立山	8,200	1,317.00	10,799,400	
アルインコ	4,700	1,099.00	5,165,300	貸付株式数 1,000株
東洋シャッター-	1,400	681.00	953,400	
L I X I Lグループ	87,000	1,471.00	127,977,000	
日本ファイルコン	4,400	592.00	2,604,800	貸付株式数 2,100株
ノーリツ	13,200	1,688.00	22,281,600	
長府製作所	6,000	2,388.00	14,328,000	
リンナイ	10,500	8,140.00	85,470,000	
ユニプレス	11,500	2,138.00	24,587,000	
ダイニチ工業	3,100	745.00	2,309,500	
日東精工	8,000	643.00	5,144,000	
三洋工業	700	2,047.00	1,432,900	
岡 部	11,800	990.00	11,682,000	
ジーテクト	6,400	1,591.00	10,182,400	貸付株式数 2,500株
中国工業	900	595.00	535,500	

東 プ レ	10,900	2,312.00	25,200,800	
高周波熱錬	11,300	1,024.00	11,571,200	貸付株式数 1,700株
東京製鋼	3,600	1,153.00	4,150,800	貸付株式数 1,400株
サンコール	3,200	722.00	2,310,400	
モリテックスチル	4,500	476.00	2,142,000	
パイオラックス	9,500	2,780.00	26,410,000	貸付株式数 500株
エイチワン	5,800	1,100.00	6,380,000	
日本発条	58,700	1,010.00	59,287,000	
中央発條	600	3,470.00	2,082,000	
アドバネクス	700	1,588.00	1,111,600	
三浦工業	25,600	3,025.00	77,440,000	
タ ク マ	21,600	1,595.00	34,452,000	
テクノプロ・ホールディング グ	10,700	5,680.00	60,776,000	
アトラ	1,200	505.00	606,000	貸付株式数 400株
インターワークス	1,100	759.00	834,900	
アイ・アールジャパンHD	1,800	1,456.00	2,620,800	貸付株式数 700株
K e e P e r 技研	1,900	1,117.00	2,122,300	
ファーストロジック	1,100	875.00	962,500	
三機サービス	900	1,862.00	1,675,800	
G u n o s y	3,500	3,380.00	11,830,000	
デザインワン・ジャパン	1,200	436.00	523,200	
イー・ガーディアン	2,700	2,675.00	7,222,500	貸付株式数 1,000株
リブセンス	3,100	339.00	1,050,900	
ジャパンマテリアル	15,600	1,314.00	20,498,400	貸付株式数 2,400株
ベクトル	6,900	1,840.00	12,696,000	貸付株式数 2,700株
ウチヤマホールディングス	3,000	488.00	1,464,000	
ライクキッズネクスト	1,200	1,194.00	1,432,800	
キャリアリンク	2,100	444.00	932,400	
I B J	3,800	809.00	3,074,200	貸付株式数 1,500株
アサンテ	2,200	2,278.00	5,011,600	貸付株式数 800株
N・フィールド	3,600	1,154.00	4,154,400	貸付株式数 1,200株 (100株)
バリューHR	1,200	2,074.00	2,488,800	
M&Aキャピタルパート ナー	1,400	4,265.00	5,971,000	貸付株式数 600株
ライドオンエクスプレスH D	2,400	1,572.00	3,772,800	
E R Iホールディングス	1,600	925.00	1,480,000	
アビスト	900	3,530.00	3,177,000	

シグマクシス	2,700	1,076.00	2,905,200	
ウィルグループ	3,700	1,181.00	4,369,700	
エスクロー A J	7,700	465.00	3,580,500	貸付株式数 3,200株
日本ビューホテル	1,800	1,199.00	2,158,200	
リクルートホールディングス	408,400	3,123.00	1,275,433,200	
エラン	2,000	3,000.00	6,000,000	貸付株式数 700株
ツガミ	13,100	852.00	11,161,200	
オークマ	7,500	5,650.00	42,375,000	貸付株式数 2,900株
東芝機械	6,600	1,984.00	13,094,400	
アマダホールディングス	91,300	1,232.00	112,481,600	
アイダエンジニア	16,200	909.00	14,725,800	
滝澤鉄工所	1,700	1,615.00	2,745,500	
F U J I	17,600	1,493.00	26,276,800	
牧野フライス	6,900	4,605.00	31,774,500	
オーエスジー	29,000	2,279.00	66,091,000	
ダイジェット	600	1,860.00	1,116,000	
旭ダイヤモンド	15,300	702.00	10,740,600	
D M G 森精機	37,200	1,590.00	59,148,000	貸付株式数 13,800株
ソディック	12,800	838.00	10,726,400	貸付株式数 5,100株
ディスコ	8,000	16,550.00	132,400,000	
日東工器	3,300	2,510.00	8,283,000	
日進工具	1,700	2,651.00	4,506,700	貸付株式数 100株
パンチ工業	4,100	622.00	2,550,200	
富士ダイス	2,500	785.00	1,962,500	
土木管理総合試験	2,500	608.00	1,520,000	貸付株式数 900株
日本郵政	464,000	1,382.00	641,248,000	貸付株式数 184,800株
ベルシステム 2 4 H L D G S	9,600	1,507.00	14,467,200	
鎌倉新書	4,200	1,254.00	5,266,800	
一蔵	700	713.00	499,100	
L I T A L I C O	1,300	1,910.00	2,483,000	貸付株式数 500株
グローバルグループ	700	1,182.00	827,400	
エポラブルアジア	1,600	2,259.00	3,614,400	
アトラエ	1,100	2,400.00	2,640,000	
ストライク	1,400	2,929.00	4,100,600	貸付株式数 500株
ソラスト	13,900	1,436.00	19,960,400	
セラク	1,300	717.00	932,100	
インソース	1,900	2,471.00	4,694,900	貸付株式数 700株
豊田自動織機	48,300	5,820.00	281,106,000	

豊和工業	3,200	864.00	2,764,800	貸付株式数 900株 (900株)
OKK	2,300	909.00	2,090,700	
石川製作所	1,400	1,498.00	2,097,200	貸付株式数 400株
東洋機械金属	4,200	604.00	2,536,800	
津田駒工業	1,200	2,216.00	2,659,200	
エンシュウ	1,500	1,323.00	1,984,500	貸付株式数 600株
島精機製作所	8,100	3,515.00	28,471,500	貸付株式数 3,200株 (100株)
オプトラン	5,800	2,459.00	14,262,200	貸付株式数 2,200株
NCホールディングス	1,800	574.00	1,033,200	
フリー	4,700	1,025.00	4,817,500	
ヤマシンフィルタ	10,300	905.00	9,321,500	貸付株式数 4,000株 (1,700株)
日阪製作所	7,200	953.00	6,861,600	
やまびこ	11,300	1,298.00	14,667,400	
平田機工	2,800	6,040.00	16,912,000	貸付株式数 1,100株
ペガサスミシン製造	5,500	831.00	4,570,500	
タツモ	1,800	898.00	1,616,400	貸付株式数 700株
ナプテスコ	32,500	3,140.00	102,050,000	
三井海洋開発	6,300	2,825.00	17,797,500	
レオン自動機	5,800	1,822.00	10,567,600	貸付株式数 2,200株
SMC	17,500	38,480.00	673,400,000	
新川	4,400	513.00	2,257,200	
ホソカワミクロン	2,000	5,170.00	10,340,000	
ユニオンツール	2,600	3,630.00	9,438,000	
オイレス工業	8,300	1,997.00	16,575,100	貸付株式数 200株
日精エーエスビー	1,700	4,065.00	6,910,500	貸付株式数 700株
サト - ホールディングス	7,100	2,995.00	21,264,500	
技研製作所	4,100	4,140.00	16,974,000	貸付株式数 800株
日本エアーテック	1,800	691.00	1,243,800	
カワタ	1,200	1,756.00	2,107,200	貸付株式数 400株
日精樹脂工業	4,800	1,021.00	4,900,800	
オカダアイヨン	2,000	1,718.00	3,436,000	
ワイエイシイホールディングス	2,300	739.00	1,699,700	貸付株式数 900株
小松製作所	270,100	3,033.00	819,213,300	貸付株式数 106,800株 (102,200株)
住友重機械	34,100	3,765.00	128,386,500	
日立建機	23,900	3,135.00	74,926,500	

日 工	1,600	2,505.00	4,008,000	
巴工業	2,400	2,366.00	5,678,400	
井関農機	5,900	1,847.00	10,897,300	
TOWA	5,000	741.00	3,705,000	貸付株式数 1,400株
丸山製作所	1,200	1,638.00	1,965,600	
北川鉄工所	2,600	2,573.00	6,689,800	
シンニッタン	9,100	413.00	3,758,300	
ローツエ	2,600	1,859.00	4,833,400	貸付株式数 1,300株
タカキタ	2,000	667.00	1,334,000	
クボタ	320,100	1,937.00	620,033,700	貸付株式数 37,700株
荏原実業	1,600	2,005.00	3,208,000	
東洋エンジニア	7,700	874.00	6,729,800	貸付株式数 3,500株 (1,300株)
三菱化工機	1,900	1,731.00	3,288,900	貸付株式数 100株
月島機械	11,800	1,330.00	15,694,000	
帝国電機製作所	4,200	1,656.00	6,955,200	
東京機械	2,400	441.00	1,058,400	
新東工業	14,100	980.00	13,818,000	
渋谷工業	5,300	4,135.00	21,915,500	
アイチ コーポレーション	10,000	657.00	6,570,000	貸付株式数 3,800株
小森コーポレーション	16,400	1,252.00	20,532,800	
鶴見製作所	4,700	1,988.00	9,343,600	貸付株式数 1,000株
住友精密	900	3,515.00	3,163,500	
酒井重工業	1,100	2,694.00	2,963,400	
荏原製作所	26,400	2,944.00	77,721,600	
石井鉄工所	1,100	1,884.00	2,072,400	
西島製作所	5,900	1,042.00	6,147,800	貸付株式数 1,000株
北越工業	6,100	1,262.00	7,698,200	貸付株式数 2,000株
千代田化工建	47,600	322.00	15,327,200	貸付株式数 19,000株
ダイキン工業	81,200	12,610.00	1,023,932,000	貸付株式数 32,100株
オルガノ	2,100	3,140.00	6,594,000	
ト - ヨ - カネツ	2,200	2,414.00	5,310,800	
栗田工業	32,200	3,045.00	98,049,000	
椿本チエイン	7,800	4,245.00	33,111,000	
大同工業	2,700	1,076.00	2,905,200	
日 機 装	19,400	1,132.00	21,960,800	
木村化工機	4,700	450.00	2,115,000	貸付株式数 1,000株
新興プランテック	12,100	1,154.00	13,963,400	
アネスト岩田	9,400	1,232.00	11,580,800	貸付株式数 1,800株
ダイフク	32,800	5,810.00	190,568,000	貸付株式数 13,000株

サムコ	1,600	1,310.00	2,096,000		
加藤製作所	3,000	3,035.00	9,105,000		
油研工業	1,000	2,045.00	2,045,000		
タダノ	28,800	1,361.00	39,196,800	貸付株式数	11,300株
フジテック	21,700	1,394.00	30,249,800	貸付株式数	3,800株
C K D	16,500	1,141.00	18,826,500	貸付株式数	6,600株
キトー	4,500	1,871.00	8,419,500		
平和	16,700	2,418.00	40,380,600		
理想科学工業	5,200	1,938.00	10,077,600		
SANKYO	15,100	4,540.00	68,554,000		
日本金銭機械	6,500	1,128.00	7,332,000	貸付株式数	1,800株
マースグループHLDGS	3,700	2,344.00	8,672,800	貸付株式数	600株
福島工業	3,800	4,375.00	16,625,000		
オーイズミ	2,800	519.00	1,453,200		
ダイコク電機	2,700	1,701.00	4,592,700		
竹内製作所	9,900	2,285.00	22,621,500		
アマノ	17,000	2,448.00	41,616,000		
JUKI	8,300	1,515.00	12,574,500		
サンデンホールディングス	7,200	880.00	6,336,000		
蛇の目マシン	5,300	567.00	3,005,100	貸付株式数	1,000株
ブラザー工業	77,700	1,897.00	147,396,900		
マックス	9,100	1,492.00	13,577,200		
モリタホールディングス	10,400	2,238.00	23,275,200		
グローリー	16,400	2,871.00	47,084,400		
新晃工業	5,700	1,650.00	9,405,000		
大和冷機工業	9,100	1,314.00	11,957,400		
セガサミーホールディングス	59,200	1,602.00	94,838,400		
日本ピストンリング	2,100	2,086.00	4,380,600		
リケン	2,800	5,660.00	15,848,000		
TPR	8,000	2,699.00	21,592,000		
ツバキ・ナカシマ	8,900	1,933.00	17,203,700	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,400	8,810.00	153,294,000		
大豊工業	4,800	1,115.00	5,352,000		
日本精工	122,300	1,067.00	130,494,100		
NTN	128,100	381.00	48,806,100		
ジェイテクト	57,200	1,444.00	82,596,800		
不二越	5,500	4,850.00	26,675,000	貸付株式数	2,200株
ミネベアミツミ	110,700	1,842.00	203,909,400		

日本トムソン	17,600	628.00	11,052,800	貸付株式数	7,800株
T H K	37,000	2,601.00	96,237,000		
ユーシン精機	4,700	1,174.00	5,517,800		
前澤給装工業	2,300	1,933.00	4,445,900		
イーグル工業	7,200	1,489.00	10,720,800	貸付株式数	2,300株
前澤工業	4,200	386.00	1,621,200	貸付株式数	1,600株
日本ピラ - 工業	6,000	1,538.00	9,228,000		
キッツ	24,200	972.00	23,522,400		
日立	268,000	3,288.00	881,184,000	貸付株式数	106,000株
三菱電機	595,400	1,498.00	891,909,200	貸付株式数	235,200株
富士電機	38,400	3,565.00	136,896,000		
東洋電機製造	2,700	1,534.00	4,141,800	貸付株式数	600株
安川電機	69,200	3,540.00	244,968,000	貸付株式数	300株
シンフォニアテクノロジー	8,300	1,689.00	14,018,700		
明電舎	12,200	1,606.00	19,593,200		
オリジン電気	1,600	1,932.00	3,091,200		
山洋電気	2,800	4,360.00	12,208,000		
デンヨー	6,000	1,604.00	9,624,000		
アイモバイル	1,300	701.00	911,300		
キャリアインデックス	2,000	2,117.00	4,234,000		
MS - Japan	2,300	1,562.00	3,592,600	貸付株式数	900株
船場	900	967.00	870,300		
グレイステクノロジー	1,500	2,151.00	3,226,500	貸付株式数	600株
ジャパンエレベーターSHD	3,400	2,125.00	7,225,000		
フルテック	700	1,172.00	820,400	貸付株式数	200株
グリーンズ	1,200	1,542.00	1,850,400		
ツナグ・ソリューションズ	500	732.00	366,000	貸付株式数	200株
日総工産	1,400	1,965.00	2,751,000	貸付株式数	500株 (500株)
キュービーネットHLDGS	2,900	2,219.00	6,435,100		
三桜工業	7,500	648.00	4,860,000		
マキタ	72,600	4,455.00	323,433,000		
東芝テック	7,400	3,065.00	22,681,000	貸付株式数	2,900株
芝浦メカトロニクス	1,000	4,060.00	4,060,000		
マブチモーター	16,400	3,955.00	64,862,000	貸付株式数	6,500株
日本電産	71,800	15,120.00	1,085,616,000	貸付株式数	28,400株

ユーエムシーエレクトロニクス	3,200	2,491.00	7,971,200	
トレックス・セミコンダクター	2,000	1,559.00	3,118,000	
東光高岳	3,500	1,582.00	5,537,000	貸付株式数 1,000株
ダブル・スコープ	8,700	1,379.00	11,997,300	貸付株式数 3,600株 (900株)
宮越ホールディングス	2,500	1,138.00	2,845,000	貸付株式数 900株
ダイヘン	6,800	2,775.00	18,870,000	
ヤーマン	8,700	1,871.00	16,277,700	
JVCケンウッド	43,800	288.00	12,614,400	貸付株式数 12,800株
ミマキエンジニアリング	5,300	929.00	4,923,700	
第一精工	2,500	1,384.00	3,460,000	貸付株式数 1,000株
日新電機	14,200	951.00	13,504,200	
大崎電気	12,900	813.00	10,487,700	
オムロン	63,400	4,990.00	316,366,000	
日東工業	10,000	1,928.00	19,280,000	
I D E C	8,000	2,517.00	20,136,000	
不二電機工業	600	1,373.00	823,800	
ジーエス・ユアサ コーポ	21,500	2,623.00	56,394,500	
サクサホールディングス	1,400	2,017.00	2,823,800	
メルコホールディングス	2,500	3,890.00	9,725,000	貸付株式数 800株
テクノメディカ	1,300	2,191.00	2,848,300	
日本電気	77,300	3,520.00	272,096,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
富士通	57,500	6,987.00	401,752,500	
沖電気	25,800	1,500.00	38,700,000	
岩崎通信機	2,800	755.00	2,114,000	
電気興業	3,100	2,960.00	9,176,000	貸付株式数 1,000株
サンケン電気	6,900	2,419.00	16,691,100	
ナカヨ	1,100	1,529.00	1,681,900	
アイホン	3,300	1,717.00	5,666,100	貸付株式数 1,400株
ルネサスエレクトロニクス	62,000	535.00	33,170,000	
セイコーエプソン	74,000	1,804.00	133,496,000	
ワコム	43,400	574.00	24,911,600	貸付株式数 17,000株
アルバック	13,700	4,170.00	57,129,000	
アクセル	2,400	586.00	1,406,400	
E I Z O	5,400	4,750.00	25,650,000	貸付株式数 2,100株
ジャパンディスプレイ	139,100	70.00	9,737,000	貸付株式数 55,600株
日本信号	16,100	1,012.00	16,293,200	貸付株式数 3,000株

京三製作所	14,000	505.00	7,070,000	貸付株式数	2,000株
能美防災	8,200	2,254.00	18,482,800		
ホーチキ	4,100	1,313.00	5,383,300	貸付株式数	1,800株
星和電機	3,000	460.00	1,380,000	貸付株式数	1,000株
エレコム	5,500	3,005.00	16,527,500	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
パナソニック	680,500	1,164.50	792,442,250		
シャープ	59,100	1,684.00	99,524,400		
アンリツ	38,500	1,861.00	71,648,500	貸付株式数	5,600株
富士通ゼネラル	18,100	1,603.00	29,014,300	貸付株式数	7,100株
ソニー	399,700	5,937.00	2,373,018,900		
T D K	31,200	8,950.00	279,240,000	貸付株式数	10,000株
帝国通信工業	2,500	1,219.00	3,047,500		
タムラ製作所	23,000	656.00	15,088,000	貸付株式数	9,000株
アルプス電気	55,000	2,631.00	144,705,000		
池上通信機	1,800	1,431.00	2,575,800	貸付株式数	900株
パイオニア	98,800	92.00	9,089,600	貸付株式数	40,000株
日本電波工業	5,400	491.00	2,651,400	貸付株式数	2,600株
鈴木	2,800	716.00	2,004,800		
日本トリム	1,100	6,200.00	6,820,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド ディー・ ジー	3,000	2,461.00	7,383,000	貸付株式数	300株
フオスタ - 電機	7,000	1,547.00	10,829,000		
クラリオン	7,000	2,490.00	17,430,000		
S M K	1,600	2,552.00	4,083,200		
ヨコオ	4,200	1,729.00	7,261,800	貸付株式数	1,200株
ティアック	4,200	262.00	1,100,400	貸付株式数	1,600株
ホシデン	17,400	880.00	15,312,000		
ヒロセ電機	8,600	11,970.00	102,942,000		
日本航空電子	13,600	1,430.00	19,448,000		
T O A	6,900	1,228.00	8,473,200		
マクセルホールディングス	12,700	1,592.00	20,218,400	貸付株式数	5,000株
古野電気	7,700	1,292.00	9,948,400	貸付株式数	2,900株
ユニデンホールディングス	1,700	2,521.00	4,285,700		
アルパイン	10,300	1,839.00	18,941,700		
スミダコーポレーション	5,100	1,520.00	7,752,000	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
アイコム	3,200	2,352.00	7,526,400		
リオン	2,700	2,032.00	5,486,400		

本多通信工業	5,000	629.00	3,145,000	
船井電機	6,100	747.00	4,556,700	貸付株式数 4,000株 (1,800株)
横河電機	59,700	2,086.00	124,534,200	
新電元工業	2,100	4,675.00	9,817,500	
アズビル	38,900	2,450.00	95,305,000	
東亜ディーケーケー	2,900	958.00	2,778,200	
日本光電工業	26,400	3,695.00	97,548,000	
チノール	2,000	1,481.00	2,962,000	
共和電業	5,700	421.00	2,399,700	
日本電子材料	2,300	735.00	1,690,500	
堀場製作所	11,800	5,320.00	62,776,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
アドバンテスト	40,600	2,436.00	98,901,600	貸付株式数 16,100株
小野測器	2,600	705.00	1,833,000	
エスペック	5,200	2,107.00	10,956,400	
キーエンス	29,300	61,600.00	1,804,880,000	
日置電機	3,100	4,240.00	13,144,000	
シスメックス	46,400	6,049.00	280,673,600	
日本マイクロニクス	9,700	981.00	9,515,700	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
メガチップス	4,700	2,749.00	12,920,300	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,500	4,860.00	17,010,000	
IMAGICA GROUP	4,900	607.00	2,974,300	貸付株式数 1,900株
澤藤電機	700	1,953.00	1,367,100	
デンソー	131,400	5,247.00	689,455,800	
原田工業	1,900	934.00	1,774,600	貸付株式数 600株
コーセル	8,200	1,160.00	9,512,000	貸付株式数 3,200株
イリソ電子工業	5,400	4,975.00	26,865,000	貸付株式数 1,300株
オプテックスグループ	10,500	2,304.00	24,192,000	貸付株式数 4,200株
千代田インテグレ	2,600	2,440.00	6,344,000	
アイ・オー・データ	2,400	1,181.00	2,834,400	
レーザーテック	12,300	3,655.00	44,956,500	
スタンレー電気	42,100	3,305.00	139,140,500	
岩崎電気	3,200	1,524.00	4,876,800	
ウシオ電機	36,100	1,272.00	45,919,200	
岡谷電機	4,300	439.00	1,887,700	
ヘリオステクノH	5,500	786.00	4,323,000	

日本セラミック	6,100	2,860.00	17,446,000	
遠藤照明	4,100	798.00	3,271,800	
古河電池	5,000	829.00	4,145,000	貸付株式数 1,700株 (1,000株)
双信電機	2,800	443.00	1,240,400	
山一電機	4,300	1,535.00	6,600,500	貸付株式数 1,900株
図 研	3,900	1,766.00	6,887,400	
日本電子	11,900	1,987.00	23,645,300	
カ シ オ	52,700	1,583.00	83,424,100	
ファナック	56,700	19,390.00	1,099,413,000	貸付株式数 22,400株
日本シイエムケイ	15,200	900.00	13,680,000	貸付株式数 3,100株
エンプラス	2,700	3,135.00	8,464,500	貸付株式数 700株 (700株)
大真空	2,200	1,036.00	2,279,200	
ロ - ム	28,800	7,900.00	227,520,000	貸付株式数 10,400株
浜松ホトニクス	42,800	3,950.00	169,060,000	貸付株式数 15,000株
三井ハイテック	6,600	1,285.00	8,481,000	貸付株式数 2,600株 (500株)
新光電気工業	20,100	803.00	16,140,300	
京 セ ラ	90,900	6,125.00	556,762,500	
協栄産業	700	1,738.00	1,216,600	
太陽誘電	26,500	2,153.00	57,054,500	貸付株式数 10,400株
村田製作所	62,600	17,315.00	1,083,919,000	貸付株式数 24,700株 (4,800株)
ユーシン	9,200	985.00	9,062,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
双葉電子工業	9,800	1,779.00	17,434,200	
日東電工	45,000	6,203.00	279,135,000	
北陸電気工業	2,100	1,076.00	2,259,600	貸付株式数 600株
東海理化電機	15,700	2,085.00	32,734,500	
ニチコン	18,800	902.00	16,957,600	
日本ケミコン	4,200	2,343.00	9,840,600	
K O A	8,900	1,527.00	13,590,300	
三井E & S H D	21,300	1,231.00	26,220,300	
日立造船	46,700	390.00	18,213,000	貸付株式数 18,600株
三菱重工業	99,800	4,317.00	430,836,600	貸付株式数 38,400株
川崎重工業	46,400	2,643.00	122,635,200	
I H I	45,800	3,455.00	158,239,000	
名村造船所	17,900	559.00	10,006,100	
サノヤスホールディングス	7,800	215.00	1,677,000	貸付株式数 2,900株

スプリックス	1,600	1,947.00	3,115,200		
日本車輛	2,200	2,646.00	5,821,200	貸付株式数	800株
三菱ロジスネクスト	7,200	1,310.00	9,432,000		
近畿車輛	800	2,395.00	1,916,000		
F P G	18,700	1,230.00	23,001,000	貸付株式数	7,400株
島根銀行	1,400	859.00	1,202,600		
じもとホールディングス	39,600	150.00	5,940,000		
全国保証	16,500	3,880.00	64,020,000	貸付株式数	6,500株
めぶきフィナンシャルG	305,700	343.00	104,855,100	貸付株式数	7,000株
東京きらぼしF G	8,000	2,099.00	16,792,000		
九州フィナンシャルG	97,200	531.00	51,613,200		
かんぼ生命保険	22,000	2,865.00	63,030,000	貸付株式数	4,600株
ゆうちょ銀行	168,000	1,326.00	222,768,000	貸付株式数	65,800株
富山第一銀行	13,700	433.00	5,932,100	貸付株式数	4,400株
コンコルディア・フィナンシャル	375,300	533.00	200,034,900		
ジェイリース	1,200	480.00	576,000		
西日本フィナンシャルHD	37,800	1,232.00	46,569,600		
マーキュリアインベストメント	2,300	864.00	1,987,200	貸付株式数	900株
イントラスト	1,700	430.00	731,000	貸付株式数	600株
日本モーゲージサービス	800	1,003.00	802,400		
C a s a	1,800	1,170.00	2,106,000		
アルヒ	5,300	1,797.00	9,524,100	貸付株式数	2,700株
日産自動車	703,600	994.30	699,589,480		
いすゞ自動車	188,600	1,616.00	304,777,600		
トヨタ自動車	664,800	6,803.00	4,522,634,400		
日野自動車	74,400	1,160.00	86,304,000		
三菱自動車工業	220,600	696.00	153,537,600		
エフテック	4,100	1,113.00	4,563,300		
レシップホールディングス	4,000	723.00	2,892,000		
G M B	1,100	1,174.00	1,291,400		
ファルテック	1,000	969.00	969,000		
武蔵精密工業	14,000	1,796.00	25,144,000		
日産車体	11,800	943.00	11,127,400	貸付株式数	2,100株
新明和工業	27,900	1,527.00	42,603,300	貸付株式数	300株
極東開発工業	11,900	1,646.00	19,587,400		
日信工業	11,000	1,504.00	16,544,000		
トピー工業	4,900	2,678.00	13,122,200		
ティラド	2,100	2,557.00	5,369,700		

曙ブレーキ	32,900	218.00	7,172,200	貸付株式数 13,300株 (100株)
タチエス	10,100	1,599.00	16,149,900	
N O K	31,900	1,710.00	54,549,000	貸付株式数 12,600株
フタバ産業	16,500	612.00	10,098,000	貸付株式数 7,000株
K Y B	6,200	2,827.00	17,527,400	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
市光工業	8,900	744.00	6,621,600	貸付株式数 3,700株
大同メタル工業	9,700	950.00	9,215,000	
プレス工業	29,600	613.00	18,144,800	
ミクニ	7,500	588.00	4,410,000	貸付株式数 1,000株
太平洋工業	12,600	1,703.00	21,457,800	
ケーヒン	13,700	1,964.00	26,906,800	
河西工業	7,200	997.00	7,178,400	
アイシン精機	49,100	4,490.00	220,459,000	貸付株式数 19,000株
マ ッ ダ	186,900	1,210.00	226,149,000	
今仙電機製作所	5,400	1,060.00	5,724,000	
本田技研	503,200	3,202.00	1,611,246,400	
スズキ	109,100	5,655.00	616,960,500	貸付株式数 45,900株
S U B A R U	185,100	2,523.00	467,007,300	
安永	2,900	1,914.00	5,550,600	貸付株式数 1,300株
ヤマハ発動機	84,100	2,335.00	196,373,500	貸付株式数 32,500株
ショーワ	14,100	1,518.00	21,403,800	
小糸製作所	35,800	6,090.00	218,022,000	
T B K	7,000	448.00	3,136,000	貸付株式数 1,000株
エクセディ	8,000	2,914.00	23,312,000	
ミツバ	11,000	747.00	8,217,000	
豊田合成	19,300	2,185.00	42,170,500	
愛三工業	9,200	831.00	7,645,200	
盟和産業	1,000	1,082.00	1,082,000	
日本プラスト	4,600	923.00	4,245,800	
ヨ ロ ズ	5,500	1,494.00	8,217,000	
エフ・シー・シー	10,700	2,951.00	31,575,700	
新家工業	1,300	1,827.00	2,375,100	
シマノ	24,000	16,580.00	397,920,000	
テイ・エス テック	13,800	3,290.00	45,402,000	
関西みらいF G	27,700	915.00	25,345,500	
3 3 F G	5,100	1,919.00	9,786,900	
第四北越フィナンシャルG	10,200	3,700.00	37,740,000	

ジャムコ	3,000	3,205.00	9,615,000	貸付株式数 1,100株 (900株)
小野建	5,100	1,678.00	8,557,800	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
はるやまHLDGS	2,700	896.00	2,419,200	
ノジマ	10,400	2,605.00	27,092,000	
佐鳥電機	4,400	1,051.00	4,624,400	貸付株式数 1,000株
カップ・クリエイト	8,400	1,500.00	12,600,000	
エコトレーディング	1,500	633.00	949,500	
伯東	3,900	1,339.00	5,222,100	
コンドーテック	4,400	1,033.00	4,545,200	貸付株式数 1,000株
中山福	3,400	551.00	1,873,400	
ライトオン	5,000	944.00	4,720,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,500	2,775.00	23,587,500	
ジーンズメイト	1,800	483.00	869,400	
三菱食品	6,400	3,065.00	19,616,000	
良品計画	8,300	30,550.00	253,565,000	貸付株式数 3,200株
三城ホールディングス	7,500	494.00	3,705,000	
松田産業	4,500	1,492.00	6,714,000	
第一興商	8,700	5,180.00	45,066,000	
メディパルHD	63,300	2,600.00	164,580,000	
アドヴァン	9,000	1,099.00	9,891,000	貸付株式数 600株 (600株)
SPK	1,200	2,390.00	2,868,000	
萩原電気HLDGS	2,100	3,205.00	6,730,500	
アルビス	2,200	2,866.00	6,305,200	貸付株式数 900株
アズワン	4,200	8,380.00	35,196,000	
スズデン	1,900	1,287.00	2,445,300	
尾家産業	1,800	1,336.00	2,404,800	
シモジマ	3,500	1,128.00	3,948,000	
ドウシシャ	5,600	2,104.00	11,782,400	貸付株式数 2,000株
小津産業	1,200	1,969.00	2,362,800	
コナカ	7,700	497.00	3,826,900	
高速	3,400	1,209.00	4,110,600	
ハウスローゼ	700	1,907.00	1,334,900	
G-7ホールディングス	1,700	2,636.00	4,481,200	貸付株式数 600株
たけびし	2,700	1,478.00	3,990,600	
イオン北海道	6,000	812.00	4,872,000	
コジマ	8,800	518.00	4,558,400	

ヒマラヤ	1,700	1,039.00	1,766,300	貸付株式数	600株
コーナン商事	7,700	2,800.00	21,560,000		
ネットワンシステムズ	20,800	2,347.00	48,817,600	貸付株式数	7,300株 (7,300株)
エコス	2,200	2,087.00	4,591,400		
ワタミ	7,700	1,422.00	10,949,400	貸付株式数	3,200株
マルシェ	1,300	795.00	1,033,500		
リックス	1,300	1,580.00	2,054,000		
システムソフト	13,500	114.00	1,539,000	貸付株式数	5,400株
ドンキホーテホールディング グ	38,100	6,890.00	262,509,000	貸付株式数	15,000株 (15,000株)
丸文	5,100	847.00	4,319,700		
西松屋チェーン	12,900	997.00	12,861,300		
ゼンショーホールディング ス	27,800	2,826.00	78,562,800		
ハピネット	4,800	1,615.00	7,752,000		
幸楽苑ホールディングス	3,700	2,241.00	8,291,700	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,200	1,094.00	1,312,800		
橋本総業HLDGS	1,000	1,460.00	1,460,000		
日本ライフライン	18,400	1,798.00	33,083,200	貸付株式数	7,200株
サイゼリヤ	9,600	2,170.00	20,832,000	貸付株式数	3,800株
タカショー	2,800	478.00	1,338,400		
エクセル	2,200	2,009.00	4,419,800	貸付株式数	1,300株
V Tホールディングス	19,600	469.00	9,192,400		
マルカキカイ	1,900	2,244.00	4,263,600	貸付株式数	700株
アルゴグラフィックス	2,500	4,540.00	11,350,000		
魚力	1,600	1,441.00	2,305,600		
IDOM	19,800	570.00	11,286,000	貸付株式数	7,800株
日本エム・ディ・エム	3,400	1,389.00	4,722,600		
ポプラ	1,400	610.00	854,000	貸付株式数	500株
フジ・コーポレーション	1,200	1,995.00	2,394,000		
ユナイテッドアローズ	6,700	3,825.00	25,627,500	貸付株式数	1,900株 (1,900株)
進和	3,500	2,430.00	8,505,000	貸付株式数	1,000株
エスケイジャパン	1,400	891.00	1,247,400	貸付株式数	500株
ダイトロン	2,700	1,540.00	4,158,000		
ハイデイ日高	7,600	2,357.00	17,913,200		
シークス	7,400	1,808.00	13,379,200	貸付株式数	2,900株
京都きもの友禅	4,000	449.00	1,796,000		

コロワイド	19,500	2,642.00	51,519,000	
ピーシーデポコーポ	7,700	554.00	4,265,800	貸付株式数 700株 (500株)
田中商事	1,800	627.00	1,128,600	
オーハシテクニカ	3,200	1,398.00	4,473,600	
壱番屋	4,100	4,765.00	19,536,500	貸付株式数 1,700株
白銅	1,800	1,772.00	3,189,600	
トップカルチャー	2,200	383.00	842,600	貸付株式数 800株
P L A N T	1,400	1,095.00	1,533,000	貸付株式数 500株
スギホールディングス	12,800	5,340.00	68,352,000	
島津製作所	76,800	2,654.00	203,827,200	
J M S	5,100	595.00	3,034,500	貸付株式数 1,000株
クボテック	1,200	342.00	410,400	
長野計器	4,600	957.00	4,402,200	
ブイ・テクノロジー	1,400	15,930.00	22,302,000	貸付株式数 500株
スター精密	10,200	1,692.00	17,258,400	
東京計器	3,700	1,109.00	4,103,300	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
愛知時計	800	4,045.00	3,236,000	
インターアクション	3,200	2,580.00	8,256,000	
オーバル	5,500	284.00	1,562,000	貸付株式数 1,000株
東京精密	10,800	3,380.00	36,504,000	
マニー	7,200	5,340.00	38,448,000	
ニコン	104,000	1,780.00	185,120,000	
トプコン	32,000	1,751.00	56,032,000	
オリンパス	88,900	3,195.00	284,035,500	
理研計器	5,200	2,376.00	12,355,200	
S C R E E Nホールディングス	10,300	5,680.00	58,504,000	
キヤノン電子	5,500	2,143.00	11,786,500	
タムロン	5,200	1,828.00	9,505,600	貸付株式数 300株
HOYA	120,100	6,900.00	828,690,000	貸付株式数 47,500株
シード	2,500	1,584.00	3,960,000	
ノーリツ鋼機	4,700	1,955.00	9,188,500	
エー・アンド・デイ	5,400	833.00	4,498,200	貸付株式数 1,000株
朝日インテック	21,600	5,320.00	114,912,000	
キヤノン	321,000	3,220.00	1,033,620,000	
リコー	179,600	1,102.00	197,919,200	
シチズン時計	65,000	600.00	39,000,000	
リズム時計	1,900	2,045.00	3,885,500	

大研医器	4,600	765.00	3,519,000	
メニコン	8,100	2,993.00	24,243,300	
シンシア	900	639.00	575,100	
中本パックス	1,600	1,847.00	2,955,200	
スノーピーク	2,200	1,387.00	3,051,400	
パラマウントベッドHD	6,800	4,795.00	32,606,000	
トランザクション	3,200	827.00	2,646,400	
SHOBI	1,700	398.00	676,600	
ニホンフラッシュ	2,500	2,080.00	5,200,000	
前田工織	6,600	2,606.00	17,199,600	貸付株式数 600株
永大産業	7,600	449.00	3,412,400	貸付株式数 1,000株
アートネイチャー	6,400	682.00	4,364,800	貸付株式数 2,000株
バンダイナムコHLDGS	61,700	4,770.00	294,309,000	
アイフィスジャパン	1,300	663.00	861,900	貸付株式数 100株
共立印刷	10,200	248.00	2,529,600	
SHOEI	2,900	4,435.00	12,861,500	貸付株式数 1,200株
フランスベッドHLDGS	8,200	969.00	7,945,800	
マーベラス	8,800	917.00	8,069,600	貸付株式数 3,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,400	5,870.00	61,048,000	
萩原工業	3,200	1,710.00	5,472,000	
エイベックス	9,900	1,545.00	15,295,500	貸付株式数 3,900株
トッパン・フォームズ	12,700	1,041.00	13,220,700	
フジシールインターナショナル	13,300	4,090.00	54,397,000	
タカラトミー	24,900	1,416.00	35,258,400	貸付株式数 9,800株
廣濟堂	5,500	428.00	2,354,000	貸付株式数 1,000株
エステールホールディングス	1,500	700.00	1,050,000	
アーク	23,500	100.00	2,350,000	
レック	6,400	2,058.00	13,171,200	貸付株式数 2,500株
タカノ	2,200	889.00	1,955,800	
三光合成	4,600	390.00	1,794,000	
プロネクサス	5,000	1,147.00	5,735,000	
ホクシン	3,700	160.00	592,000	
ウッドワン	2,000	1,172.00	2,344,000	貸付株式数 800株
大建工業	4,500	2,116.00	9,522,000	
きもと	10,000	219.00	2,190,000	
凸版印刷	84,200	1,828.00	153,917,600	

大日本印刷	84,000	2,626.00	220,584,000	
図書印刷	5,600	830.00	4,648,000	
共同印刷	1,800	2,651.00	4,771,800	
N I S S H A	12,200	1,781.00	21,728,200	貸付株式数 4,800株 (2,700株)
光村印刷	500	2,305.00	1,152,500	
藤森工業	5,300	3,240.00	17,172,000	
ヴィア・ホールディングス	7,200	731.00	5,263,200	貸付株式数 3,700株
宝印刷	3,100	1,841.00	5,707,100	
前澤化成工業	4,000	1,134.00	4,536,000	
アシックス	59,200	1,636.00	96,851,200	
ツ ツ ミ	1,900	2,174.00	4,130,600	貸付株式数 700株
ウェーブロックHLDGS	1,400	876.00	1,226,400	
ジェイ エス ピー	3,500	2,418.00	8,463,000	貸付株式数 1,000株
ニ チ ハ	8,300	3,105.00	25,771,500	
エフピコ	4,900	6,930.00	33,957,000	貸付株式数 1,900株
小松ウオール工業	1,800	2,095.00	3,771,000	
ヤマハ	35,500	4,890.00	173,595,000	
河合楽器	1,800	4,030.00	7,254,000	貸付株式数 100株
クリナップ	5,500	725.00	3,987,500	貸付株式数 2,200株
ビジョン	36,000	4,675.00	168,300,000	
天馬	4,100	2,087.00	8,556,700	貸付株式数 2,000株
兼松サステック	400	1,761.00	704,400	
キングジム	4,700	914.00	4,295,800	
象印マホービン	11,100	1,171.00	12,998,100	貸付株式数 4,400株
リンテック	14,100	2,570.00	36,237,000	
信越ポリマー	10,600	830.00	8,798,000	
東 リ	14,600	297.00	4,336,200	貸付株式数 1,000株
イトーキ	10,800	617.00	6,663,600	
任 天 堂	36,700	34,610.00	1,270,187,000	
三菱鉛筆	9,800	2,177.00	21,334,600	
松 風	2,700	1,233.00	3,329,100	
タカラスタンダ - ド	12,400	1,778.00	22,047,200	
コ ク ヨ	28,500	1,749.00	49,846,500	
ナカバヤシ	5,700	591.00	3,368,700	
ニ フ コ	23,900	2,895.00	69,190,500	
立川ブラインド	2,600	1,217.00	3,164,200	貸付株式数 400株
グローブライド	2,900	2,889.00	8,378,100	貸付株式数 1,100株
オカムラ	20,900	1,637.00	34,213,300	貸付株式数 8,100株
バルカー	4,800	2,753.00	13,214,400	

MUTOHホールディングス	700	2,278.00	1,594,600	
伊藤忠	410,600	2,016.00	827,769,600	貸付株式数 169,800株
丸紅	578,600	847.50	490,363,500	
スクロール	9,000	454.00	4,086,000	貸付株式数 3,600株
高島	900	2,032.00	1,828,800	
ヨンドシーホールディングス	6,400	2,465.00	15,776,000	
三陽商会	3,600	2,054.00	7,394,400	貸付株式数 1,200株
長瀬産業	32,800	1,697.00	55,661,600	
ナイガイ	2,000	495.00	990,000	
蝶理	3,800	1,894.00	7,197,200	
豊田通商	65,500	3,920.00	256,760,000	
オンワードホールディングス	35,600	677.00	24,101,200	
三共生興	10,200	457.00	4,661,400	貸付株式数 1,000株
兼松	23,300	1,448.00	33,738,400	
美津濃	5,800	2,582.00	14,975,600	
ツカモトコーポレーション	1,000	1,178.00	1,178,000	
ユニー・ファミリーマートHD	16,400	16,110.00	264,204,000	貸付株式数 6,400株
ルックホールディングス	2,100	1,171.00	2,459,100	
三井物産	483,800	1,774.50	858,503,100	貸付株式数 190,700株
日本紙パルプ	3,300	4,485.00	14,800,500	
東京エレクトロン	39,800	15,875.00	631,825,000	
日立ハイテクノロジーズ	17,900	4,045.00	72,405,500	
カメイ	7,600	1,385.00	10,526,000	
東都水産	800	2,012.00	1,609,600	
OUGホールディングス	900	2,651.00	2,385,900	
スターゼン	2,100	4,390.00	9,219,000	貸付株式数 1,000株
セイコーHD	9,200	2,520.00	23,184,000	
山善	23,000	1,203.00	27,669,000	貸付株式数 1,000株
椿本興業	1,300	3,370.00	4,381,000	貸付株式数 500株
住友商事	347,000	1,743.50	604,994,500	
日本ユニシス	18,400	2,895.00	53,268,000	
内田洋行	2,600	2,701.00	7,022,600	貸付株式数 1,300株
三菱商事	412,300	3,062.00	1,262,462,600	貸付株式数 162,300株
第一実業	2,700	4,010.00	10,827,000	
キヤノンマーケティングJPN	16,800	2,178.00	36,590,400	

西華産業	3,300	1,647.00	5,435,100	貸付株式数	1,000株
佐藤商事	5,000	996.00	4,980,000		
菱洋エレクトロ	6,000	1,798.00	10,788,000		
東京産業	6,300	595.00	3,748,500	貸付株式数	1,000株
ユアサ商事	6,000	3,805.00	22,830,000		
神鋼商事	1,300	2,758.00	3,585,400		
小林産業	3,100	305.00	945,500		
阪和興業	10,100	3,400.00	34,340,000		
正栄食品	3,100	4,840.00	15,004,000		
カナデン	5,800	1,309.00	7,592,200		
菱電商事	4,900	1,600.00	7,840,000		
ニプロ	41,200	1,543.00	63,571,600		
フルサト工業	3,100	1,916.00	5,939,600		
岩谷産業	13,000	3,780.00	49,140,000	貸付株式数	5,200株
すてきナイスグループ	2,400	1,133.00	2,719,200	貸付株式数	600株
昭光通商	2,300	803.00	1,846,900	貸付株式数	900株
ニチモウ	1,300	1,845.00	2,398,500		
極東貿易	1,900	1,767.00	3,357,300		
イワキ	7,000	528.00	3,696,000	貸付株式数	2,800株
兼松エレクトロニクス	3,200	3,640.00	11,648,000	貸付株式数	1,000株
三愛石油	15,600	1,298.00	20,248,800		
稲畑産業	14,200	1,628.00	23,117,600		
G S Iクレオス	1,600	1,488.00	2,380,800		
明和産業	6,200	442.00	2,740,400	貸付株式数	1,000株
ゴ-ルドウイン	5,300	11,770.00	62,381,000	貸付株式数	2,000株 (1,400株)
ユニ・チャ-ム	126,500	3,554.00	449,581,000	貸付株式数	300株 (300株)
デサント	14,300	2,223.00	31,788,900	貸付株式数	5,600株
キング	3,000	500.00	1,500,000		
ワキタ	12,500	1,305.00	16,312,500		
ヤマトインタ-ナショナル	3,700	457.00	1,690,900		
東邦ホールディングス	17,300	3,015.00	52,159,500	貸付株式数	6,800株
サンゲツ	17,700	2,172.00	38,444,400		
ミツウロコグループ	8,300	710.00	5,893,000		
シナネンホールディングス	2,400	2,749.00	6,597,600		
伊藤忠エネクス	12,900	1,067.00	13,764,300		
サンリオ	18,200	2,346.00	42,697,200	貸付株式数	4,600株
サンワテクノス	3,500	1,247.00	4,364,500	貸付株式数	1,000株
リョ-サン	6,500	3,310.00	21,515,000	貸付株式数	100株

新光商事	5,600	1,757.00	9,839,200	
トーヨー	2,600	2,395.00	6,227,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
三信電気	5,000	2,019.00	10,095,000	貸付株式数 2,000株
東陽テクニカ	6,500	908.00	5,902,000	
モスフード サービス	7,600	3,065.00	23,294,000	貸付株式数 2,800株
加賀電子	5,800	2,404.00	13,943,200	
三益半導体	4,500	1,545.00	6,952,500	
ソーダニツカ	6,600	632.00	4,171,200	貸付株式数 1,000株
立花エレテック	4,200	1,769.00	7,429,800	
木曽路	7,100	2,618.00	18,587,800	
S R Sホールディングス	6,700	1,032.00	6,914,400	貸付株式数 2,000株
千趣会	11,100	318.00	3,529,800	貸付株式数 4,600株
タカキュー	4,800	197.00	945,600	
ケーヨー	10,700	609.00	6,516,300	
上新電機	6,900	2,892.00	19,954,800	
日本瓦斯	10,700	4,040.00	43,228,000	
ロイヤルホールディングス	10,300	2,859.00	29,447,700	
東天紅	500	1,465.00	732,500	貸付株式数 200株
いなげや	6,700	1,582.00	10,599,400	貸付株式数 2,500株
島忠	13,300	3,065.00	40,764,500	
チヨダ	6,100	2,049.00	12,498,900	貸付株式数 2,000株
ライフコーポレーション	4,400	2,708.00	11,915,200	
リンガーハット	7,200	2,477.00	17,834,400	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
MrMaxHD	8,100	544.00	4,406,400	
テナライド	5,200	415.00	2,158,000	
AOKIホールディングス	11,700	1,465.00	17,140,500	
オークワ	8,300	1,248.00	10,358,400	貸付株式数 2,000株
コメリ	9,000	2,717.00	24,453,000	
青山商事	11,300	2,848.00	32,182,400	
しまむら	6,800	9,640.00	65,552,000	貸付株式数 2,700株
はせがわ	2,900	465.00	1,348,500	
高島屋	45,900	1,650.00	75,735,000	貸付株式数 18,200株
松屋	11,900	1,414.00	16,826,600	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	30,100	1,947.00	58,604,700	
近鉄百貨店	2,300	3,730.00	8,579,000	
パルコ	5,700	1,310.00	7,467,000	
丸井グループ	49,800	2,447.00	121,860,600	貸付株式数 8,600株

クレディセゾン	40,900	1,457.00	59,591,300	
アクシアル リテイリング	4,800	4,035.00	19,368,000	
井筒屋	3,300	239.00	788,700	貸付株式数 1,300株
イオン	226,300	2,721.00	615,762,300	貸付株式数 89,400株
イズミ	11,900	6,430.00	76,517,000	
フォーバル	2,600	1,009.00	2,623,400	
平和堂	11,900	3,150.00	37,485,000	
フジ	7,000	2,139.00	14,973,000	
ヤオコー	6,700	6,790.00	45,493,000	
ゼビオホールディングス	7,100	1,473.00	10,458,300	貸付株式数 1,000株
ケースホールディングス	61,000	1,197.00	73,017,000	貸付株式数 13,000株 (13,000株)
PALTAC	10,600	6,080.00	64,448,000	貸付株式数 4,200株
三谷産業	7,900	314.00	2,480,600	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
OLYMPICグループ	3,500	865.00	3,027,500	
日産東京販売HD	8,500	347.00	2,949,500	
新生銀行	42,900	1,558.00	66,838,200	貸付株式数 400株
あおぞら銀行	32,700	3,730.00	121,971,000	
三菱UFJフィナンシャルG	4,095,000	624.50	2,557,327,500	
りそなホールディングス	643,500	601.90	387,322,650	
三井住友トラストHD	115,600	4,552.00	526,211,200	
三井住友フィナンシャルG	414,400	4,183.00	1,733,435,200	
千葉銀行	208,400	745.00	155,258,000	
群馬銀行	116,800	541.00	63,188,800	
武蔵野銀行	8,700	3,070.00	26,709,000	
千葉興業銀行	15,900	445.00	7,075,500	
筑波銀行	24,000	242.00	5,808,000	貸付株式数 10,000株
七十七銀行	18,400	2,273.00	41,823,200	
青森銀行	4,500	3,125.00	14,062,500	貸付株式数 1,700株
秋田銀行	3,700	2,332.00	8,628,400	
山形銀行	6,600	2,387.00	15,754,200	貸付株式数 2,600株 (1,600株)
岩手銀行	4,100	4,140.00	16,974,000	貸付株式数 300株
東邦銀行	52,600	376.00	19,777,600	貸付株式数 4,900株
東北銀行	3,000	1,345.00	4,035,000	貸付株式数 1,000株
みちのく銀行	3,800	1,817.00	6,904,600	
ふくおかフィナンシャルG	47,800	2,589.00	123,754,200	
静岡銀行	148,300	1,019.00	151,117,700	

十六銀行	7,800	2,696.00	21,028,800	
スルガ銀行	59,500	538.00	32,011,000	貸付株式数 23,800株 (7,000株)
八十二銀行	106,400	521.00	55,434,400	
山梨中央銀行	7,300	1,663.00	12,139,900	
大垣共立銀行	9,200	2,490.00	22,908,000	
福井銀行	4,900	1,926.00	9,437,400	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
北國銀行	6,200	4,250.00	26,350,000	
清水銀行	2,400	1,901.00	4,562,400	貸付株式数 300株 (300株)
富山銀行	1,100	3,780.00	4,158,000	貸付株式数 400株
滋賀銀行	11,700	2,848.00	33,321,600	貸付株式数 4,600株
南都銀行	6,800	2,574.00	17,503,200	
百五銀行	52,900	450.00	23,805,000	
京都銀行	21,100	5,460.00	115,206,000	
紀陽銀行	20,800	1,808.00	37,606,400	貸付株式数 8,200株
ほくほくフィナンシャルG	38,900	1,484.00	57,727,600	
広島銀行	86,200	684.00	58,960,800	貸付株式数 25,000株
山陰合同銀行	34,900	895.00	31,235,500	
中国銀行	37,600	1,057.00	39,743,200	
鳥取銀行	2,000	1,553.00	3,106,000	
伊予銀行	77,400	697.00	53,947,800	
百十四銀行	6,200	2,883.00	17,874,600	
四国銀行	8,400	1,399.00	11,751,600	貸付株式数 2,000株
阿波銀行	9,400	3,280.00	30,832,000	貸付株式数 1,100株
大分銀行	3,600	3,820.00	13,752,000	貸付株式数 1,400株
宮崎銀行	3,900	3,285.00	12,811,500	
佐賀銀行	3,500	2,065.00	7,227,500	貸付株式数 1,300株
十八銀行	3,700	2,853.00	10,556,100	
沖縄銀行	5,300	3,735.00	19,795,500	貸付株式数 200株
琉球銀行	13,400	1,298.00	17,393,200	貸付株式数 4,700株
セブン銀行	198,600	352.00	69,907,200	貸付株式数 78,100株
みずほフィナンシャルG	7,992,900	188.30	1,505,063,070	貸付株式数 1,400,000株
高知銀行	2,000	909.00	1,818,000	
山口フィナンシャルG	73,300	1,176.00	86,200,800	
アクリーティブ	900	412.00	370,800	
芙蓉総合リース	6,700	6,880.00	46,096,000	
興銀リース	11,000	2,800.00	30,800,000	
東京センチュリー	11,900	5,420.00	64,498,000	

SBIホールディングス	70,100	2,576.00	180,577,600	貸付株式数	1,800株
日本証券金融	26,000	660.00	17,160,000		
アイフル	89,800	311.00	27,927,800	貸付株式数	35,500株 (300株)
日本アジア投資	5,000	255.00	1,275,000	貸付株式数	1,000株
長野銀行	2,000	1,651.00	3,302,000		
名古屋銀行	4,700	3,670.00	17,249,000	貸付株式数	1,200株
北洋銀行	88,000	329.00	28,952,000		
愛知銀行	2,100	4,390.00	9,219,000		
中京銀行	2,400	2,355.00	5,652,000		
大光銀行	2,000	2,125.00	4,250,000		
愛媛銀行	8,100	1,155.00	9,355,500	貸付株式数	3,600株
トマト銀行	2,300	1,303.00	2,996,900		
京葉銀行	25,900	800.00	20,720,000		
栃木銀行	29,900	295.00	8,820,500		
北日本銀行	1,800	2,484.00	4,471,200		
東和銀行	10,300	934.00	9,620,200		
福島銀行	5,100	564.00	2,876,400	貸付株式数	3,000株
大東銀行	2,900	837.00	2,427,300		
リコーリース	4,600	3,695.00	16,997,000		
イオンフィナンシャルサー ビス	37,600	2,200.00	82,720,000		
アコム	118,700	417.00	49,497,900		
ジャックス	6,500	2,058.00	13,377,000	貸付株式数	2,500株
オリコ	163,600	176.00	28,793,600	貸付株式数	46,100株
日立キャピタル	14,000	2,805.00	39,270,000		
アプラスフィナンシャル	31,700	103.00	3,265,100	貸付株式数	16,300株
オリックス	391,800	1,839.50	720,716,100		
三菱UFJリース	133,000	619.00	82,327,000		
ジャフコ	9,600	4,150.00	39,840,000	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
九州リースサービス	3,000	704.00	2,112,000		
トモニホールディングス	45,100	473.00	21,332,300		
大和証券G本社	471,900	626.50	295,645,350		
野村ホールディングス	1,079,200	511.40	551,902,880	貸付株式数	427,200株
岡三証券グループ	49,900	558.00	27,844,200	貸付株式数	18,000株
丸三証券	17,800	894.00	15,913,200	貸付株式数	6,900株
東洋証券	21,300	205.00	4,366,500		
東海東京HD	70,100	555.00	38,905,500		
光世証券	1,400	1,012.00	1,416,800		

水戸証券	17,100	307.00	5,249,700	貸付株式数	400株
いちよし証券	12,300	957.00	11,771,100		
松井証券	29,000	1,286.00	37,294,000		
SOMP Oホールディングス	114,500	4,386.00	502,197,000		
だいこう証券ビジ	2,400	491.00	1,178,400		
日本取引所グループ	159,100	2,045.00	325,359,500		
マネックスG	55,400	420.00	23,268,000	貸付株式数	21,800株 (5,100株)
カブドットコム証券	43,900	419.00	18,394,100		
極東証券	7,800	1,312.00	10,233,600	貸付株式数	3,200株
岩井コスモホールディング	6,000	1,411.00	8,466,000	貸付株式数	2,400株
藍澤証券	11,000	765.00	8,415,000	貸付株式数	1,000株
フィデアホール	56,200	155.00	8,711,000		
池田泉州HD	61,600	338.00	20,820,800	貸付株式数	4,100株
アニコム ホールディングス	4,500	3,765.00	16,942,500	貸付株式数	500株
MS & AD	152,700	3,445.00	526,051,500		
SONY FH	48,000	2,380.00	114,240,000		
マネーパートナーズGP	6,800	340.00	2,312,000		
小林洋行	2,000	283.00	566,000	貸付株式数	800株
第一生命HLDGS	330,600	1,978.00	653,926,800		
東京海上HD	211,800	5,605.00	1,187,139,000	貸付株式数	84,400株
アドバンテッジリスクマネ	2,200	1,224.00	2,692,800	貸付株式数	800株
イー・ギャランティ	5,500	1,120.00	6,160,000	貸付株式数	3,300株
アサックス	2,600	608.00	1,580,800		
NECキャピタルソリューション	2,500	1,686.00	4,215,000		
T & Dホールディングス	180,800	1,613.00	291,630,400		
アドバンスクリエイト	1,300	2,057.00	2,674,100		
三井不動産	313,300	2,715.00	850,609,500		
三菱地所	414,300	1,821.00	754,440,300		
平和不動産	11,700	1,941.00	22,709,700		
東京建物	65,300	1,294.00	84,498,200	貸付株式数	8,700株
ダイビル	18,200	1,242.00	22,604,400		
京阪神ビルディング	11,700	912.00	10,670,400	貸付株式数	2,000株
住友不動産	133,100	4,208.00	560,084,800		
太平洋興発	2,300	887.00	2,040,100		
大京	9,000	2,969.00	26,721,000		
テーオーシー	14,300	851.00	12,169,300		

東京楽天地	900	4,845.00	4,360,500		
レオパレス21	73,700	493.00	36,334,100	貸付株式数	26,400株
スターツコーポレーション	8,400	2,654.00	22,293,600	貸付株式数	3,100株
フジ住宅	8,500	907.00	7,709,500	貸付株式数	1,000株
空港施設	8,100	599.00	4,851,900		
明和地所	4,200	627.00	2,633,400		
ゴールドクレスト	4,900	1,764.00	8,643,600		
リログループ	31,500	3,120.00	98,280,000	貸付株式数	7,900株 (7,900株)
日本エスリード	2,400	1,621.00	3,890,400		
日神不動産	9,000	513.00	4,617,000		
日本エスコ	10,900	737.00	8,033,300	貸付株式数	4,600株
タカラレーベン	27,900	343.00	9,569,700	貸付株式数	11,200株
サンヨーハウジング名古屋	4,000	1,044.00	4,176,000		
イオンモール	30,200	2,041.00	61,638,200		
ファースト住建	2,600	1,215.00	3,159,000	貸付株式数	900株
ランド	258,500	10.00	2,585,000		
カチタス	6,600	3,265.00	21,549,000	貸付株式数	3,100株
東祥	3,600	4,230.00	15,228,000	貸付株式数	1,400株
トーセイ	8,400	1,029.00	8,643,600		
穴吹興産	900	3,040.00	2,736,000	貸付株式数	300株
エヌ・ティ・ティ都市開発	9,500	1,679.00	15,950,500	貸付株式数	9,500株 (9,500株)
サンフロンティア不動産	8,400	1,202.00	10,096,800	貸付株式数	2,800株
インテリックス	2,000	764.00	1,528,000		
ランドビジネス	4,200	584.00	2,452,800		
グランディハウス	6,100	404.00	2,464,400	貸付株式数	1,000株
東武鉄道	63,000	3,250.00	204,750,000		
相鉄ホールディングス	20,700	3,450.00	71,415,000		
東京急行	162,300	1,976.00	320,704,800		
京浜急行	81,800	1,811.00	148,139,800	貸付株式数	25,500株
小田急電鉄	95,800	2,545.00	243,811,000	貸付株式数	12,400株
京王電鉄	33,400	6,280.00	209,752,000		
京成電鉄	44,700	3,680.00	164,496,000		
富士急行	8,200	3,220.00	26,404,000	貸付株式数	3,000株 (2,200株)
新京成電鉄	1,500	2,122.00	3,183,000		
東日本旅客鉄道	106,100	10,320.00	1,094,952,000	貸付株式数	41,900株
西日本旅客鉄道	53,500	7,909.00	423,131,500		
東海旅客鉄道	53,400	23,325.00	1,245,555,000	貸付株式数	21,100株

西武ホールディングス	76,100	2,098.00	159,657,800	
鴻池運輸	9,400	1,783.00	16,760,200	
西日本鉄道	16,700	2,958.00	49,398,600	貸付株式数 3,000株
ハマキョウレックス	4,600	4,205.00	19,343,000	
サカイ引越センター	3,100	6,430.00	19,933,000	貸付株式数 1,200株 (800株)
近鉄グループHLDGS	56,600	4,730.00	267,718,000	
阪急阪神HLDGS	75,500	3,850.00	290,675,000	
南海電鉄	25,300	3,035.00	76,785,500	
京阪ホールディングス	25,400	4,740.00	120,396,000	
神戸電鉄	1,400	4,000.00	5,600,000	
名古屋鉄道	45,400	2,845.00	129,163,000	
山陽電鉄	4,300	2,363.00	10,160,900	
トランコム	1,600	6,520.00	10,432,000	貸付株式数 200株
日本通運	22,200	6,840.00	151,848,000	
ヤマトホールディングス	99,100	2,998.50	297,151,350	
山 九	15,700	5,320.00	83,524,000	
日 新	4,800	1,956.00	9,388,800	
丸 運	3,200	319.00	1,020,800	
丸全昭和運輸	4,500	3,115.00	14,017,500	
センコーグループHLDGS	31,000	884.00	27,404,000	貸付株式数 1,100株
トナミホールディングス	1,400	6,520.00	9,128,000	貸付株式数 500株
ニッコンホールディングス	21,400	2,907.00	62,209,800	
日石輸送	700	2,887.00	2,020,900	
福山通運	7,300	4,980.00	36,354,000	
セイノーホールディングス	42,300	1,685.00	71,275,500	
エスライン	1,600	1,164.00	1,862,400	
神奈川中央交通	1,400	3,905.00	5,467,000	
日立物流	12,500	3,070.00	38,375,000	
丸和運輸機関	3,000	3,355.00	10,065,000	貸付株式数 800株 (800株)
C & F ロジホールディングス	5,700	1,300.00	7,410,000	
日本郵船	47,400	1,927.00	91,339,800	
商船三井	33,600	2,669.00	89,678,400	
川崎汽船	17,400	1,631.00	28,379,400	貸付株式数 6,900株
NSユニテッド海運	3,200	3,060.00	9,792,000	
明治海運	5,900	379.00	2,236,100	貸付株式数 1,000株
飯野海運	27,500	451.00	12,402,500	

共栄タンカー	400	1,829.00	731,600	
九州旅客鉄道	47,300	3,750.00	177,375,000	
S Gホールディングス	53,400	2,779.00	148,398,600	
日本航空	103,300	4,094.00	422,910,200	
A N Aホールディングス	103,100	4,051.00	417,658,100	
パスコ	1,100	1,069.00	1,175,900	
西本W I S M E T T A C H D	1,300	5,180.00	6,734,000	
ヤマシタヘルスケアH L D G S	400	1,259.00	503,600	
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,300	3,705.00	8,521,500	貸付株式数 300株
国際紙パルプ商事	10,600	320.00	3,392,000	貸付株式数 1,000株
総合メディカルH D	5,100	2,665.00	13,591,500	
ブックオフG H D	3,000	783.00	2,349,000	
三菱倉庫	19,800	2,804.00	55,519,200	貸付株式数 6,000株
三井倉庫H O L D	6,900	2,005.00	13,834,500	
住友倉庫	21,500	1,457.00	31,325,500	
渋沢倉庫	3,100	1,662.00	5,152,200	
ヤマタネ	2,900	1,959.00	5,681,100	貸付株式数 1,200株
東陽倉庫	9,900	314.00	3,108,600	貸付株式数 1,000株
乾汽船	5,200	1,027.00	5,340,400	
日本トランスシティ	12,600	492.00	6,199,200	貸付株式数 6,000株
ケイヒン	1,000	1,430.00	1,430,000	
中央倉庫	3,300	1,080.00	3,564,000	貸付株式数 1,000株
川西倉庫	1,100	1,663.00	1,829,300	貸付株式数 400株
安田倉庫	4,600	875.00	4,025,000	
東洋埠頭	1,600	1,559.00	2,494,400	
宇徳	4,700	538.00	2,528,600	
上 組	34,800	2,549.00	88,705,200	
サンリツ	1,400	662.00	926,800	
キムラユニティー	1,500	1,116.00	1,674,000	
キューソー流通システム	1,400	2,509.00	3,512,600	貸付株式数 500株 (200株)
近鉄エクスプレス	10,600	1,913.00	20,277,800	
東海運	3,300	350.00	1,155,000	貸付株式数 1,000株
エーアイティー	3,600	1,019.00	3,668,400	貸付株式数 1,000株
内外トランスライン	1,700	1,648.00	2,801,600	貸付株式数 800株
日本コンセプト	1,500	1,144.00	1,716,000	
東京放送H D	39,000	2,126.00	82,914,000	貸付株式数 15,300株

日本テレビH L D S	53,600	1,777.00	95,247,200	
朝日放送グループHD	6,100	785.00	4,788,500	
テレビ朝日HD	16,200	2,285.00	37,017,000	貸付株式数 3,100株 (100株)
スカパーJ S A T H D	44,700	547.00	24,450,900	
テレビ東京HD	4,800	2,750.00	13,200,000	貸付株式数 2,000株 (1,500株)
日本BS放送	1,900	1,238.00	2,352,200	貸付株式数 700株
ビジョン	1,800	4,775.00	8,595,000	貸付株式数 700株
USEN-NEXT H L D G S	2,300	1,207.00	2,776,100	貸付株式数 800株 (500株)
ワイヤレスゲート	2,500	564.00	1,410,000	貸付株式数 1,300株 (1,000株)
コネクシオ	4,100	1,477.00	6,055,700	
日本通信	50,500	139.00	7,019,500	貸付株式数 22,900株 (1,000株)
クロップス	1,000	744.00	744,000	
日本電信電話	400,300	4,680.00	1,873,404,000	
K D D I	515,800	2,664.00	1,374,091,200	貸付株式数 204,000株
光通信	6,900	18,110.00	124,959,000	
N T T ドコモ	420,400	2,628.50	1,105,021,400	貸付株式数 166,200株
エムティーアイ	6,900	601.00	4,146,900	貸付株式数 2,800株
GMOインターネット	21,300	1,490.00	31,737,000	
アイドママーケティングコ ミュ	1,300	536.00	696,800	
カドカワ	17,200	1,411.00	24,269,200	貸付株式数 6,800株
学研ホールディングス	2,000	4,395.00	8,790,000	
ゼンリン	11,700	2,817.00	32,958,900	貸付株式数 3,200株
昭文社	2,700	547.00	1,476,900	
インプレスホールディング ス	4,900	165.00	808,500	
東京電力HD	476,600	689.00	328,377,400	
中部電力	182,400	1,702.00	310,444,800	貸付株式数 11,500株
関西電力	243,300	1,704.00	414,583,200	
中国電力	82,100	1,434.00	117,731,400	貸付株式数 32,600株
北陸電力	58,300	1,011.00	58,941,300	貸付株式数 400株
東北電力	139,400	1,484.00	206,869,600	
四国電力	53,400	1,365.00	72,891,000	
九州電力	122,600	1,333.00	163,425,800	貸付株式数 48,600株
北海道電力	55,600	778.00	43,256,800	

沖縄電力	11,000	2,258.00	24,838,000	貸付株式数	100株
電源開発	47,300	2,922.00	138,210,600		
エフオン	3,600	1,022.00	3,679,200		
イーレックス	10,300	693.00	7,137,900	貸付株式数	4,100株
レノバ	6,200	1,166.00	7,229,200	貸付株式数	1,000株
東京瓦斯	116,900	2,924.50	341,874,050		
大阪瓦斯	115,500	2,069.00	238,969,500		
東邦瓦斯	29,600	4,590.00	135,864,000		
北海道瓦斯	3,100	1,504.00	4,662,400		
広島ガス	11,900	361.00	4,295,900	貸付株式数	2,000株
西部瓦斯	6,700	2,498.00	16,736,600	貸付株式数	2,800株
静岡ガス	18,100	977.00	17,683,700		
メタウォーター	2,800	3,185.00	8,918,000	貸付株式数	1,300株
アイネット	3,300	1,669.00	5,507,700		
松竹	3,900	11,890.00	46,371,000	貸付株式数	1,400株
東宝	38,600	3,950.00	152,470,000		
エイチ・アイ・エス	10,100	3,825.00	38,632,500	貸付株式数	2,600株 (1,300株)
東映	2,500	13,800.00	34,500,000		
ラックランド	1,100	2,955.00	3,250,500	貸付株式数	400株
N T Tデータ	155,700	1,320.00	205,524,000		
共立メンテナンス	8,700	5,700.00	49,590,000	貸付株式数	3,400株 (1,300株)
イチネンホールディングス	5,900	1,456.00	8,590,400	貸付株式数	900株
建設技術研究所	3,900	1,468.00	5,725,200		
スペース	3,600	1,243.00	4,474,800		
長大	2,200	802.00	1,764,400		
アインホールディングス	7,900	8,750.00	69,125,000	貸付株式数	3,000株
燦ホールディングス	1,200	2,576.00	3,091,200		
ピー・シー・エー	700	2,214.00	1,549,800		
スバル興業	400	5,580.00	2,232,000		
東京テアトル	2,400	1,350.00	3,240,000		
タナベ経営	1,100	1,611.00	1,772,100		
ビジネスB太田昭和	1,000	2,068.00	2,068,000	貸付株式数	400株
ナガワ	1,700	6,350.00	10,795,000		
よみうりランド	1,200	4,225.00	5,070,000		
東京都競馬	3,700	3,405.00	12,598,500		
常磐興産	2,200	1,757.00	3,865,400		
カナモト	8,500	3,340.00	28,390,000	貸付株式数	3,100株 (3,100株)

東京ドーム	21,100	1,039.00	21,922,900	
D T S	6,500	4,090.00	26,585,000	
スクウェア・エニックス・HD	27,200	3,700.00	100,640,000	
シーイーシー	6,300	2,455.00	15,466,500	
カプコン	25,100	2,222.00	55,772,200	
西尾レントオール	5,800	4,145.00	24,041,000	貸付株式数 2,000株
アイ・エス・ピー	1,100	2,374.00	2,611,400	
アゴーラ・ホスピタリティーG	33,400	30.00	1,002,000	貸付株式数 6,500株
日本空港ビルデング	18,900	4,410.00	83,349,000	
トランス・コスモス	6,300	2,624.00	16,531,200	
乃村工藝社	13,400	3,045.00	40,803,000	
ジャステック	3,300	1,065.00	3,514,500	貸付株式数 400株
S C S K	15,400	4,505.00	69,377,000	
藤田観光	2,200	3,170.00	6,974,000	
K N T - C Tホールディングス	3,000	1,288.00	3,864,000	
日本管財	6,200	2,089.00	12,951,800	
トーカイ	5,500	2,793.00	15,361,500	貸付株式数 300株
白 洋 舎	700	3,000.00	2,100,000	貸付株式数 200株
セコム	60,500	9,606.00	581,163,000	
日本システムウエア	1,900	2,474.00	4,700,600	
セントラル警備保障	2,800	6,340.00	17,752,000	
アイネス	7,300	1,269.00	9,263,700	貸付株式数 1,000株
丹青社	10,700	1,290.00	13,803,000	貸付株式数 3,000株
メイテック	7,200	5,120.00	36,864,000	
T K C	4,900	4,080.00	19,992,000	
富士ソフト	8,700	5,140.00	44,718,000	
応用地質	6,100	1,338.00	8,161,800	貸付株式数 1,100株
船井総研ホールディング	11,800	2,095.00	24,721,000	貸付株式数 4,600株
N S D	9,500	2,392.00	22,724,000	
進学会ホールディングス	2,800	629.00	1,761,200	
丸紅建材リース	500	2,095.00	1,047,500	
オ オ バ	4,400	732.00	3,220,800	貸付株式数 1,000株
コナミホールディングス	23,900	5,080.00	121,412,000	
いであ	1,100	1,121.00	1,233,100	
学 究 社	1,900	1,649.00	3,133,100	
ベネッセホールディングス	20,800	3,370.00	70,096,000	
イオンディライト	7,000	3,995.00	27,965,000	

ナック	3,800	1,097.00	4,168,600	
福井コンピュータH L D S	1,900	1,755.00	3,334,500	
ニチイ学館	8,100	1,145.00	9,274,500	貸付株式数 100株
ダイセキ	9,600	2,628.00	25,228,800	
ステップ	2,100	1,505.00	3,160,500	貸付株式数 800株
日鉄住金物産	4,100	5,120.00	20,992,000	貸付株式数 1,000株
泉州電業	1,900	2,669.00	5,071,100	
元気寿司	1,600	5,010.00	8,016,000	
トラスコ中山	12,200	3,225.00	39,345,000	貸付株式数 4,400株
ヤマダ電機	179,000	549.00	98,271,000	貸付株式数 74,500株 (400株)
オートバックスセブン	23,300	1,736.00	40,448,800	
モリト	4,100	813.00	3,333,300	
アークランドサカモト	9,900	1,552.00	15,364,800	
ニトリホールディングス	25,400	15,205.00	386,207,000	
グルメ杵屋	4,100	1,195.00	4,899,500	
愛眼	4,700	334.00	1,569,800	貸付株式数 1,800株
ケーユーホールディングス	3,000	904.00	2,712,000	
吉野家ホールディングス	20,500	1,949.00	39,954,500	貸付株式数 8,100株
加藤産業	9,100	3,515.00	31,986,500	
北恵	900	996.00	896,400	
イノテック	4,000	1,172.00	4,688,000	貸付株式数 2,000株
イエローハット	5,500	2,983.00	16,406,500	
松屋フーズH L D G S	2,800	3,895.00	10,906,000	
J B C Cホールディングス	4,600	1,771.00	8,146,600	
J Kホールディングス	5,200	615.00	3,198,000	
サガミホールディングス	7,700	1,382.00	10,641,400	貸付株式数 700株
日伝	4,700	1,828.00	8,591,600	
関西スーパーマーケット	4,400	1,100.00	4,840,000	
ミロク情報サービス	5,800	2,450.00	14,210,000	
北沢産業	4,400	250.00	1,100,000	
杉本商事	3,100	1,800.00	5,580,000	
因幡電機産業	8,600	4,715.00	40,549,000	
王将フードサービス	4,300	7,930.00	34,099,000	
プレナス	6,600	1,985.00	13,101,000	貸付株式数 2,600株 (2,500株)
ミニストップ	4,300	2,072.00	8,909,600	
アークス	11,000	2,844.00	31,284,000	
パローホールディングス	12,700	2,928.00	37,185,600	

バイテックホールディングス	2,700	2,432.00	6,566,400	
東 テ ク	1,900	2,810.00	5,339,000	
ミスミグループ本社	73,600	2,572.00	189,299,200	貸付株式数 26,500株 (26,500株)
藤 久	500	795.00	397,500	
アルテック	4,400	275.00	1,210,000	
ベ ル ク	2,900	6,030.00	17,487,000	
大 庄	3,100	1,718.00	5,325,800	
タキヒヨー	1,700	1,967.00	3,343,900	
ファーストリテイリング	7,900	59,040.00	466,416,000	貸付株式数 100株
ソフトバンクグループ	244,600	9,526.00	2,330,059,600	
蔵王産業	900	1,415.00	1,273,500	
スズケン	26,800	6,110.00	163,748,000	
サンドラッグ	22,100	3,830.00	84,643,000	
サックスパーホールディング グ	4,900	1,124.00	5,507,600	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
ジェコス	4,000	1,154.00	4,616,000	
ヤマザワ	1,200	1,788.00	2,145,600	貸付株式数 400株
や ま や	1,000	2,540.00	2,540,000	
ルネサスイーストン	5,200	449.00	2,334,800	貸付株式数 1,000株
ベルーナ	14,400	1,279.00	18,417,600	
合計			140,729,270,900	

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

トヨタ自動車 100,000株

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「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11月30日現在	平成30年11月30日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	77,483,707
コール・ローン	328,217,271	150,687,784
国債証券	56,883,147,780	67,198,735,300
地方債証券	4,405,150,700	4,305,812,600
特殊債券	3,211,257,800	3,325,811,500
社債券	3,212,890,300	3,306,672,600
未収入金	-	202,835,000
未収利息	181,873,953	193,828,008
前払費用	5,395,389	4,802,646
流動資産合計	68,227,933,193	78,766,669,145
資産合計	68,227,933,193	78,766,669,145
負債の部		
流動負債		
未払解約金	88,741,204	276,774,272
その他未払費用	-	2,408
流動負債合計	88,741,204	276,776,680
負債合計	88,741,204	276,776,680
純資産の部		
元本等		
元本	1 48,889,824,254	56,170,487,793
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	19,249,367,735	22,319,404,672
元本等合計	68,139,191,989	78,489,892,465
純資産合計	68,139,191,989	78,489,892,465
負債純資産合計	68,227,933,193	78,766,669,145

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12月1日 至 平成30年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年11月30日現在	平成30年11月30日現在
1. 1 期首	平成28年12月1日	平成29年12月1日
期首元本額	37,053,043,176円	48,889,824,254円
期中追加設定元本額	16,475,959,702円	15,940,542,707円
期中一部解約元本額	4,639,178,624円	8,659,879,168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)	158,413,208円	129,097,081円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,115,777,521円	795,274,382円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	129,471,630円	105,597,525円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,544,820,823円	1,111,264,823円
D-I's 日本債券インデックス	761,060円	- 円
DCダイワ日本債券インデックス	5,048,119,641円	5,920,239,246円

ダイワ・バランスファンド3 5VA	14,793,606,425円	13,051,578,465円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	2,332,093,501円	2,124,813,517円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	315,508,234円	293,362,664円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	427,330,074円	405,138,528円
ダイワ・ノーロード 日本債 券ファンド	56,164,883円	62,288,888円
ダイワファンドラップ 日本 債券インデックス	13,311,941,351円	19,210,529,646円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	17,276,903円	2,623,576,618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	988,470,113円	1,545,313,319円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,245,052,313円	1,266,064,865円
ダイワ投信倶楽部日本債券イ ンデックス	6,339,363,709円	6,443,095,280円
ダイワライフスタイル25	451,259,183円	452,397,864円
ダイワライフスタイル50	481,361,512円	492,380,016円
ダイワライフスタイル75	133,032,170円	138,475,066円
計	48,889,824,254円	56,170,487,793円
2. 期末日における受益権の総数	48,889,824,254口	56,170,487,793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12月1日 至 平成30年11月30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11月30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11月30日現在	平成30年11月30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	674,418,240	389,359,740
地方債証券	36,738,700	24,799,600
特殊債券	28,244,960	18,142,200
社債券	17,765,100	16,426,800
合計	757,167,000	448,728,340

（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11月30日まで、及び平成29年12月1日から平成30年11月30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11月30日現在	平成30年11月30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11月30日現在	平成30年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3937円 (13,937円)	1.3974円 (13,974円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 8 3 2年国債	450,000,000	451,138,500	
	3 8 5 2年国債	500,000,000	501,505,000	
	3 9 1 2年国債	100,000,000	100,416,000	
	1 2 2 5年国債	630,000,000	631,581,300	
	1 2 3 5年国債	780,000,000	782,472,600	
	1 2 4 5年国債	1,340,000,000	1,345,078,600	
	1 2 5 5年国債	940,000,000	944,145,400	
	1 2 6 5年国債	890,000,000	894,467,800	
	1 2 7 5年国債	980,000,000	985,409,600	
	1 2 8 5年国債	1,000,000,000	1,006,000,000	
	1 2 9 5年国債	1,020,000,000	1,026,579,000	
	1 3 0 5年国債	880,000,000	886,186,400	
	1 3 1 5年国債	920,000,000	926,992,000	
	1 3 2 5年国債	580,000,000	584,645,800	
	1 3 3 5年国債	550,000,000	554,719,000	
	1 3 4 5年国債	510,000,000	514,666,500	
	1 3 5 5年国債	950,000,000	959,015,500	
	1 3 6 5年国債	700,000,000	706,874,000	
	1 3 7 5年国債	80,000,000	80,790,400	
	1 4 0年国債	70,000,000	99,047,200	
2 4 0年国債	186,000,000	254,459,160		

3	40年国債	74,000,000	101,710,040	
4	40年国債	107,000,000	147,717,780	
5	40年国債	125,000,000	165,962,500	
6	40年国債	105,000,000	136,632,300	
7	40年国債	121,000,000	150,350,970	
8	40年国債	230,000,000	264,718,500	
9	40年国債	220,000,000	183,893,600	
10	40年国債	375,000,000	371,298,750	
11	40年国債	160,000,000	152,478,400	
305	10年国債	500,000,000	507,490,000	
306	10年国債	255,000,000	260,087,250	
307	10年国債	400,000,000	407,460,000	
308	10年国債	200,000,000	204,458,000	
309	10年国債	90,000,000	91,728,000	
310	10年国債	130,000,000	132,670,200	
311	10年国債	150,000,000	152,539,500	
312	10年国債	700,000,000	719,173,000	
313	10年国債	200,000,000	206,600,000	
314	10年国債	260,000,000	267,384,000	
315	10年国債	221,000,000	228,505,160	
316	10年国債	250,000,000	257,850,000	
317	10年国債	214,000,000	221,357,320	
318	10年国債	200,000,000	206,314,000	
319	10年国債	100,000,000	103,746,000	
320	10年国債	230,000,000	237,912,000	
321	10年国債	175,000,000	181,510,000	
322	10年国債	130,000,000	134,405,700	
324	10年国債	410,000,000	423,427,500	
325	10年国債	310,000,000	320,877,900	
326	10年国債	30,000,000	31,000,200	
327	10年国債	450,000,000	466,834,500	
328	10年国債	350,000,000	360,874,500	
329	10年国債	500,000,000	520,900,000	
330	10年国債	612,000,000	638,854,560	
331	10年国債	365,000,000	377,497,600	
332	10年国債	310,000,000	321,085,600	
333	10年国債	700,000,000	726,068,000	
334	10年国債	800,000,000	830,992,000	
335	10年国債	780,000,000	806,816,400	

336	10年国債	275,000,000	284,691,000
337	10年国債	300,000,000	306,924,000
338	10年国債	490,000,000	504,714,700
339	10年国債	780,000,000	804,102,000
340	10年国債	770,000,000	794,170,300
341	10年国債	260,000,000	266,528,600
342	10年国債	830,000,000	839,105,100
343	10年国債	830,000,000	838,789,700
344	10年国債	640,000,000	646,246,400
345	10年国債	730,000,000	736,759,800
346	10年国債	800,000,000	806,968,000
347	10年国債	330,000,000	332,534,400
348	10年国債	600,000,000	604,212,000
349	10年国債	750,000,000	754,395,000
350	10年国債	810,000,000	813,742,200
351	10年国債	600,000,000	601,704,000
352	10年国債	210,000,000	210,304,500
1	30年国債	16,000,000	20,515,840
2	30年国債	24,000,000	29,989,680
3	30年国債	30,000,000	37,245,900
4	30年国債	36,000,000	47,523,960
5	30年国債	28,000,000	34,807,920
6	30年国債	24,000,000	30,594,720
7	30年国債	55,000,000	69,727,350
8	30年国債	27,000,000	32,539,050
9	30年国債	43,000,000	49,475,370
10	30年国債	45,000,000	49,933,800
11	30年国債	40,000,000	47,771,200
12	30年国債	60,000,000	75,195,000
13	30年国債	75,000,000	93,087,750
14	30年国債	82,000,000	106,788,600
15	30年国債	100,000,000	131,989,000
16	30年国債	100,000,000	132,283,000
17	30年国債	80,000,000	104,757,600
18	30年国債	80,000,000	103,725,600
19	30年国債	57,000,000	73,978,020
20	30年国債	60,000,000	79,957,800
21	30年国債	60,000,000	78,130,200
22	30年国債	70,000,000	93,548,700

2 3	3 0 年国債	60,000,000	80,327,400	
2 4	3 0 年国債	92,000,000	123,381,200	
2 5	3 0 年国債	150,000,000	196,317,000	
2 6	3 0 年国債	180,000,000	238,921,200	
2 7	3 0 年国債	150,000,000	202,242,000	
2 8	3 0 年国債	170,000,000	229,824,700	
2 9	3 0 年国債	200,000,000	267,488,000	
3 0	3 0 年国債	220,000,000	290,813,600	
3 1	3 0 年国債	180,000,000	235,207,800	
3 2	3 0 年国債	235,000,000	312,493,600	
3 3	3 0 年国債	311,000,000	396,070,940	
3 4	3 0 年国債	233,000,000	306,905,270	
3 5	3 0 年国債	295,000,000	377,443,650	
3 6	3 0 年国債	320,000,000	410,297,600	
3 7	3 0 年国債	300,000,000	378,846,000	
3 8	3 0 年国債	220,000,000	273,365,400	
3 9	3 0 年国債	172,000,000	217,739,960	
4 0	3 0 年国債	140,000,000	174,195,000	
4 1	3 0 年国債	170,000,000	207,775,700	
4 2	3 0 年国債	176,000,000	215,205,760	
4 3	3 0 年国債	170,000,000	207,964,400	
4 4	3 0 年国債	165,000,000	201,936,900	
4 5	3 0 年国債	200,000,000	235,506,000	
4 6	3 0 年国債	180,000,000	211,975,200	
4 7	3 0 年国債	190,000,000	228,533,900	
4 8	3 0 年国債	250,000,000	288,510,000	
4 9	3 0 年国債	93,000,000	107,315,490	
5 0	3 0 年国債	215,000,000	216,453,400	
5 1	3 0 年国債	240,000,000	211,718,400	
5 2	3 0 年国債	235,000,000	218,470,100	
5 3	3 0 年国債	185,000,000	176,321,650	
5 4	3 0 年国債	218,000,000	218,503,580	
5 5	3 0 年国債	200,000,000	200,232,000	
5 6	3 0 年国債	210,000,000	210,000,000	
5 7	3 0 年国債	250,000,000	249,705,000	
5 8	3 0 年国債	300,000,000	299,289,000	
5 9	3 0 年国債	200,000,000	194,060,000	
6 0	3 0 年国債	35,000,000	35,756,000	
4 4	2 0 年国債	85,000,000	87,912,100	

45	20年国債	148,000,000	152,879,560
46	20年国債	73,000,000	75,654,280
47	20年国債	89,000,000	92,757,580
48	20年国債	54,000,000	56,929,500
49	20年国債	64,000,000	67,297,920
50	20年国債	107,000,000	112,020,440
51	20年国債	82,000,000	86,464,900
52	20年国債	52,000,000	55,250,520
53	20年国債	66,000,000	70,490,640
54	20年国債	65,000,000	69,621,500
55	20年国債	140,000,000	149,844,800
58	20年国債	200,000,000	215,410,000
59	20年国債	45,000,000	48,330,000
60	20年国債	10,000,000	10,618,000
61	20年国債	100,000,000	104,810,000
62	20年国債	95,000,000	98,948,200
63	20年国債	130,000,000	141,341,200
64	20年国債	90,000,000	98,700,300
65	20年国債	175,000,000	192,752,000
66	20年国債	135,000,000	148,009,950
67	20年国債	55,000,000	60,837,150
68	20年国債	120,000,000	134,650,800
69	20年国債	110,000,000	122,844,700
70	20年国債	83,000,000	94,517,080
71	20年国債	125,000,000	140,952,500
72	20年国債	175,000,000	197,275,750
73	20年国債	120,000,000	135,123,600
74	20年国債	73,000,000	82,644,030
75	20年国債	80,000,000	90,972,800
76	20年国債	51,000,000	57,350,520
77	20年国債	130,000,000	147,009,200
78	20年国債	61,000,000	68,878,760
79	20年国債	50,000,000	56,786,500
80	20年国債	53,000,000	60,541,900
81	20年国債	76,000,000	86,655,200
82	20年国債	87,000,000	99,791,610
83	20年国債	93,000,000	107,138,790
85	20年国債	58,000,000	67,103,100
86	20年国債	80,000,000	93,726,400

8 7	2 0 年国債	55,000,000	64,034,850	
8 8	2 0 年国債	100,000,000	117,664,000	
8 9	2 0 年国債	78,000,000	91,188,240	
9 0	2 0 年国債	20,000,000	23,476,400	
9 1	2 0 年国債	60,000,000	70,898,400	
9 2	2 0 年国債	310,000,000	362,820,900	
9 3	2 0 年国債	100,000,000	116,634,000	
9 4	2 0 年国債	130,000,000	152,703,200	
9 5	2 0 年国債	50,000,000	59,775,500	
9 6	2 0 年国債	55,000,000	64,814,200	
9 7	2 0 年国債	40,000,000	47,657,600	
9 8	2 0 年国債	120,000,000	141,919,200	
9 9	2 0 年国債	150,000,000	178,012,500	
1 0 0	2 0 年国債	155,000,000	185,911,650	
1 0 1	2 0 年国債	75,000,000	91,345,500	
1 0 2	2 0 年国債	80,000,000	97,720,000	
1 0 3	2 0 年国債	170,000,000	206,041,700	
1 0 4	2 0 年国債	10,000,000	11,930,400	
1 0 5	2 0 年国債	126,000,000	150,741,360	
1 0 6	2 0 年国債	150,000,000	180,912,000	
1 0 7	2 0 年国債	90,000,000	108,010,800	
1 0 8	2 0 年国債	177,000,000	208,897,170	
1 0 9	2 0 年国債	55,000,000	65,085,900	
1 1 0	2 0 年国債	130,000,000	156,488,800	
1 1 1	2 0 年国債	80,000,000	97,428,800	
1 1 2	2 0 年国債	130,000,000	156,967,200	
1 1 3	2 0 年国債	150,000,000	181,560,000	
1 1 4	2 0 年国債	70,000,000	84,970,900	
1 1 5	2 0 年国債	180,000,000	220,455,000	
1 1 6	2 0 年国債	140,000,000	171,966,200	
1 1 7	2 0 年国債	215,000,000	261,702,300	
1 1 8	2 0 年国債	95,000,000	114,814,150	
1 1 9	2 0 年国債	93,000,000	110,288,700	
1 2 0	2 0 年国債	210,000,000	244,278,300	
1 2 1	2 0 年国債	170,000,000	204,011,900	
1 2 2	2 0 年国債	160,000,000	190,161,600	
1 2 3	2 0 年国債	200,000,000	245,276,000	
1 2 4	2 0 年国債	193,000,000	234,415,870	
1 2 5	2 0 年国債	85,000,000	105,523,250	

1 2 6	2 0 年国債	110,000,000	133,835,900	
1 2 7	2 0 年国債	165,000,000	198,773,850	
1 2 8	2 0 年国債	119,000,000	143,668,700	
1 2 9	2 0 年国債	230,000,000	274,866,100	
1 3 0	2 0 年国債	140,000,000	167,531,000	
1 3 1	2 0 年国債	80,000,000	94,736,800	
1 3 2	2 0 年国債	150,000,000	177,928,500	
1 3 3	2 0 年国債	250,000,000	299,715,000	
1 3 4	2 0 年国債	80,000,000	96,014,400	
1 3 5	2 0 年国債	92,000,000	109,232,520	
1 3 6	2 0 年国債	185,000,000	217,271,400	
1 3 7	2 0 年国債	70,000,000	83,243,300	
1 3 8	2 0 年国債	87,000,000	101,181,000	
1 3 9	2 0 年国債	235,000,000	276,383,500	
1 4 0	2 0 年国債	335,000,000	398,985,000	
1 4 1	2 0 年国債	220,000,000	262,220,200	
1 4 2	2 0 年国債	200,000,000	241,084,000	
1 4 3	2 0 年国債	210,000,000	247,583,700	
1 4 4	2 0 年国債	200,000,000	233,052,000	
1 4 5	2 0 年国債	380,000,000	453,826,400	
1 4 6	2 0 年国債	230,000,000	275,036,300	
1 4 7	2 0 年国債	250,000,000	295,722,500	
1 4 8	2 0 年国債	300,000,000	350,589,000	
1 4 9	2 0 年国債	252,000,000	294,507,360	
1 5 0	2 0 年国債	250,000,000	288,645,000	
1 5 1	2 0 年国債	370,000,000	415,572,900	
1 5 2	2 0 年国債	350,000,000	393,127,000	
1 5 3	2 0 年国債	380,000,000	432,736,400	
1 5 4	2 0 年国債	360,000,000	404,056,800	
1 5 5	2 0 年国債	275,000,000	299,420,000	
1 5 6	2 0 年国債	330,000,000	326,043,300	
1 5 7	2 0 年国債	400,000,000	380,948,000	
1 5 8	2 0 年国債	100,000,000	100,081,000	
1 5 9	2 0 年国債	280,000,000	284,398,800	
1 6 0	2 0 年国債	270,000,000	278,348,400	
1 6 1	2 0 年国債	320,000,000	323,779,200	
1 6 2	2 0 年国債	300,000,000	302,811,000	
1 6 3	2 0 年国債	290,000,000	292,247,500	
1 6 4	2 0 年国債	400,000,000	394,788,000	

	1 6 5	2 0 年国債	330,000,000	325,079,700	
	1 6 6	2 0 年国債	35,000,000	35,714,000	
	2 7	メキシコ国債	100,000,000	100,659,600	
国債証券 合計				67,198,735,300	
地方債証券	6 8 8	東京都公債	100,000,000	101,686,500	
	6 9 9	東京都公債	100,000,000	102,847,100	
	7 1 3	東京都公債	100,000,000	102,910,600	
	7 5 1	東京都公債	100,000,000	102,005,000	
	1 6	東京都 2 0 年	100,000,000	117,573,800	
	2 4 - 1	北海道公債	100,000,000	103,311,600	
	2 4 - 6	北海道公債	100,000,000	103,061,600	
	3 1	神奈川県 2 0 年	100,000,000	106,831,100	
	3 6 1	大阪府公債	100,000,000	103,200,700	
	4 2 0	大阪府公債	200,000,000	199,836,000	
	2 2 - 5	京都府公債	100,000,000	102,588,200	
	2 4 - 5	京都府公債	100,000,000	103,081,200	
	2 6 - 1 7	兵庫県公債	100,000,000	102,277,200	
	3	兵庫県公債 1 2 年	200,000,000	205,899,800	
	1 9	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	115,088,100	
	2 6 - 1 0	静岡県公債	100,000,000	102,710,300	
	2 1 - 5	愛知県公債	100,000,000	120,885,100	
	2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	103,119,600	
	2 9 - 5	広島県公債	100,000,000	100,413,500	
	4	埼玉県 3 0 年	100,000,000	110,197,100	
	2 9 - 1	福岡県公債	100,000,000	100,295,400	
	1 6	千葉県 2 0 年	100,000,000	115,205,900	
	9 0	共同発行地方	100,000,000	102,028,700	
	1 0 8	共同発行地方	100,000,000	103,337,200	
	1 1 7	共同発行地方	100,000,000	102,890,800	
	1 2 6	共同発行地方	100,000,000	103,827,400	
	1 3 1	共同発行地方	100,000,000	103,306,100	
	2 3 - 2	島根県公債	100,000,000	103,057,400	
	2 5 - 6	大阪市公債	200,000,000	206,709,800	
	4 7 1	名古屋市債	100,000,000	101,959,800	
	2 1 - 5	京都市公債	100,000,000	101,782,100	
	2 0 - 1	神戸市 2 0 年	100,000,000	120,317,900	
	2 4 - 1 0	神戸市公債	100,000,000	103,060,600	
2 4 - 3	横浜市公債	100,000,000	102,918,900		
2 4 - 5	札幌市公債	100,000,000	102,912,700		

	2 3 - 4 福岡市 2 0 年	100,000,000	118,610,600	
	2 4 - 4 福井県公債	100,000,000	101,971,300	
	2 2 - 1 岡山県公債	100,000,000	102,095,900	
地方債証券	合計		4,305,812,600	
特殊債券	1 9 政保政策投資 C	100,000,000	103,044,400	
	6 1 道路機構	100,000,000	101,889,600	
	8 1 道路機構	100,000,000	103,058,200	
	8 6 政保道路機構	100,000,000	118,832,100	
	1 1 0 政保道路機構	100,000,000	102,168,100	
	1 6 8 政保道路機構	100,000,000	103,225,800	
	1 7 3 政保道路機構	100,000,000	103,297,400	
	1 7 5 政保道路機構	100,000,000	103,256,700	
	1 8 6 政保道路機構	100,000,000	103,044,300	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	102,879,400	
	2 2 3 政保道路機構	100,000,000	114,840,300	
	2 3 6 政保道路機構	100,000,000	102,005,800	
	2 6 1 政保道路機構	200,000,000	205,126,000	
	2 8 4 政保道路機構	200,000,000	186,665,800	
	3 公営企業 1 5 年	100,000,000	105,595,100	
	1 3 地方公共団体	100,000,000	101,969,400	
	2 9 地方公共団体	100,000,000	102,898,400	
	3 3 地方公共団体	100,000,000	103,259,600	
	3 9 政保地方公共団	100,000,000	103,125,900	
	F 1 4 3 地方公共団体	100,000,000	110,078,900	
	1 地方公共団 1 5 年	100,000,000	110,154,700	
	4 8 地方公共団体	100,000,000	103,434,700	
	5 1 地方公共団体	100,000,000	103,756,100	
	3 1 地方公共団 2 0	100,000,000	117,488,400	
	1 4 政保地方公共 6	100,000,000	100,419,900	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	102,700,300	
	7 1 地方公共団体	100,000,000	102,351,400	
	2 5 日本政策金融	100,000,000	103,310,900	
	2 5 政保日本政策	100,000,000	103,630,600	
	1 9 利付商工債	100,000,000	98,303,300	
特殊債券	合計		3,325,811,500	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,504,400	
	1 7 シテイグループ・インク	100,000,000	103,327,000	
	9 A U S T ・ N Z 銀行	100,000,000	100,282,400	
	2 9 東日本高速道	100,000,000	100,193,500	

6 3	中日本高速道	100,000,000	103,016,600	
2 1	西日本高速道	100,000,000	103,403,600	
1 2	アサヒグループHD	100,000,000	100,394,700	
5	野村不動産HD	100,000,000	103,776,900	
1 1	セブンアンドアイ	100,000,000	101,552,200	
4	JXホールディングス	100,000,000	104,148,600	
1 7	パナソニック	100,000,000	101,133,800	
1 5	デンソー	100,000,000	99,917,100	
7	凸版印刷	100,000,000	107,302,700	
1	三菱UFJFG 劣後	100,000,000	103,423,400	
2 0	東京三菱銀行	100,000,000	104,214,800	
9	三菱UFJ信託BK劣	100,000,000	103,810,500	
1 1	三菱UFJ信託BK	100,000,000	104,310,900	
1 5	トヨタファイナンス	100,000,000	103,016,700	
7 8	トヨタファイナンス	100,000,000	99,974,600	
2	イオンFS	100,000,000	100,459,800	
1 7 5	オリックス	100,000,000	104,250,400	
4 4	野村ホールディング	100,000,000	101,318,900	
1 8	エヌティティ都市開	100,000,000	106,649,700	
7 2	東日本旅客鉄道	100,000,000	102,548,400	
1 0 7	東日本旅客鉄	100,000,000	110,940,600	
4 1	東海旅客鉄道	100,000,000	118,447,500	
5 0 9	関西電力	100,000,000	100,585,800	
3 7 2	中国電力	100,000,000	104,149,800	
2 6 0	北陸電力	100,000,000	103,386,000	
1 1	東京電力パワー	100,000,000	100,817,500	
3 0	大阪瓦斯	100,000,000	102,720,800	
4	ファーストリテイリング	100,000,000	103,693,000	
社債券 合計			3,306,672,600	
合計			78,137,032,000	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年11月30日現在	平成30年11月30日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	348,838,841	498,352,197
金銭信託	-	333,952,924
コール・ローン	591,680,576	649,460,746
株式	90,681,988,461	102,418,129,349
投資証券	2,483,442,333	2,814,132,682
派生商品評価勘定	50,894,023	45,643,154
未収入金	910,881	4,687,255
未収配当金	160,250,126	196,655,015
差入委託証拠金	683,871,590	770,259,958
流動資産合計	95,001,876,831	107,731,273,280
資産合計	95,001,876,831	107,731,273,280
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	79,836	4,415,029
未払解約金	74,468,800	33,327,900
その他未払費用	-	4,482
流動負債合計	74,548,636	37,747,411
負債合計	74,548,636	37,747,411
純資産の部		
元本等		
元本	1 39,734,106,968	43,964,024,902
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	55,193,221,227	63,729,500,967
元本等合計	94,927,328,195	107,693,525,869
純資産合計	94,927,328,195	107,693,525,869
負債純資産合計	95,001,876,831	107,731,273,280

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12月1日 至 平成30年11月30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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	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	<p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>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11月30日現在	平成30年11月30日現在
1. 1 期首	平成28年12月1日	平成29年12月1日
期首元本額	40,539,431,105円	39,734,106,968円
期中追加設定元本額	5,901,304,959円	7,457,653,079円
期中一部解約元本額	6,706,629,096円	3,227,735,145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	565,889,975円	507,485,808円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	18,626,936円	14,096,372円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	281,422,814円	197,649,153円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	32,623,332円	25,055,668円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	908,478,453円	627,330,937円

外国株式インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	812,920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)	399,976,869円	550,738,616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)	900,220,105円	1,489,095,675円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	305,036,599円	529,688,114円
D-I's 外国株式インデッ クス	992,761円	5,542,491円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	175,432円	197,868円
iFree 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	391,225,801円	723,449,418円
iFree 8資産バランス	291,084,495円	557,965,043円
iFree 年金バランス	- 円	8,203,476円
DCダイワ外国株式インデッ クス	24,052,269,212円	27,624,252,366円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	500,509,712円	569,101,264円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	709,804,567円	839,595,806円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	564,304,287円	676,868,528円
大和DC海外株式インデッ クスファンド	1,438,818,935円	1,489,592,147円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	5,379,290円	4,144,667円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	14,469,810円	13,247,986円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,513,286円	4,228,403円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	- 円	4,608,188円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	81,383円	76,173円

ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	162,594円	156,042円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	2,143,628円	1,204,032円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	8,975,878円	2,140,945円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	506,282,561円	237,257,604円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	392,714,678円	353,114,328円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,809,894,746円	3,137,819,193円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専 用）	179,797,597円	153,703,054円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	498,683,806円	631,981,535円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	44,190,165円	88,367,711円
ダイワ外国株式インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワ SMA専用）	464,730円	453,744円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,755,474,027円	2,746,321,380円
ダイワライフスタイル25	20,423,108円	19,463,084円
ダイワライフスタイル50	71,323,850円	70,173,613円
ダイワライフスタイル75	58,671,546円	58,841,550円
計	39,734,106,968円	43,964,024,902円
2. 期末日における受益権の総数	39,734,106,968口	43,964,024,902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12月1日 至 平成30年11月30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11月30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11月30日現在	平成30年11月30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)
株式	13,300,631,037	54,564,220
投資証券	212,840,757	24,568,003
合計	13,513,471,794	29,996,217

(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11月30日まで、及び平成29年12月1日から平成30年11月30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11月30日 現在				平成30年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	1,687,670,488	-	1,735,374,375	47,703,887	2,386,774,786	-	2,428,842,371	42,067,585
合計	1,687,670,488	-	1,735,374,375	47,703,887	2,386,774,786	-	2,428,842,371	42,067,585

(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11月30日 現在				平成30年11月30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	500,889,700	-	504,000,000	3,110,300	941,976,460	-	941,137,000	839,460
アメリカ・ドル	500,889,700	-	504,000,000	3,110,300	941,976,460	-	941,137,000	839,460
合計	500,889,700	-	504,000,000	3,110,300	941,976,460	-	941,137,000	839,460

(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11月30日現在	平成30年11月30日現在
1口当たり純資産額	2.3891円	2.4496円
(1万口当たり純資産額)	(23,891円)	(24,496円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	3,050	101.770	310,398.500	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,500	176.050	440,125.000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,800	61.520	295,296.000	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,600	147.520	236,032.000	
SYNCHRONY FINANCIAL	18,800	25.970	488,236.000	
ABBOTT LABORATORIES	45,666	73.260	3,345,491.160	
ARCONIC INC	11,333	21.340	241,846.220	
VERISK ANALYTICS INC	4,150	123.830	513,894.500	
LAS VEGAS SANDS CORP	10,500	54.470	571,935.000	
AMPHENOL CORP-CL A	7,800	87.010	678,678.000	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,479	105.850	897,502.150	
QORVO INC	3,400	65.290	221,986.000	
AFLAC INC	20,300	45.400	921,620.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	3,150	111.260	350,469.000	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3,900	55.910	218,049.000	
ADOBE INC	12,780	249.090	3,183,370.200	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,950	43.500	258,825.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,600	129.460	336,596.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,000	16.370	163,700.000	
GARMIN LTD	2,900	65.980	191,342.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,800	159.210	923,418.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	19,200	145.740	2,798,208.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,171	87.200	363,711.200	
WR BERKLEY CORP	2,550	78.450	200,047.500	
AUTOZONE INC	700	825.830	578,081.000	
DOLLAR TREE INC	6,321	88.430	558,966.030	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	25,700	21.900	562,830.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,950	88.840	262,078.000	
CELANESE CORP	3,550	100.550	356,952.500	
DR HORTON INC	9,416	37.350	351,687.600	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,450	46.360	113,582.000	
DENTSPLY SIRONA INC	5,900	36.990	218,241.000	
AUTODESK INC	5,750	145.550	836,912.500	
MOODY'S CORP	4,450	156.640	697,048.000	
DEVON ENERGY CORP	13,950	26.910	375,394.500	

ALBEMARLE CORP	2,800	96.420	269,976.000	
ATMOS ENERGY CORP	2,800	93.450	261,660.000	
ALLIANT ENERGY CORP	6,250	44.670	279,187.500	
CITIGROUP INC	66,073	64.900	4,288,137.700	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	11,500	145.850	1,677,275.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	13,000	76.350	992,550.000	
ALLEGHANY CORP	410	632.000	259,120.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	280.180	308,198.000	
HESS CORP	7,200	54.440	391,968.000	
DAVITA INC	3,500	65.660	229,810.000	
DANAHER CORP	16,300	107.940	1,759,422.000	
FORTIVE CORP	7,800	74.130	578,214.000	
AVNET INC	3,200	43.400	138,880.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	15,150	81.090	1,228,513.500	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,900	23.140	113,386.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,728	21.750	102,834.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	14,350	46.040	660,674.000	
BUNGE LTD	3,600	57.960	208,656.000	
TE CONNECTIVITY LTD	8,925	75.700	675,622.500	
APPLE INC	127,250	179.550	22,847,737.500	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,000	71.220	640,980.000	
BOEING CO/THE	14,310	342.560	4,902,033.600	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,915	81.480	318,994.200	
BECTON DICKINSON AND CO	7,019	250.100	1,755,451.900	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	18.120	121,404.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,850	62.080	239,008.000	
CDK GLOBAL INC	3,200	50.180	160,576.000	
NISOURCE INC	9,350	26.050	243,567.500	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,600	91.750	330,300.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	26,521	50.680	1,344,084.280	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	107,454	59.450	6,388,140.300	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	33,450	217.700	7,282,065.000	
ANSYS INC	2,250	159.400	358,650.000	
H&R BLOCK INC	5,100	28.240	144,024.000	
BB&T CORP	20,000	50.600	1,012,000.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	42,150	51.820	2,184,213.000	
JPMORGAN CHASE & CO	87,770	110.060	9,659,966.200	

T ROWE PRICE GROUP INC	6,300	97.870	616,581.000	
CIGNA CORP	6,400	222.520	1,424,128.000	
LKQ CORP	8,500	27.780	236,130.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,000	130.780	130,780.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,862	48.300	331,434.600	
CADENCE DESIGN SYS INC	7,250	44.120	319,870.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,810	127.580	486,079.800	
DOLLAR GENERAL CORP	6,950	110.890	770,685.500	
SERVICENOW INC	4,650	179.100	832,815.000	
CATERPILLAR INC	15,550	130.230	2,025,076.500	
CMS ENERGY CORP	7,200	51.310	369,432.000	
MOSAIC CO/THE	9,750	36.170	352,657.500	
DELTA AIR LINES INC	4,750	58.860	279,585.000	
CORNING INC	21,300	31.860	678,618.000	
CISCO SYSTEMS INC	122,250	47.340	5,787,315.000	
MORGAN STANLEY	34,600	44.510	1,540,046.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,400	120.250	168,350.000	
MSCI INC	2,300	157.040	361,192.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,000	222.520	222,520.000	
MIDDLEBY CORP	1,450	118.070	171,201.500	
COTY INC-CL A	11,839	8.520	100,868.280	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	5,600	48.500	271,600.000	
BROADCOM INC	10,802	235.780	2,546,895.560	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,050	117.290	123,154.500	
ACUITY BRANDS INC	1,000	129.060	129,060.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,430	80.610	195,882.300	
ARAMARK	6,450	37.840	244,068.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5,350	24.640	131,824.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,650	117.670	547,165.500	
CENTENE CORP	5,450	141.940	773,573.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,000	106.830	320,490.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,900	36.030	464,787.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,650	78.030	362,839.500	
GARTNER INC	2,350	153.150	359,902.500	
SPLUNK INC	3,800	101.630	386,194.000	
AGCO CORP	1,700	58.500	99,450.000	
DOMINION ENERGY INC	17,200	73.750	1,268,500.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,100	58.800	652,680.000	
SMITH (A.O.) CORP	3,650	46.840	170,966.000	

DEERE & CO	8,000	149.970	1,199,760.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	4,250	110.750	470,687.500	
VMWARE INC-CLASS A	1,950	161.480	314,886.000	
CHEMOURS CO/THE	4,550	28.500	129,675.000	
NASDAQ INC	3,150	90.390	284,728.500	
VAIL RESORTS INC	1,020	277.770	283,325.400	
EAST WEST BANCORP INC	3,650	52.880	193,012.000	
TARGA RESOURCES CORP	5,850	45.210	264,478.500	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,650	147.480	243,342.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,980	102.800	203,544.000	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,050	71.820	75,411.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	8,000	79.240	633,920.000	
COGNEX CORP	4,550	42.360	192,738.000	
TELEFLEX INC	1,230	271.510	333,957.300	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,300	106.240	244,352.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,150	98.690	310,873.500	
IDEX CORP	1,950	134.360	262,002.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	21,650	63.040	1,364,816.000	
ROLLINS INC	2,550	63.750	162,562.500	
AMETEK INC	6,175	73.220	452,133.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,500	65.960	428,740.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,200	34.350	109,920.000	
XPO LOGISTICS INC	3,100	76.340	236,654.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,550	93.020	795,321.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	11,400	231.000	2,633,400.000	
SCANA CORP	3,500	46.110	161,385.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,350	111.580	150,633.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	650	482.560	313,664.000	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	7,600	21.970	166,972.000	
UGI CORP	4,600	56.770	261,142.000	
CUMMINS INC	4,050	148.200	600,210.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,150	52.560	1,006,524.000	
SABRE CORP	6,850	26.040	178,374.000	
CDW CORP/DE	4,050	92.390	374,179.500	
SIGNATURE BANK	1,500	122.590	183,885.000	
COSTAR GROUP INC	970	370.430	359,317.100	

SVB FINANCIAL GROUP	1,390	243.720	338,770.800
AMERCO	220	348.670	76,707.400
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,650	135.010	222,766.500
MERCADOLIBRE INC	1,090	357.990	390,209.100
HANESBRANDS INC	9,500	15.660	148,770.000
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,950	139.130	271,303.500
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7,416	76.460	567,027.360
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,600	17.680	81,328.000
IPG PHOTONICS CORP	1,020	141.290	144,115.800
COPART INC	5,400	51.710	279,234.000
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,650	112.000	296,800.000
SEATTLE GENETICS INC	2,900	62.880	182,352.000
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,950	228.700	445,965.000
TRANSDIGM GROUP INC	1,280	367.370	470,233.600
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,000	27.150	244,350.000
KINDER MORGAN INC	50,981	16.870	860,049.470
HCA HEALTHCARE INC	7,350	144.500	1,062,075.000
CABOT OIL & GAS CORP	12,050	24.690	297,514.500
T-MOBILE US INC	9,000	68.680	618,120.000
ZILLOW GROUP INC - C	2,900	36.800	106,720.000
COCA-COLA CO/THE	105,100	48.980	5,147,798.000
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,750	48.730	280,197.500
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,550	75.870	345,208.500
EATON VANCE CORP	3,050	40.700	124,135.000
FRANKLIN RESOURCES INC	8,650	33.500	289,775.000
CSX CORP	21,400	71.770	1,535,878.000
FLUOR CORP	3,650	41.080	149,942.000
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,600	161.810	420,706.000
EXPEDIA GROUP INC	3,225	119.740	386,161.500
AUTOLIV INC	2,150	86.330	185,609.500
AMAZON.COM INC	10,740	1,673.570	17,974,141.800
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	6,650	20.870	138,785.500
FLOWSERVE CORP	3,200	47.740	152,768.000
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,450	162.800	887,260.000
EXXON MOBIL CORP	109,905	79.060	8,689,089.300
FLIR SYSTEMS INC	3,400	45.670	155,278.000
AES CORP	17,000	15.440	262,480.000

L3 TECHNOLOGIES INC	2,050	182.940	375,027.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,020	220.120	224,522.400	
EOG RESOURCES INC	15,250	105.470	1,608,417.500	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	4,450	68.110	303,089.500	
ABIOMED INC	1,080	331.990	358,549.200	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,250	90.500	384,625.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,390	71.570	600,472.300	
FORD MOTOR CO	95,623	9.370	895,987.510	
MACY'S INC	8,098	33.740	273,226.520	
DISCOVERY INC - A	3,990	31.630	126,203.700	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	24.920	121,784.040	
DISCOVERY INC-C	7,989	28.660	228,964.740	
AERCAP HOLDINGS NV	3,400	52.630	178,942.000	
FORTINET INC	3,800	73.900	280,820.000	
MARKEL CORP	360	1,116.150	401,814.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,400	21.820	96,008.000	
NEXTERA ENERGY INC	12,250	177.120	2,169,720.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	36,408	11.820	430,342.560	
US BANCORP	40,350	54.040	2,180,514.000	
UNITED RENTALS INC	2,150	115.920	249,228.000	
F5 NETWORKS INC	1,600	173.530	277,648.000	
FASTENAL CO	7,700	59.260	456,302.000	
FISERV INC	10,700	78.440	839,308.000	
GENERAL ELECTRIC CO	226,350	7.940	1,797,219.000	
NEKTAR THERAPEUTICS	4,450	39.260	174,707.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	5,600	51.560	288,736.000	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	6,050	23.070	139,573.500	
GENERAL MOTORS CO	33,400	36.760	1,227,784.000	
TRIPADVISOR INC	2,750	63.540	174,735.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,600	182.170	1,202,322.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,340	194.850	1,819,899.000	
ALPHABET INC-CL A	7,760	1,094.580	8,493,940.800	
ALPHABET INC-CL C	8,177	1,088.300	8,899,029.100	
OWENS CORNING	2,750	51.590	141,872.500	
GENERAL MILLS INC	15,650	42.210	660,586.500	
FIRSTENERGY CORP	12,568	37.150	466,901.200	
GENUINE PARTS CO	3,750	103.090	386,587.500	
IHS MARKIT LTD	10,184	52.800	537,715.200	

FIFTH THIRD BANCORP	17,600	27.540	484,704.000	
HARRIS CORP	3,050	143.130	436,546.500	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	38.420	115,260.000	
HALLIBURTON CO	23,400	31.890	746,226.000	
HOME DEPOT INC	29,850	175.660	5,243,451.000	
ASSURANT INC	1,400	97.800	136,920.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	29,400	14.500	426,300.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,190	214.850	255,671.500	
HERSHEY CO/THE	3,750	107.450	402,937.500	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,450	42.490	189,080.500	
HUMANA INC	3,600	330.290	1,189,044.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,950	82.910	742,044.500	
HELMERICH & PAYNE	2,900	61.150	177,335.000	
HENRY SCHEIN INC	4,050	89.140	361,017.000	
HP INC	43,300	22.860	989,838.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	39,400	15.120	595,728.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,800	39.890	191,472.000	
HOLLYFRONTIER CORP	4,300	61.680	265,224.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	5,450	30.380	165,571.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,100	39.620	83,202.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,350	28.380	293,733.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	16,153	51.190	826,872.070	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	23,850	121.480	2,897,298.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	10,000	45.740	457,400.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,600	43.420	156,312.000	
ZOETIS INC	12,650	92.770	1,173,540.500	
INGERSOLL-RAND PLC	6,579	103.370	680,071.230	
CHENIERE ENERGY INC	5,450	61.650	335,992.500	
ALLEGION PLC	2,450	91.750	224,787.500	
LEGGETT & PLATT INC	3,500	38.780	135,730.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	13,673	24.360	333,074.280	
WASTE CONNECTIONS INC	6,857	78.300	536,903.100	
JUNIPER NETWORKS INC	8,900	28.590	254,451.000	
JM SMUCKER CO/THE	2,920	103.440	302,044.800	

JOHNSON & JOHNSON	69,600	145.850	10,151,160.000	
ABBVIE INC	39,429	89.910	3,545,061.390	
HOLOGIC INC	7,100	44.410	315,311.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	8,950	114.950	1,028,802.500	
KROGER CO	21,850	30.360	663,366.000	
KLA-TENCOR CORP	4,100	96.690	396,429.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	6,670	302.420	2,017,141.400	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,320	191.680	444,697.600	
L BRANDS INC	5,900	33.590	198,181.000	
LOWE'S COS INC	21,200	93.200	1,975,840.000	
ELI LILLY & CO	25,250	117.000	2,954,250.000	
LAM RESEARCH CORP	4,230	152.750	646,132.500	
JONES LANG LASALLE INC	1,250	141.190	176,487.500	
LOEWS CORP	7,250	47.980	347,855.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,799	62.490	362,379.510	
MCDONALD'S CORP	20,350	189.260	3,851,441.000	
3M CO	15,350	204.560	3,139,996.000	
FACEBOOK INC-CLASS A	62,450	138.680	8,660,566.000	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	5,104	106.000	541,024.000	
MANPOWERGROUP INC	1,600	80.150	128,240.000	
S&P GLOBAL INC	6,500	180.350	1,172,275.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,600	196.810	314,896.000	
CONCHO RESOURCES INC	5,250	131.500	690,375.000	
FIRST DATA CORP- CLASS A	13,450	18.970	255,146.500	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,300	26.000	137,800.000	
PHILLIPS 66	11,600	92.680	1,075,088.000	
TECHNIPFMC PLC	11,150	23.690	264,143.500	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	13,400	27.320	366,088.000	
MATTEL INC	8,700	13.760	119,712.000	
DXC TECHNOLOGY CO	7,338	62.310	457,230.780	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,200	149.050	476,960.000	
MYLAN NV	13,750	34.040	468,050.000	
METLIFE INC	22,700	44.390	1,007,653.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	15,700	16.070	252,299.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,390	236.310	328,470.900	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,200	43.110	181,062.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,278	132.580	567,177.240	

METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	640	630.920	403,788.800	
BAKER HUGHES A GE CO	13,273	23.110	306,739.030	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,230	171.770	554,817.100	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,940	40.040	117,717.600	
MERCK & CO. INC.	69,621	77.910	5,424,172.110	
DOWDUPONT INC	59,855	57.240	3,426,100.200	
MASCO CORP	7,900	31.280	247,112.000	
M & T BANK CORP	3,519	168.690	593,620.110	
MARSH & MCLENNAN COS	13,250	87.170	1,155,002.500	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,722	121.840	940,848.480	
WORKDAY INC-CLASS A	3,750	145.300	544,875.000	
SQUARE INC - A	7,750	69.900	541,725.000	
TRANSUNION	4,700	63.830	300,001.000	
VISTRA ENERGY CORP	8,700	23.200	201,840.000	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,850	43.800	168,630.000	
WORLDPAY INC-CLASS A	7,950	85.580	680,361.000	
NETAPP INC	6,850	67.400	461,690.000	
NIKE INC -CL B	33,200	74.340	2,468,088.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,400	168.440	1,246,456.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,000	74.420	446,520.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,450	76.270	263,131.500	
ALLY FINANCIAL INC	11,450	26.480	303,196.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,300	260.670	1,120,881.000	
APTIV PLC	6,850	71.500	489,775.000	
NEWMONT MINING CORP	14,000	32.340	452,760.000	
MCKESSON CORP	5,300	127.010	673,153.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,100	55.340	392,914.000	
XYLEM INC	4,800	71.300	342,240.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	40,450	86.960	3,517,532.000	
NUCOR CORP	8,200	59.980	491,836.000	
WESTERN UNION CO	11,746	18.680	219,415.280	
GODADDY INC - CLASS A	4,500	65.860	296,370.000	
NEWELL BRANDS INC	12,292	23.800	292,549.600	
EVERGY INC	6,950	58.820	408,799.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	19,700	70.910	1,396,927.000	
LIBERTY BROADBAND-C	2,850	84.630	241,195.500	
LINDE PLC	14,796	159.310	2,357,150.760	

PAYCHEX INC	8,350	69.920	583,832.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,120	354.850	752,282.000	
ALTRIA GROUP INC	49,100	55.940	2,746,654.000	
P G & E CORP	13,250	26.760	354,570.000	
PFIZER INC	152,013	45.510	6,918,111.630	
ALKERMES PLC	4,000	35.750	143,000.000	
XCEL ENERGY INC	13,150	51.530	677,619.500	
STRYKER CORP	8,700	170.910	1,486,917.000	
PARKER HANNIFIN CORP	3,500	168.900	591,150.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,500	149.170	671,265.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,550	96.390	149,404.500	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	65,067	92.820	6,039,518.940	
EXELON CORP	25,472	45.670	1,163,306.240	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,750	123.340	709,205.000	
NVR INC	90	2,473.770	222,639.300	
CONOCOPHILLIPS	30,300	66.870	2,026,161.000	
PEPSICO INC	36,600	118.270	4,328,682.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,000	92.910	1,022,010.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,850	92.480	448,528.000	
ACCENTURE PLC-CL A	16,700	161.070	2,689,869.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,200	55.310	121,682.000	
PENTAIR PLC	4,205	42.470	178,586.350	
QUALCOMM INC	36,950	58.110	2,147,164.500	
INVESCO LTD	10,950	20.250	221,737.500	
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,900	177.670	337,573.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,200	49.680	357,696.000	
RAYTHEON COMPANY	7,520	173.580	1,305,321.600	
RED HAT INC	4,550	177.890	809,399.500	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,090	359.570	751,501.300	
REPUBLIC SERVICES INC	6,000	76.790	460,740.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,250	1,865.150	2,331,437.500	
ROSS STORES INC	9,950	85.940	855,103.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,400	96.500	231,600.000	
RESMED INC	3,700	110.500	408,850.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,550	87.940	312,187.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,050	61.820	188,551.000	
RALPH LAUREN CORP	1,450	111.290	161,370.500	
REGIONS FINANCIAL CORP	28,835	16.210	467,415.350	

CHEVRON CORP	49,718	118.850	5,908,984.300	
EDISON INTERNATIONAL	8,300	54.720	454,176.000	
TESLA INC	3,300	341.170	1,125,861.000	
SYMANTEC CORP	16,150	22.580	364,667.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,922	127.460	499,898.120	
SYNOPSYS INC	3,750	89.520	335,700.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,505	330.330	1,488,136.650	
CBRE GROUP INC - A	8,700	43.140	375,318.000	
TWITTER INC	17,900	31.300	560,270.000	
SOUTHERN CO/THE	26,650	46.540	1,240,291.000	
SYSCO CORP	12,700	67.540	857,758.000	
TRAVELERS COS INC/THE	7,123	130.630	930,477.490	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,550	53.480	189,854.000	
STERICYCLE INC	2,150	48.210	103,651.500	
STEEL DYNAMICS INC	6,200	34.980	216,876.000	
SCHLUMBERGER LTD	35,902	45.900	1,647,901.800	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,600	45.810	210,726.000	
AT&T INC	188,791	30.570	5,771,340.870	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,650	53.230	194,289.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	11,000	18.500	203,500.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,190	419.760	919,274.400	
SEMPRA ENERGY	6,450	112.670	726,721.500	
TIFFANY & CO	2,950	89.770	264,821.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,050	42.650	300,682.500	
TEXAS INSTRUMENTS INC	25,300	97.430	2,464,979.000	
SALESFORCE.COM INC	18,600	139.720	2,598,792.000	
WESTROCK CO	6,630	46.350	307,300.500	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	23,884	34.270	818,504.680	
UNION PACIFIC CORP	20,150	150.480	3,032,172.000	
MARATHON OIL CORP	22,600	16.550	374,030.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	17,838	64.900	1,157,686.200	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	21,437	121.200	2,598,164.400	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	17,900	113.260	2,027,354.000	
UNUM GROUP	5,900	36.390	214,701.000	
SPRINT CORP	20,765	6.320	131,234.800	
ANTERO RESOURCES CORP	5,100	13.480	68,748.000	

IQVIA HOLDINGS INC	4,194	124.950	524,040.300	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	44.670	194,314.500	
AMEREN CORPORATION	6,250	67.820	423,875.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	24,976	282.550	7,056,968.800	
VERISIGN INC	2,900	156.660	454,314.000	
VALERO ENERGY CORP	11,292	79.470	897,375.240	
ULTA BEAUTY INC	1,510	300.370	453,558.700	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	6,838	33.180	226,884.840	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,300	137.860	317,078.000	
ANTHEM INC	6,740	292.170	1,969,225.800	
WALT DISNEY CO/THE	38,700	116.610	4,512,807.000	
WELLS FARGO & CO	119,622	54.040	6,464,372.880	
WASTE MANAGEMENT INC	11,050	92.720	1,024,556.000	
WILLIAMS COS INC	31,900	25.560	815,364.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,200	94.670	302,944.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	126.400	214,880.000	
WALMART INC	38,200	97.290	3,716,478.000	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	81.240	235,596.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,300	114.960	609,288.000	
WYNN RESORTS LTD	2,600	108.120	281,112.000	
XEROX CORP	5,911	26.880	158,887.680	
WABTEC CORP	2,250	92.660	208,485.000	
TJX COMPANIES INC	32,800	47.490	1,557,672.000	
WATERS CORP	2,050	203.490	417,154.500	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,800	95.070	171,126.000	
ALLERGAN PLC	8,857	155.240	1,374,960.680	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	22,000	84.850	1,866,700.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,523	158.490	558,360.270	
WESTERN DIGITAL CORP	7,800	45.520	355,056.000	
WEC ENERGY GROUP INC	8,280	71.000	587,880.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	13,400	54.520	730,568.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	46,050	139.100	6,405,555.000	
PPL CORP	18,600	30.670	570,462.000	
PULTEGROUP INC	6,900	26.730	184,437.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,450	108.470	699,631.500	
NORTHERN TRUST CORP	5,650	97.000	548,050.000	

NVIDIA CORP	15,000	157.360	2,360,400.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,050	180.280	369,574.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12,243	133.650	1,636,276.950	
QURATE RETAIL INC	11,450	22.440	256,938.000	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4,700	39.280	184,616.000	
TYSON FOODS INC-CL A	7,900	57.720	455,988.000	
NETFLIX INC	11,340	288.750	3,274,425.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10,500	248.570	2,609,985.000	
TORCHMARK CORP	2,925	87.320	255,411.000	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,250	96.190	408,807.500	
TEXTRON INC	6,850	55.960	383,326.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	27,500	49.530	1,362,075.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	11,600	49.300	571,880.000	
NEWS CORP - CLASS A	10,237	13.210	135,230.770	
OGE ENERGY CORP	5,300	38.890	206,117.000	
OMNICOM GROUP	6,050	77.180	466,939.000	
ORACLE CORP	79,283	47.900	3,797,655.700	
MASTERCARD INC - A	24,050	196.660	4,729,673.000	
ONEOK INC	10,750	61.340	659,405.000	
CENTURYLINK INC	25,352	18.620	472,054.240	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,720	293.870	799,326.400	
YUM! BRANDS INC	8,300	91.860	762,438.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,050	111.910	341,325.500	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,330	196.700	261,611.000	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,050	64.310	324,765.500	
NOBLE ENERGY INC	12,400	24.270	300,948.000	
BANK OF AMERICA CORP	249,101	28.040	6,984,792.040	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,600	96.750	445,050.000	
NORDSTROM INC	3,000	52.300	156,900.000	
AMERICAN EXPRESS CO	19,050	111.310	2,120,455.500	
ANALOG DEVICES INC	9,549	89.520	854,826.480	
ADVANCED MICRO DEVICES	23,800	21.430	510,034.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	7,200	53.120	382,464.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	23,022	43.440	1,000,075.680	

ANADARKO PETROLEUM CORP	13,500	53.700	724,950.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,800	71.230	341,904.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,450	111.630	496,753.500	
NEWFIELD EXPLORATION CO	5,100	17.550	89,505.000	
AVERY DENNISON CORP	2,300	95.330	219,259.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	15,350	70.300	1,079,105.000	
EMERSON ELECTRIC CO	16,550	67.330	1,114,311.500	
AON PLC	6,300	163.680	1,031,184.000	
AMGEN INC	17,250	202.370	3,490,882.500	
TAPESTRY INC	7,650	38.010	290,776.500	
EATON CORP PLC	11,536	76.010	876,851.360	
CELGENE CORP	19,200	70.160	1,347,072.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,330	196.210	849,589.300	
APPLIED MATERIALS INC	26,300	36.540	961,002.000	
CIT GROUP INC	3,300	46.290	152,757.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,500	83.600	209,000.000	
CME GROUP INC	9,350	188.910	1,766,308.500	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	9,894	32.730	323,830.620	
ECOLAB INC	6,850	158.390	1,084,971.500	
EQUIFAX INC	3,150	102.800	323,820.000	
GAP INC/THE	5,950	26.650	158,567.500	
GILEAD SCIENCES INC	33,600	69.690	2,341,584.000	
HORMEL FOODS CORP	7,750	45.230	350,532.500	
STATE STREET CORP	9,743	72.370	705,100.910	
SUNTRUST BANKS INC	12,048	62.490	752,879.520	
SCHWAB (CHARLES) CORP	31,800	44.160	1,404,288.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,100	68.020	891,062.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,850	39.630	192,205.500	
CROWN HOLDINGS INC	3,450	50.930	175,708.500	
CARDINAL HEALTH INC	8,300	55.020	456,666.000	
FEDEX CORP	6,600	227.500	1,501,500.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	12,654	88.870	1,124,560.980	
FMC CORP	3,600	83.050	298,980.000	
FLEX LTD	12,900	8.550	110,295.000	
CERNER CORP	7,750	57.350	444,462.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,624	141.580	371,505.920	
CITRIX SYSTEMS INC	3,700	110.460	408,702.000	
INTEL CORP	120,500	47.700	5,747,850.000	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	10,200	24.350	248,370.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,100	44.280	402,948.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	7,950	135.900	1,080,405.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	41,700	6.320	263,544.000	
ILLUMINA INC	3,870	337.960	1,307,905.200	
SEALED AIR CORP	4,400	36.410	160,204.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,970	520.970	1,547,280.900	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,450	110.380	380,811.000	
SNAP-ON INC	1,550	164.000	254,200.000	
CARMAX INC	4,600	66.090	304,014.000	
COMERICA INC	4,500	78.990	355,455.000	
INGREDION INC	1,900	103.810	197,239.000	
DUKE ENERGY CORP	18,378	87.600	1,609,912.800	
TARGET CORP	13,250	71.170	943,002.500	
DOVER CORP	3,900	84.040	327,756.000	
VW GRAINGER INC	1,300	311.190	404,547.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,400	65.100	221,340.000	
CINTAS CORP	2,350	188.040	441,894.000	
CONAGRA BRANDS INC	12,700	32.270	409,829.000	
CLOROX COMPANY	3,300	166.050	547,965.000	
ENTERGY CORP	4,750	85.870	407,882.500	
MICROSOFT CORP	189,200	110.190	20,847,948.000	
INCYTE CORP	4,600	64.790	298,034.000	
CVS HEALTH CORP	33,569	80.000	2,685,520.000	
MEDTRONIC PLC	34,988	96.600	3,379,840.800	
MICRON TECHNOLOGY INC	30,550	37.910	1,158,150.500	
BLACKROCK INC	3,130	422.940	1,323,802.200	
CENTERPOINT ENERGY INC	12,900	27.740	357,846.000	
HASBRO INC	3,100	96.850	300,235.000	
KELLOGG CO	6,850	63.250	433,262.500	
KEYCORP	28,200	18.140	511,548.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,750	101.180	278,245.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	38,461	44.530	1,712,668.330	
KOHL'S CORP	4,450	67.100	298,595.000	
COOPER COS INC/THE	1,300	277.420	360,646.000	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	12,000	10.560	126,720.000	

APACHE CORP	9,860	35.540	350,424.400
CHUBB LTD	12,049	134.210	1,617,096.290
ARROW ELECTRONICS INC	2,150	76.470	164,410.500
ALLSTATE CORP	9,200	88.480	814,016.000
EBAY INC	24,900	29.520	735,048.000
PAYPAL HOLDINGS INC	29,300	84.260	2,468,818.000
EASTMAN CHEMICAL CO	3,750	79.040	296,400.000
XILINX INC	6,550	91.200	597,360.000
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	14,710	101.220	1,488,946.200
DISH NETWORK CORP-A	5,750	32.960	189,520.000
ZIONS BANCORP NA	5,200	48.210	250,692.000
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,750	141.500	813,625.000
TOLL BROTHERS INC	3,800	33.610	127,718.000
TRIMBLE INC	6,400	37.400	239,360.000
LENNAR CORP-A	7,600	43.040	327,104.000
LEAR CORP	1,650	134.870	222,535.500
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,000	51.460	360,220.000
PROGRESSIVE CORP	15,400	65.190	1,003,926.000
PACCAR INC	9,137	61.310	560,189.470
PVH CORP	2,000	109.770	219,540.000
BIOGEN INC	5,460	326.610	1,783,290.600
IDEXX LABORATORIES INC	2,220	201.120	446,486.400
STARBUCKS CORP	35,450	66.880	2,370,896.000
PERRIGO CO PLC	3,400	64.110	217,974.000
EVERSOURCE ENERGY	8,130	67.070	545,279.100
INTUIT INC	6,300	209.190	1,317,897.000
BORGWARNER INC	5,600	39.370	220,472.000
BEST BUY CO INC	6,500	64.070	416,455.000
BALL CORP	8,734	49.570	432,944.380
BOSTON SCIENTIFIC CORP	36,047	37.040	1,335,180.880
ELECTRONIC ARTS INC	7,850	86.390	678,161.500
VULCAN MATERIALS CO	3,450	106.920	368,874.000
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,600	179.450	1,184,370.000
VF CORP	8,700	79.460	691,302.000
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	8,871	55.350	491,009.850
VIACOM INC-CLASS B	9,271	32.030	296,950.130
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,570	127.380	199,986.600
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,400	121.190	290,856.000
CARNIVAL CORP	11,200	60.730	680,176.000

	COMCAST CORP-CLASS A	118,890	39.420	4,686,643.800	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,100	36.990	225,639.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,900	64.900	382,910.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	8.850	79,650.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	31,300	6.380	199,694.000	
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 613,411,193.160 (69,603,768,088)	
イギリス・ポ ンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	MERLIN ENTERTAINMENT	19,300	3.450	66,585.000	
	TUI AG-DI	11,897	11.960	142,288.120	
	BP PLC	530,000	5.221	2,767,130.000	
	UNILEVER PLC	32,310	42.545	1,374,628.950	
	BARCLAYS PLC	450,000	1.672	752,580.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	44,000	8.476	372,944.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	42,100	3.027	127,436.700	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,480	64.500	159,960.000	
	PRUDENTIAL PLC	69,000	15.485	1,068,465.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	126,791	2.214	280,715.270	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,964	30.090	149,366.760	
	BAE SYSTEMS PLC	85,600	4.903	419,696.800	
	AVIVA PLC	107,566	4.114	442,526.520	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	130,902	15.976	2,091,290.350	
	INFORMA PLC	32,000	7.096	227,072.000	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	11,500	15.730	180,895.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	126,300	1.844	232,897.200	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	9,300	3.654	33,982.200	
	AUTO TRADER GROUP PLC	25,300	4.373	110,636.900	
	DCC PLC	2,600	59.350	154,310.000	
	GVC HOLDINGS PLC	14,000	7.515	105,210.000	
	CONVATEC GROUP PLC	33,000	1.532	50,572.500	
ROYAL MAIL PLC	22,300	3.237	72,185.100		
NMC HEALTH PLC	2,700	35.420	95,634.000		
RELX PLC	52,846	16.550	874,601.300		
DIAGEO PLC	65,300	28.290	1,847,337.000		
RIO TINTO PLC	31,450	36.190	1,138,175.500		
STANDARD CHARTERED PLC	81,300	6.153	500,238.900		

TESCO PLC	254,800	2.000	509,600.000
FRESNILLO PLC	5,600	7.772	43,523.200
SMITH & NEPHEW PLC	23,550	14.225	334,998.750
GLENCORE PLC	306,625	2.933	899,331.120
WOOD GROUP (JOHN) PLC	18,000	6.466	116,388.000
HARGREAVES LANSDOWN PLC	7,400	19.450	143,930.000
SMITHS GROUP PLC	10,233	14.175	145,052.770
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	5.814	35,465.400
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	36,883	3.269	120,570.520
PEARSON PLC	20,163	9.610	193,766.430
SAINSBURY (J) PLC	45,225	3.126	141,373.350
NEXT PLC	3,550	50.600	179,630.000
TAYLOR WIMPEY PLC	84,200	1.385	116,659.100
WHITBREAD PLC	4,961	46.660	231,480.260
BUNZL PLC	8,855	24.520	217,124.600
VODAFONE GROUP PLC	702,183	1.677	1,177,982.200
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,443	49.300	169,739.900
KINGFISHER PLC	55,411	2.576	142,738.730
WPP PLC	33,100	8.680	287,308.000
UNITED UTILITIES GROUP PLC	17,127	7.790	133,419.330
SEVERN TRENT PLC	6,333	18.770	118,870.410
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	17,850	66.220	1,182,027.000
ST JAMES'S PLACE PLC	13,600	10.335	140,556.000
SCHRODERS PLC	3,050	25.900	78,995.000
SSE PLC	26,400	10.990	290,136.000
WEIR GROUP PLC/THE	6,150	14.655	90,128.250
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	25,900	4.727	122,429.300
ASTRAZENECA PLC	33,400	61.540	2,055,436.000
FERGUSON PLC	6,237	50.520	315,093.240
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	155,100	2.474	383,717.400
3I GROUP PLC	25,391	8.582	217,905.560
ASHTED GROUP PLC	12,700	17.955	228,028.500
SAGE GROUP PLC/THE	27,614	6.060	167,340.840
NATIONAL GRID PLC	90,034	8.340	750,883.560
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,919,965	0.561	1,077,868.350
RSA INSURANCE GROUP PLC	26,260	5.398	141,751.480
IMPERIAL BRANDS PLC	25,400	24.180	614,172.000
CENTRICA PLC	152,660	1.361	207,846.590
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,200	33.060	105,792.000

BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	60,510	27.810	1,682,783.100	
BHP GROUP PLC	56,577	15.310	866,193.870	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	9,100	24.470	222,677.000	
HSBC HOLDINGS PLC	530,250	6.692	3,548,433.000	
SHIRE PLC	24,324	45.050	1,095,796.200	
ANGLO AMERICAN PLC	32,883	16.110	529,745.130	
MONDI PLC	9,350	17.340	162,129.000	
WM MORRISON SUPERMARKETS	59,300	2.435	144,395.500	
CARNIVAL PLC	4,861	46.280	224,967.080	
EASYJET PLC	4,000	11.435	45,740.000	
COMPASS GROUP PLC	42,239	16.705	705,602.490	
PERSIMMON PLC	8,500	19.655	167,067.500	
BT GROUP PLC	222,400	2.619	582,576.800	
COCA-COLA HBC AG-DI	5,200	23.800	123,760.000	
BURBERRY GROUP PLC	11,339	18.285	207,333.610	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,636	43.190	200,228.840	
TRAVIS PERKINS PLC	6,900	10.980	75,762.000	
INTERTEK GROUP PLC	4,400	48.040	211,376.000	
ITV PLC	93,100	1.504	140,022.400	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	8,349	40.830	340,889.670	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	121,700	23.720	2,886,724.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	99,568	24.145	2,404,069.360	
MEGGITT PLC	19,500	5.168	100,776.000	
G4S PLC	37,800	1.964	74,258.100	
ADMIRAL GROUP PLC	4,950	21.060	104,247.000	
INVESTEC PLC	18,300	4.893	89,541.900	
ANTOFAGASTA PLC	9,800	8.364	81,967.200	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	58,762	2.705	158,980.590	
EXPERIAN PLC	24,054	18.970	456,304.380	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 47,102,767.930 (6,830,372,378)	
イスラエル・ シュケル	株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
AZRIELI GROUP LTD	1,000	186.700	186,700.000	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,300	4.280	206,724.000	

	ISRAEL CHEMICALS LTD	17,600	21.740	382,624.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	455.000	273,000.000	
	BANK HAPOALIM BM	26,600	25.500	678,300.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	41,000	24.420	1,001,220.000	
	NICE LTD	1,650	428.000	706,200.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,000	67.550	202,650.000	
	イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 3,637,418.000 (111,304,991)	
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	2.200	100,100.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	72,800	2.480	180,544.000	
	BHP BILLITON LIMITED	84,750	30.980	2,625,555.000	
	SOUTH32 LTD	134,100	3.140	421,074.000	
	ALUMINA LTD	62,300	2.310	143,913.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	24,500	31.170	763,665.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	42,500	4.030	171,275.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	13,300	10.820	143,906.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	71,250	24.910	1,774,837.500	
	WESTPAC BANKING CORP	90,248	26.420	2,384,352.160	
	SANTOS LTD	45,200	5.640	254,928.000	
	AUSNET SERVICES	50,000	1.585	79,250.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	77,000	27.150	2,090,550.000	
	RIO TINTO LTD	10,950	73.250	802,087.500	
	ORIGIN ENERGY LTD	46,200	6.590	304,458.000	
	AMCOR LIMITED	31,400	13.430	421,702.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	54,300	4.250	230,775.000	
	COLES GROUP LTD	29,745	12.390	368,540.550	
	OIL SEARCH LTD	35,300	7.320	258,396.000	
	SEEK LTD	8,300	18.760	155,708.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	19,100	14.850	283,635.000	
	NEWCREST MINING LTD	19,750	20.780	410,405.000	
	INCITEC PIVOT LTD	42,300	3.810	161,163.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	46,200	72.430	3,346,266.000	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	7,150	27.490	196,553.500	
	ORICA LTD	10,100	17.720	178,972.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	36,050	11.480	413,854.000	

	CIMIC GROUP LTD	2,400	42.940	103,056.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	35,100	29.830	1,047,033.000	
	COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	10.100	138,370.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	48,400	4.460	215,864.000	
	CROWN RESORTS LTD	9,600	11.800	113,280.000	
	TELSTRA CORP LTD	110,500	2.960	327,080.000	
	AMP LTD	75,000	2.440	183,000.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	12,050	16.450	198,222.500	
	MACQUARIE GROUP LTD	8,584	116.810	1,002,697.040	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	15,250	25.440	387,960.000	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	10,800	10.120	109,296.000	
	CSL LTD	12,050	180.800	2,178,640.000	
	WESFARMERS LTD	29,745	31.510	937,264.950	
	COCHLEAR LTD	1,500	172.700	259,050.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	14,400	11.160	160,704.000	
	SUNCORP GROUP LTD	34,300	13.550	464,765.000	
	BORAL LTD	30,500	5.260	160,430.000	
	ASX LTD	5,000	61.520	307,600.000	
	COMPUTERSHARE LTD	12,250	18.450	226,012.500	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	3.120	43,680.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	59,536	7.430	442,352.480	
	SONIC HEALTHCARE LTD	10,400	23.280	242,112.000	
	CHALLENGER LTD	13,900	9.840	136,776.000	
	AGL ENERGY LTD	17,400	18.690	325,206.000	
	BRAMBLES LTD	41,500	10.480	434,920.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	48.280	67,592.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,850	55.560	213,906.000	
	TPG TELECOM LTD	8,700	7.580	65,946.000	
	REA GROUP LTD	1,350	76.450	103,207.500	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,650	46.490	76,708.500	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 29,339,196.680 (2,437,500,460)	
カナダ・ドル	株		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,600	40.560	308,256.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	500	938.000	469,000.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,096	17.720	90,301.120	

RESTAURANT BRANDS INTERN	6,387	78.090	498,760.830	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	12,000	20.880	250,560.000	
INTACT FINANCIAL CORP	3,850	103.540	398,629.000	
BCE INC	4,130	57.120	235,905.600	
FRANCO-NEVADA CORP	5,100	90.640	462,264.000	
SUNCOR ENERGY INC	42,930	43.550	1,869,601.500	
METRO INC	6,200	45.800	283,960.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	9,000	60.460	544,140.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	31,800	72.800	2,315,040.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,850	112.460	1,332,651.000	
TORONTO-DOMINION BANK	48,300	73.480	3,549,084.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	7,600	30.640	232,864.000	
ROYAL BANK OF CANADA	38,350	97.820	3,751,397.000	
TOURMALINE OIL CORP	6,600	18.300	120,780.000	
VERMILION ENERGY INC	3,700	33.710	124,727.000	
TRANSCANADA CORP	23,850	54.400	1,297,440.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	13,229	44.320	586,309.280	
BOMBARDIER INC-B	53,000	2.170	115,010.000	
BARRICK GOLD CORP	30,400	17.340	527,136.000	
CAE INC	7,200	26.590	191,448.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,812	66.420	452,453.040	
EMPIRE CO LTD 'A'	4,600	25.320	116,472.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	70.090	112,144.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,850	53.130	204,550.500	
LINAMAR CORP	1,300	48.000	62,400.000	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	6,400	10.190	65,216.000	
HYDRO ONE LTD	8,400	19.660	165,144.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	61.330	334,861.800	
WSP GLOBAL INC	2,700	64.490	174,123.000	
EMERA INC	1,300	44.800	58,240.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,300	31.350	103,455.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,500	70.340	668,230.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,900	46.400	273,760.000	
KINROSS GOLD CORP	34,100	3.620	123,442.000	
BANK OF MONTREAL	17,100	99.360	1,699,056.000	
POWER CORP OF CANADA	9,400	26.620	250,228.000	
METHANEX CORP	2,200	74.110	163,042.000	

SHOPIFY INC - CLASS A	2,300	197.860	455,078.000	
NUTRIEN LTD	16,519	68.160	1,125,935.040	
AURORA CANNABIS INC	17,500	7.510	131,425.000	
CANOPY GROWTH CORP	5,500	44.200	243,100.000	
CAMECO CORP	10,600	15.850	168,010.000	
TELUS CORP	5,400	47.560	256,824.000	
POWER FINANCIAL CORP	6,200	28.120	174,344.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	14,000	26.630	372,820.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,600	151.440	242,304.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	24,800	2.420	60,016.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	32,800	33.450	1,097,160.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	700	614.180	429,926.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,700	65.760	572,112.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,037	97.250	198,098.250	
BLACKBERRY LTD	13,500	11.700	157,950.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	15,850	48.580	769,993.000	
ENBRIDGE INC	48,800	43.950	2,144,760.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	22,050	58.810	1,296,760.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	52,900	21.770	1,151,633.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	8,700	31.560	274,572.000	
GOLDCORP INC	23,359	12.510	292,221.090	
ENCANA CORP	25,800	9.250	238,650.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,800	279.440	1,061,872.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,900	48.290	140,041.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,600	42.900	240,240.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	19,250	112.870	2,172,747.500	
CGI GROUP INC - CLASS A	6,900	84.320	581,808.000	
HUSKY ENERGY INC	9,358	16.010	149,821.580	
ONEX CORPORATION	2,200	81.930	180,246.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	11,600	24.960	289,536.000	
FINNING INTERNATIONAL INC	4,400	27.080	119,152.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	48.850	219,825.000	
IGM FINANCIAL INC	1,900	33.920	64,448.000	
OPEN TEXT CORP	7,000	45.150	316,050.000	
CI FINANCIAL CORP	7,000	19.900	139,300.000	

	SAPUTO INC	6,300	40.850	257,355.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,700	12.140	214,878.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	11,600	69.840	810,144.000	
	FORTIS INC	11,000	46.050	506,550.000	
	LUNDIN MINING CORP	16,100	5.700	91,770.000	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	13,300	4.030	53,599.000	
	CENOVUS ENERGY INC	27,200	9.750	265,200.000	
	DOLLARAMA INC	8,300	35.840	297,472.000	
	ATCO LTD -CLASS I	1,700	40.380	68,646.000	
	ALTAGAS LTD	6,900	14.000	96,600.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,800	19.940	95,712.000	
	KEYERA CORP	5,300	28.650	151,845.000	
	INTER PIPELINE LTD	10,400	21.590	224,536.000	
	ARC RESOURCES LTD	9,700	9.150	88,755.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 45,333,922.630 (3,872,423,671)	
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	35,900	25.110	901,449.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	47,300	24.180	1,143,714.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	13,670	9.650	131,915.500	
	KEPPEL CORP LTD	39,500	6.150	242,925.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	6.230	87,220.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,400	8.700	90,480.000	
	CAPITALAND LTD	68,900	3.160	217,724.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	56,800	1.260	71,568.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	2.660	109,060.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	35.290	95,283.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	82,800	11.240	930,672.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	153,000	0.970	148,410.000	
	VENTURE CORP LTD	7,200	15.320	110,304.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	220,950	3.080	680,526.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	39,500	3.460	136,670.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	22,700	2.650	60,155.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.230	37,812.000	

	SATS LTD	16,000	4.680	74,880.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,800	7.280	151,424.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	55,300	2.090	115,577.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	49,200	3.090	152,028.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 5,689,796.500 (471,627,232)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFREY AG-REG	850	108.700	92,395.000	
	UBS GROUP AG-REG	102,250	13.645	1,395,201.250	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	200	542.000	108,400.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,250	49.520	210,460.000	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	18,520	254.200	4,707,784.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	950	70.050	66,547.500	
	SIKA AG-REG	3,360	124.200	417,312.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	80,300.000	240,900.000	
	ABB LTD-REG	48,700	20.310	989,097.000	
	SWISS RE AG	8,400	91.480	768,432.000	
	NESTLE SA-REG	82,000	85.200	6,986,400.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	450	668.500	300,825.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,050	205.600	215,880.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	67,120	11.925	800,406.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,900	41.020	242,018.000	
	SGS SA-REG	140	2,379.000	333,060.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	500	199.300	99,650.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,200	126.600	151,920.000	
	TEMENOS AG - REG	1,550	126.400	195,920.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	850	300.900	255,765.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,022	313.600	1,261,299.200	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,300	148.900	193,570.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	20.400	116,280.000	
	NOVARTIS AG-REG	57,400	90.360	5,186,664.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	60	1,723.000	103,380.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT- REG	13,960	65.680	916,892.800	
	SWISSCOM AG-REG	710	475.500	337,605.000	
	GEBERIT AG-REG	990	391.900	387,981.000	
	GIVAUDAN-REG	250	2,478.000	619,500.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	270	609.500	164,565.000	

	SONOVA HOLDING AG-REG	1,420	161.500	229,330.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,010	319.100	641,391.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	59.250	90,060.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	12,790	45.450	581,305.500	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	900	391.900	352,710.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,490	142.100	211,729.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,030	82.150	166,764.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	29	6,850.000	198,650.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 30,338,049.750 (3,455,503,867)	
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	331.700	630,230.000	
	ERICSSON LM-B SHS	81,130	75.880	6,156,144.400	
	VOLVO AB-B SHS	42,100	127.000	5,346,700.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,800	530.500	954,900.000	
	SKF AB-B SHARES	9,750	142.400	1,388,400.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	5,950	206.100	1,226,295.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,600	357.700	1,645,420.000	
	TELE2 AB-B SHS	13,700	114.250	1,565,225.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	43,050	95.040	4,091,472.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	41,050	100.500	4,125,525.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	23,500	210.700	4,951,450.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	23,550	169.560	3,993,138.000	
	SKANSKA AB-B SHS	9,150	144.550	1,322,632.500	
	SANDVIK AB	29,850	134.700	4,020,795.000	
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	393.600	4,841,280.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	17,350	219.100	3,801,385.000	
	SECURITAS AB-B SHS	8,450	152.200	1,286,090.000	
	TELIA CO AB	77,000	42.050	3,237,850.000	
	ALFA LAVAL AB	7,700	193.900	1,493,030.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	10,300	202.600	2,086,780.000	
	ASSA ABLOY AB-B	26,850	168.650	4,528,252.500	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,800	273.600	492,480.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	4,650	239.000	1,111,350.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	15,700	233.000	3,658,100.000	
	BOLIDEN AB	7,000	202.500	1,417,500.000	

	EPIROC AB-A	17,950	75.290	1,351,455.500	
	EPIROC AB-B	9,700	72.480	703,056.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,450	72.300	827,835.000	
	NORDEA BANK ABP	79,400	81.680	6,485,392.000	
	KINNEVIK AB - B	6,050	237.300	1,435,665.000	
	HEXAGON AB-B SHS	6,900	459.400	3,169,860.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,600	185.200	851,920.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クロー ナ 84,197,607.900 (1,053,312,075)	
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	48,200	299.100	14,416,620.000	
	DANSKE BANK A/S	18,800	131.700	2,475,960.000	
	ISS A/S	4,400	216.700	953,480.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	9,025.000	857,375.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	265.500	451,350.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,250	485.300	2,547,825.000	
	CARLSBERG AS-B	2,750	717.400	1,972,850.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,800	311.400	1,806,120.000	
	COLOPLAST-B	3,100	643.600	1,995,160.000	
	DSV A/S	5,010	515.400	2,582,154.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,675	197.700	528,847.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	170	9,700.000	1,649,000.000	
	TRYG A/S	3,300	162.300	535,590.000	
	PANDORA A/S	2,750	358.300	985,325.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,550	597.400	1,523,370.000	
	GENMAB A/S	1,700	1,005.000	1,708,500.000	
	ORSTED A/S	5,050	433.800	2,190,690.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 39,180,216.500 (678,209,548)	
ニュージーラン ド・ドル		株	ニュージーランド・ド ル	ニュージーランド・ド ル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	34,500	3.250	112,125.000	
	A2 MILK CO LTD	19,000	10.900	207,100.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	4.170	219,713.130	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	7.050	164,970.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	4.790	96,279.000	

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	15,100	13.230	199,773.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,800	11.550	101,640.000	
ニュージーランド・ドル 小計					ニュージーランド・ドル 1,101,600.130 (85,781,602)
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	40.950	1,441,440.000	
	DNB ASA	26,150	148.850	3,892,427.500	
	ORKLA ASA	20,850	71.060	1,481,601.000	
	TELENOR ASA	19,900	165.700	3,297,430.000	
	EQUINOR ASA	31,223	199.800	6,238,355.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,560	348.000	1,586,880.000	
	MARINE HARVEST	11,050	199.000	2,198,950.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,850	137.100	664,935.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,400	283.000	679,200.000	
	AKER BP ASA	2,900	246.200	713,980.000	
ノルウェー・クローネ 小計					ノルウェー・クローネ 22,195,198.900 (294,752,241)
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	24,670	63.770	1,573,205.900	
	EVONIK INDUSTRIES AG	4,250	24.120	102,510.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	53,150	8.300	441,145.000	
	COMMERZBANK AG	26,335	7.893	207,862.150	
	VOLKSWAGEN AG	890	145.700	129,673.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	4,970	150.060	745,798.200	
	SIEMENS AG-REG	20,200	102.300	2,066,460.000	
	E.ON SE	59,100	8.979	530,658.900	
	UNIPER SE	5,350	23.110	123,638.500	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8,650	72.850	630,152.500	
	GEA GROUP AG	4,500	24.060	108,270.000	
	OSRAM LICHT AG	2,560	41.260	105,625.600	
	CONTINENTAL AG	2,970	132.850	394,564.500	
	BASF SE	24,420	64.860	1,583,881.200	
	K+S AG-REG	4,800	15.890	76,272.000	
	ALLIANZ SE-REG	11,630	189.160	2,199,930.800	
	THYSSENKRUPP AG	11,450	16.730	191,558.500	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,650	102.350	475,927.500	
RWE AG	14,150	19.050	269,557.500	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,100	21.520	131,272.000	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,000	67.280	67,280.000	
BRENNTAG AG	3,950	41.000	161,950.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	11,250	51.360	577,800.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	40.350	133,962.000	
HOCHTIEF AG	530	126.100	66,833.000	
SAP SE	26,142	91.100	2,381,536.200	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,980	192.100	764,558.000	
SCHAEFFLER AG	3,800	7.558	28,720.400	
ZALANDO SE	2,900	28.680	83,172.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,900	59.460	231,894.000	
KION GROUP AG	1,850	51.080	94,498.000	
WIRECARD AG	3,070	136.300	418,441.000	
COVESTRO AG	5,200	51.340	266,968.000	
INNOGY SE	3,730	40.000	149,200.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	950	115.800	110,010.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	4,000	56.680	226,720.000	
DELIVERY HERO SE	2,500	33.360	83,400.000	
METRO AG	5,000	13.740	68,700.000	
1&1 DRILLISCH AG	1,300	45.020	58,526.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,000	38.800	155,200.000	
BEIERSDORF AG	2,690	94.000	252,860.000	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,700	37.280	63,376.000	
MERCK KGAA	3,450	97.240	335,478.000	
ADIDAS AG	4,930	197.500	973,675.000	
PUMA SE	206	448.500	92,391.000	
HENKEL AG & CO KGAA	2,850	91.300	260,205.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	87,800	15.385	1,350,803.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,870	72.420	425,105.400	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	23,850	50.670	1,208,479.500	
QIAGEN N.V.	5,998	31.180	187,017.640	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	30,050	18.340	551,117.000	
HANNOVER RUECK SE	1,610	122.900	197,869.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	26,350	28.560	752,556.000	

DEUTSCHE BOERSE AG	5,100	111.200	567,120.000
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	5,950	18.170	108,111.500
LANXESS AG	2,200	49.220	108,284.000
MTU AERO ENGINES AG	1,430	175.900	251,537.000
AXEL SPRINGER SE	1,200	56.250	67,500.000
DEUTSCHE WOHNEN SE	9,400	42.440	398,936.000
SYMRISE AG	3,200	70.960	227,072.000
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	18,800	3.576	67,228.800
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,350	64.200	86,670.000
HUGO BOSS AG -ORD	1,590	62.320	99,088.800
RTL GROUP	1,000	53.700	53,700.000
VONOVIA SE	13,200	43.240	570,768.000
KONINKLIJKE PHILIPS NV	24,526	32.900	806,905.400
NN GROUP NV	8,050	37.940	305,417.000
ARCELORMITTAL	17,700	20.055	354,973.500
UNILEVER NV-CVA	41,100	48.965	2,012,461.500
HEINEKEN NV	6,700	79.720	534,124.000
AEGON NV	44,744	4.970	222,377.680
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	33,483	22.505	753,534.910
AKZO NOBEL	6,600	73.820	487,212.000
KONINKLIJKE DSM NV	4,750	78.000	370,500.000
WOLTERS KLUWER	7,800	53.700	418,860.000
ING GROEP NV	103,450	10.804	1,117,673.800
KONINKLIJKE KPN NV	84,250	2.537	213,742.250
ASML HOLDING NV	10,900	151.240	1,648,516.000
ABN AMRO GROUP NV-CVA	11,050	22.820	252,161.000
VOPAK	1,900	38.810	73,739.000
RANDSTAD NV	3,200	42.450	135,840.000
HEINEKEN HOLDING NV	3,150	76.700	241,605.000
JCDECAUX SA	1,900	29.940	56,886.000
TOTAL SA	63,650	48.440	3,083,206.000
MICHELIN (CGDE)	4,500	91.940	413,730.000
AIR LIQUIDE SA	11,292	104.150	1,176,061.800
KERING	1,980	388.700	769,626.000
SCHNEIDER ELECTRIC SE	14,500	64.340	932,930.000
BOUYGUES SA	5,600	34.740	194,544.000

BNP PARIBAS	29,900	44.775	1,338,772.500	
PEUGEOT SA	15,450	19.470	300,811.500	
NATIXIS	25,350	4.945	125,355.750	
THALES SA	2,850	107.250	305,662.500	
DANONE	16,200	65.540	1,061,748.000	
CARREFOUR SA	15,800	16.415	259,357.000	
SUEZ	9,925	13.140	130,414.500	
VIVENDI	27,991	22.290	623,919.390	
L'OREAL	6,730	208.400	1,402,532.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	13,050	32.880	429,084.000	
LEGRAND SA	7,217	54.040	390,006.680	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	40.500	62,775.000	
PERNOD RICARD SA	5,617	140.350	788,345.950	
SOCIETE BIC SA	700	94.500	66,150.000	
EURAZEO SE	1,195	67.150	80,244.250	
REXEL SA	7,850	10.605	83,249.250	
SOCIETE GENERALE SA	20,050	32.830	658,241.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,350	256.500	1,885,275.000	
ACCOR SA	4,950	39.870	197,356.500	
CAPGEMINI SE	4,220	102.850	434,027.000	
VALEO SA	6,400	25.540	163,456.000	
PUBLICIS GROUPE	5,600	52.700	295,120.000	
BUREAU VERITAS SA	7,100	19.455	138,130.500	
EIFFAGE	2,140	85.240	182,413.600	
SODEXO SA	2,500	91.220	228,050.000	
IPSEN	1,000	114.000	114,000.000	
INGENICO GROUP	1,600	64.460	103,136.000	
AMUNDI SA	1,500	50.940	76,410.000	
TELEPERFORMANCE	1,500	144.800	217,200.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,000	70.640	141,280.000	
FAURECIA	1,900	36.720	69,768.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	290	395.800	114,782.000	
SEB SA	560	129.200	72,352.000	
ESSILORLUXOTTICA	5,430	111.650	606,259.500	
DASSAULT AVIATION SA	70	1,350.000	94,500.000	
AXA SA	51,800	21.535	1,115,513.000	
EDENRED	6,400	33.430	213,952.000	
RENAULT SA	5,000	62.400	312,000.000	

HERMES INTERNATIONAL	860	485.100	417,186.000
STMICROELECTRONICS NV	18,550	12.970	240,593.500
REMY COINTREAU	550	102.000	56,100.000
ATOS SE	2,500	75.120	187,800.000
DASSAULT SYSTEMES SA	3,380	107.400	363,012.000
WENDEL	680	108.000	73,440.000
ORANGE	53,650	15.020	805,823.000
ALSTOM	4,050	39.070	158,233.500
CNP ASSURANCES	4,300	20.220	86,946.000
SANOFI	29,675	78.870	2,340,467.250
VINCI SA	13,450	77.580	1,043,451.000
AIRBUS SE	15,450	94.860	1,465,587.000
VEOLIA ENVIRONNEMENT	14,450	18.740	270,793.000
CREDIT AGRICOLE SA	30,100	11.052	332,665.200
BIOMERIEUX	1,150	65.000	74,750.000
ENGIE	47,873	12.490	597,933.770
IMERYS SA	900	48.660	43,794.000
EDF	15,950	14.710	234,624.500
SES	9,700	18.320	177,704.000
SAFRAN SA	8,800	111.500	981,200.000
ILIAD SA	650	124.600	80,990.000
ARKEMA	1,770	84.640	149,812.800
ADP	810	173.200	140,292.000
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,700	18.130	85,211.000
SCOR SE	4,150	42.500	176,375.000
GETLINK	12,400	11.480	142,352.000
BOLLORE	24,100	3.966	95,580.600
UCB SA	3,250	73.340	238,355.000
KBC GROUP NV	6,500	63.740	414,310.000
COLRUYT SA	1,600	56.620	90,592.000
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,000	80.060	160,120.000
SOLVAY SA	1,950	96.440	188,058.000
UMICORE	5,400	37.960	204,984.000
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	20,350	67.380	1,371,183.000
AGEAS	4,940	43.040	212,617.600
PROXIMUS	4,100	24.120	98,892.000
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	43.120	62,524.000
PRYSMIAN SPA	6,150	15.990	98,338.500
ASSICURAZIONI GENERALI	31,343	14.755	462,465.960

MEDIOBANCA SPA	15,265	7.808	119,189.120	
TENARIS SA	12,000	10.830	129,960.000	
UNICREDIT SPA	53,156	11.516	612,144.490	
TELECOM ITALIA SPA	282,782	0.564	159,658.710	
TELECOM ITALIA-RSP	146,950	0.484	71,197.270	
INTESA SANPAOLO	396,237	2.032	805,351.700	
ATLANTIA SPA	13,457	18.345	246,868.660	
POSTE ITALIANE SPA	13,500	6.706	90,531.000	
MONCLER SPA	4,700	29.510	138,697.000	
RECORDATI SPA	2,600	27.920	72,592.000	
ENI SPA	68,200	14.216	969,531.200	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	14,300	7.315	104,604.500	
PIRELLI & C SPA	11,000	6.244	68,684.000	
LEONARDO SPA	10,975	8.658	95,021.550	
ENEL SPA	215,434	4.758	1,025,034.970	
SNAM SPA	61,600	3.833	236,112.800	
LUXOTTICA GROUP SPA	4,500	51.700	232,650.000	
TERNA SPA	38,900	4.884	189,987.600	
EXOR NV	2,880	51.860	149,356.800	
CNH INDUSTRIAL NV	27,200	8.452	229,894.400	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	28,550	14.730	420,541.500	
FERRARI NV	3,145	96.060	302,108.700	
TELEFONICA SA	125,027	7.804	975,710.700	
ENDESA SA	8,250	19.645	162,071.250	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	174,812	4.990	872,311.880	
IBERDROLA SA	162,134	6.602	1,070,408.660	
BANCO DE SABADELL SA	144,909	1.124	162,877.710	
BANKINTER SA	18,300	7.414	135,676.200	
REPSOL SA	36,650	15.140	554,881.000	
GRIFOLS SA	7,750	26.200	203,050.000	
BANCO SANTANDER SA	426,450	4.213	1,796,847.070	
AMADEUS IT GROUP SA	11,700	64.020	749,034.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,050	21.690	196,294.500	
MAPFRE SA	25,450	2.524	64,235.800	
CAIXABANK SA	94,100	3.620	340,642.000	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE- DI	15,200	7.046	107,099.200	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,726	33.850	227,675.100	
AENA SME SA	1,850	142.050	262,792.500	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	28,500	27.310	778,335.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	5,600	12.650	70,840.000	
ENAGAS SA	5,900	24.070	142,013.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	11,500	18.955	217,982.500	
FERROVIAL SA	13,400	18.090	242,406.000	
BANKIA SA	30,105	2.909	87,575.440	
UPM-KYMMENE OYJ	13,700	23.890	327,293.000	
NOKIA OYJ	146,750	4.838	709,976.500	
WARTSILA OYJ ABP	12,000	14.705	176,460.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	13,800	11.165	154,077.000	
METSO OYJ	2,800	25.330	70,924.000	
ELISA OYJ	3,650	34.650	126,472.500	
SAMPO OYJ-A SHS	11,650	39.660	462,039.000	
FORTUM OYJ	12,250	18.295	224,113.750	
KONE OYJ-B	8,800	44.370	390,456.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,050	28.430	86,711.500	
NESTE OYJ	3,450	69.620	240,189.000	
ORION OYJ-CLASS B	2,750	29.540	81,235.000	
OMV AG	3,550	45.130	160,211.500	
ERSTE GROUP BANK AG	7,400	34.900	258,260.000	
VOESTALPINE AG	2,850	29.200	83,220.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	26.290	89,386.000	
ANDRITZ AG	2,100	42.340	88,914.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,000	23.820	142,920.000	
AIB GROUP PLC	23,000	3.826	87,998.000	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	27,460	5.820	159,817.200	
JERONIMO MARTINS	6,000	10.590	63,540.000	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	66,000	3.070	202,620.000	
GALP ENERGIA SGPS SA	11,650	14.440	168,226.000	
KERRY GROUP PLC-A	4,220	91.050	384,231.000	
CRH PLC	22,700	24.750	561,825.000	
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,200	79.750	175,450.000	
ユ一ロ 小計			ユ一ロ 94,924,759.309	

(12,263,329,655)

香港・ドル	株	香港・ドル	香港・ドル
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	37,500	53.450	2,004,375.000
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	48.500	3,152,500.000
MTR CORP	40,000	40.150	1,606,000.000
SUN HUNG KAI PROPERTIES	42,000	113.300	4,758,600.000
SINO LAND CO	90,000	13.500	1,215,000.000
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	70,669	81.500	5,759,523.500
WHARF HOLDINGS LTD	32,000	21.300	681,600.000
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	12,500	86.350	1,079,375.000
CLP HOLDINGS LTD	43,500	87.850	3,821,475.000
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	35,916	40.100	1,440,231.600
HANG LUNG GROUP LTD	21,000	21.350	448,350.000
HONG KONG & CHINA GAS	248,181	15.600	3,871,623.600
HANG SENG BANK LTD	20,400	180.100	3,674,040.000
WHEELLOCK & CO LTD	22,000	45.100	992,200.000
NEW WORLD DEVELOPMENT	159,000	10.740	1,707,660.000
WH GROUP LTD	222,500	5.820	1,294,950.000
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	31,300	228.200	7,142,660.000
MINTH GROUP LTD	18,000	27.250	490,500.000
LI & FUNG LTD	152,000	1.640	249,280.000
HANG LUNG PROPERTIES LTD	50,000	15.580	779,000.000
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	7,600	80.000	608,000.000
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	19,000	23.800	452,200.000
NWS HOLDINGS LTD	42,500	16.900	718,250.000
KERRY PROPERTIES LTD	17,500	27.050	473,375.000
BANK OF EAST ASIA LTD	32,640	26.350	860,064.000
HYSAN DEVELOPMENT CO	17,000	39.800	676,600.000
SJM HOLDINGS LTD	47,000	7.040	330,880.000
SWIRE PROPERTIES LTD	28,800	27.600	794,880.000
CK ASSET HOLDINGS LTD	69,669	56.000	3,901,464.000
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	18,000	59.000	1,062,000.000
PCCW LTD	117,000	4.530	530,010.000
AIA GROUP LTD	321,200	64.400	20,685,280.000
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	33,000	47.950	1,582,350.000
SANDS CHINA LTD	64,400	34.050	2,192,820.000

	SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	11.160	334,800.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	35,500	42.600	1,512,300.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	23,600	13.220	311,992.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	96,000	30.300	2,908,800.000	
	WYNN MACAU LTD	42,000	17.820	748,440.000	
香港・ドル	小計			香港・ドル 86,853,448.700 (1,260,243,541)	
合計				102,418,129,349 [102,418,129,349]	

(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	3,617	680,249.190	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	8,137	1,502,090.200	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,000	519,280.000	
		VORNADO REALTY TRUST	4,347	306,811.260	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,050	514,077.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	9,800	688,646.000	
		EQUINIX INC	2,088	802,021.680	
		AMERICAN TOWER CORP	11,450	1,863,144.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	20,043	386,829.900	
		KIMCO REALTY CORP	11,100	176,823.000	
		INVITATION HOMES INC	8,300	177,537.000	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,279	109,819.710	
		VENTAS INC	9,150	571,417.500	
		WEYERHAEUSER CO	20,064	536,511.360	
		AGNC INVESTMENT CORP	12,300	218,079.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	10,900	1,231,700.000	
		IRON MOUNTAIN INC	6,760	228,150.000	
		VEREIT INC	24,400	186,172.000	
		PROLOGIS INC	16,412	1,102,558.160	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,720	332,873.600	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,350	220,242.000	
		DUKE REALTY CORP	9,400	263,858.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,700	440,878.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,850	242,146.500	
		WELLTOWER INC	9,700	692,871.000	

	HCP INC	12,400	357,120.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,950	175,419.500	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,000	306,660.000	
	MACERICH CO/THE	2,900	145,174.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	33,600	338,016.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,150	205,300.500	
	REALTY INCOME CORP	7,550	482,143.000	
	PUBLIC STORAGE	4,150	879,219.000	
	REGENCY CENTERS CORP	4,050	254,421.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,400	225,168.000	
	UDR INC	6,800	284,852.000	
	WP CAREY INC	4,300	291,497.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	5,500	625,295.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,250	306,767.500	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 18,871,839.060 (2,141,387,578)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	19,662	163,666.480	
	SEGRO PLC	25,750	158,362.500	
	HAMMERSON PLC	19,200	74,707.200	
	BRITISH LAND CO PLC	23,400	133,380.000	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 530,116.180 (76,872,147)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	14,900	195,786.000	
	TRANSURBAN GROUP	68,100	782,469.000	
	SYDNEY AIRPORT	30,300	207,555.000	
	APA GROUP	31,200	286,104.000	
	SCENTRE GROUP	143,322	574,721.220	
	DEXUS	25,850	279,955.500	
	GPT GROUP	47,560	255,872.800	
	MIRVAC GROUP	98,800	223,288.000	
	STOCKLAND	66,000	248,160.000	
	GOODMAN GROUP	43,900	468,852.000	
	VICINITY CENTRES	89,273	243,715.290	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル	

			3,766,478.810 (312,919,060)
カナダ・ドル	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,500	カナダ・ドル 46,950.000
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,700	78,514.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,900	96,096.000
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 221,560.000 (18,925,655)
シンガポール・ドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	70,100	シンガポール・ドル 123,376.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	69,500	180,005.000
	CAPITALAND MALL TRUST	63,200	142,832.000
	SUNTEC REIT	63,000	113,400.000
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 559,613.000 (46,386,322)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,610	ユーロ 558,322.600
	ICADE	800	57,000.000
	GECINA SA	1,250	156,750.000
	KLEPIERRE	5,650	165,093.000
	COVIVIO	970	84,729.500
ユーロ 小計		ユーロ 1,021,895.100 (132,018,628)	
香港・ドル	LINK REIT	57,000	香港・ドル 4,300,650.000
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	64,500	489,555.000
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	99,000	1,110,780.000
香港・ドル 小計		香港・ドル 5,900,985.000 (85,623,292)	
投資証券 合計		2,814,132,682 [2,814,132,682]	
合計		2,814,132,682 [2,814,132,682]	

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	592銘柄	97.0%	3.0%	68.1%
	投資証券	39銘柄			
イギリス・ポンド	株式	96銘柄	98.9%	1.1%	6.6%
	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	57銘柄	88.6%	11.4%	2.6%
	投資証券	11銘柄			
カナダ・ドル	株式	89銘柄	99.5%	0.5%	3.7%
	投資証券	3銘柄			
シンガポール・ドル	株式	21銘柄	91.0%	9.0%	0.5%
	投資証券	4銘柄			
スイス・フラン	株式	38銘柄	100%	-%	3.3%
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%	-%	0.6%
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	236銘柄	98.9%	1.1%	11.8%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	株式	39銘柄	93.6%	6.4%	1.3%
	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。

「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11月30日現在	平成30年11月30日現在
	金額（円）	金額（円）

資産の部		
流動資産		
預金	255,916,193	535,407,915
金銭信託	-	434,501,630
コール・ローン	1,154,879,444	845,004,586
国債証券	164,124,972,994	166,684,616,502
派生商品評価勘定	1,144,512	4,699,833
未収入金	5,179,150	61,730,533
未収利息	1,273,446,527	1,269,292,926
前払費用	22,548,735	31,365,717
流動資産合計	166,838,087,555	169,866,619,642
資産合計	166,838,087,555	169,866,619,642
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	417,993	805,659
未払金	9,443,661	170,363,464
未払解約金	107,164,056	115,688,147
その他未払費用	-	8,906
流動負債合計	117,025,710	286,866,176
負債合計	117,025,710	286,866,176
純資産の部		
元本等		
元本	1	59,383,778,765
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		107,337,283,080
元本等合計		166,721,061,845
純資産合計		166,721,061,845
負債純資産合計		169,866,619,642

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12月1日 至 平成30年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<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>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年11月30日現在	平成30年11月30日現在
1. 1 期首	平成28年12月1日	平成29年12月1日
期首元本額	59,006,131,580円	59,383,778,765円
期中追加設定元本額	6,421,510,499円	6,447,535,619円
期中一部解約元本額	6,043,863,314円	4,385,380,795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	938,947,637円	694,267,908円
VA		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	31,434,341円	26,063,629円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	236,831,181円	173,213,023円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	64,229,316円	53,368,772円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	766,547,584円	565,112,790円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	2,177,730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)	248,867,657円	365,893,917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)	525,569,264円	1,077,780,230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)	400,023,699円	706,169,298円
D-I's 外国債券インデッ クス	880,097円	731,384円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	22,820円	27,109円
iFree 外国債券イン デックス	575,119,716円	496,757,292円
iFree 8資産バランス	245,604,315円	484,130,513円
iFree 年金バランス	- 円	4,278,927円
DCダイワ外国債券インデッ クス	40,005,557,043円	42,443,714,064円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	631,956,912円	739,083,378円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	299,143,351円	367,446,516円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	190,473,853円	237,136,801円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	268,358,922円	329,247,490円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	217,548,839円	263,447,011円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	67,378,321円	82,424,940円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	11,337,304円	10,493,771円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	17,901,368円	18,731,042円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,288,876円	1,851,074円
ダイワつみたてインデックス外国債券	-円	1,192,484円
ダイワ世界バランスファンド40VA	497,823,550円	249,101,467円
ダイワ世界バランスファンド60VA	166,073,932円	154,628,203円
ダイワ・バランスファンド35VA	6,394,036,947円	5,694,073,062円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	359,421,809円	17,320,918円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	142,269,988円	8,186,659円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	353,656,108円	328,670,549円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	126,558,233円	142,930,521円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	21,849,007円	28,480,694円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	374,472円	27,731,702円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,466,036,292円	5,534,667,082円
ダイワライフスタイル25	34,455,585円	35,273,760円
ダイワライフスタイル50	59,697,716円	62,560,835円
ダイワライフスタイル75	16,502,710円	17,567,044円
計	59,383,778,765円	61,445,933,589円

2. 期末日における受益権の総数	59,383,778,765口	61,445,933,589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12月1日 至 平成30年11月30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11月30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11月30日現在	平成30年11月30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	1,109,186,102	4,928,875,517
合計	1,109,186,102	4,928,875,517

(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11月30日まで、及び平成29年12月1日から平成30年11月30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11月30日 現在				平成30年11月30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	-	-	-	-	69,008,100	-	69,079,500	71,400
マレーシア・ リングgit	-	-	-	-	69,008,100	-	69,079,500	71,400
買 建	1,028,003,581	-	1,028,730,100	726,519	1,116,303,096	-	1,120,268,670	3,965,574
アメリカ・ドル	430,810,849	-	431,366,020	555,171	420,678,874	-	421,248,390	569,516
イギリス・ ポンド	101,665,514	-	101,563,620	101,894	54,194,703	-	54,223,290	28,587
オーストラリ ア・ドル	11,529,794	-	11,515,120	14,674	24,749,923	-	25,413,300	663,377
カナダ・ドル	22,700,658	-	22,708,170	7,512	65,526,746	-	65,238,610	288,136

シンガポ ル・ドル	8,296,250	-	8,304,000	7,750	12,449,089	-	12,677,580	228,491
デンマーク クローネ	21,733,295	-	21,769,780	36,485	28,512,966	-	28,786,530	273,564
ポーランド ズロチ	-	-	-	-	10,559,159	-	10,816,670	257,511
マレーシア リンギット	8,149,680	-	8,137,800	11,880	-	-	-	-
ユーロ	423,117,541	-	423,365,590	248,049	499,631,636	-	501,864,300	2,232,664
合計	1,028,003,581	-	1,028,730,100	726,519	1,185,311,196	-	1,189,348,170	3,894,174

(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11月30日現在	平成30年11月30日現在
1口当たり純資産額	2.8075円	2.7598円
(1万口当たり純資産額)	(28,075円)	(27,598円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,044,321.000	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	4,280,000.000	4,322,286.400	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,103,730.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,845,409.460	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,492,406.880	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,146,514.800	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,570,030.460	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,487,475.760	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,102,856.630	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,141,884.720	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,370,623.540	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,433,116.970	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	872,499.160	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,022,335.360	
		1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,329,741.930	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,861,517.900	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,344,430.860	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,201,143.000			
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,931,237.760			

1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,134,851.200	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,466,116.800	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,417,772.100	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,410,623.330	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,100,270.980	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,789,881.490	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,494,455.200	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	1,969,482.600	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,857,592.100	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,298,264.150	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	4,994,288.280	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,461,334.140	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	1,988,287.020	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,194,227.150	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,623,052.620	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,703,238.840	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,784,609.100	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	3,912,000.000	3,834,659.760	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,375,781.210	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,677,660.520	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,425,092.850	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	704,864.640	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,413,244.340	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	751,230.180	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,023,657.300	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	787,298.400	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	880,648.900	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	843,822.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	877,179.420	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	563,645.720	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,258,463.440	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	991,000.000	1,221,635.430	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,626,000.000	1,919,053.980	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	687,294.560	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	641,242.200	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	616,919.730	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,301,395.550	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,292,030.970	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,261,315.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,417,297.200	

4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,068,296.300	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,730,752.780	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,740,156.250	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,691,861.990	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,162,208.420	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,601,090.400	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,466,955.040	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,409,443.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,576,079.070	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,284,917.040	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,570,467.060	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,381,175.700	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,326,000.000	2,249,660.680	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,798,000.000	3,513,415.860	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,220,049.520	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	3,841,159.650	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	3,802,624.440	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	3,691,266.090	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,791,688.380	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,162,000.000	5,019,219.080	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,329,000.000	3,216,113.610	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,272,482.080	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,555,581.250	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,155,229.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,112,969.810	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,706,778.220	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,488,654.400	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,807,529.660	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,272,105.250	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,101,405.230	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,177,728.320	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,894,717.510	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,328,779.310	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,439,654.740	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,218,531.530	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,740,297.320	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,747,801.530	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,740,515.520	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,791,144.860	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,512,143.920	

3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	3,616,865.200	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,555,668.170	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,519,143.400	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,734,352.820	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,955,301.050	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,945,901.640	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,750,898.150	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,074,745.300	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,114,131.170	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,413,638.950	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,286,016.640	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,359,791.750	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,798,307.600	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,372,724.480	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,803,179.680	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,582,164.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,032,740.480	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,494,842.340	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,464,863.220	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,024,637.200	

2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,084,621.470	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	2,978,792.700	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	3,492,000.000	3,393,211.320	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,031,469.760	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	4,902,753.220	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,449,135.520	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	2,917,536.520	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,187,493.520	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,029,550.520	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,897,620.460	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,005,237.190	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	5,029,000.000	4,578,351.310	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,367,680.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	1,963,912.500	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	2,910,611.130	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,605,905.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,369,325.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,395,700.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,808,270.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,035,184.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	2,800,286.400	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,534,055.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,538,680.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,584,288.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,240,616.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,335,912.500	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,902,706.820	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,115,385.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,867,340.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,357,025.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,073,357.000	
1% United States Treasury Note/Bond 20191115	1,400,000.000	1,377,292.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,403,223.500	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,325,360.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20191215	1,440,000.000	1,419,912.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	1,951,080.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,425,975.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200115	1,500,000.000	1,477,200.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,049,610.800	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	2,922,047.800	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,405,972.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	3,333,115.350	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,130,000.000	2,094,620.700	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	2,919,910.700	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,214,808.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315	1,900,000.000	1,871,861.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	2,550,000.000	2,453,967.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,811,173.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200415	850,000.000	835,354.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,435,007.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	3,287,795.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	2,905,770.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,865,690.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	4,000,000.000	3,926,680.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	2,891,010.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	2,000,000.000	1,909,060.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615	2,700,000.000	2,647,134.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	2,888,670.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,290,104.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715	2,000,000.000	1,958,660.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,554,732.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815	1,300,000.000	1,272,011.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,801,661.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,877,870.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	3,392,678.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,060,480.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,892,180.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915	2,500,000.000	2,438,375.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,411,325.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,400,000.000	3,257,064.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015	1,000,000.000	978,390.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,421,075.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,166,975.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,100,000.000	2,764,797.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,374,210.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201115	3,600,000.000	3,526,992.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20191130	2,800,000.000	2,772,532.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	1,963,660.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,060,224.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,000,000.000	990,660.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	1,300,000.000	1,251,445.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,261,452.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20200131	2,300,000.000	2,280,128.000	
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	6,158,691.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,800,000.000	1,788,534.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,469,625.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,269,805.000	
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	2,673,189.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	3,376,944.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,168,352.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,500,000.000	1,489,380.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,857,834.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,849,018.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,474,300.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,900,000.000	3,748,875.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	5,500,000.000	5,428,225.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	2,985,810.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,200,000.000	1,193,004.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,489,050.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,893,616.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	1,400,000.000	1,393,756.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	1,900,000.000	1,892,875.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,489,250.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	4,975,150.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,475,000.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,300,000.000	3,284,127.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,966,700.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,282,840.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,300,000.000	3,289,803.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,500,000.000	2,487,875.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,000,000.000	5,918,400.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,200,000.000	3,939,432.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,494,425.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,490,425.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,500,000.000	2,491,875.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,583,656.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,557,520.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,491,915.000	

	2.75% United States Treasury Note/Bond 20200930	3,300,000.000	3,295,974.000	
	3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,509,375.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,001,380.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,002,910.000	
	3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,509,375.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,300,000.000	3,303,201.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	3,000,000.000	3,001,860.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 675,826,314.960 (76,686,011,959)	
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	2,327,196.000	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,934,812.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,517,152.170	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,582,000.000	1,871,664.200	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,505,360.750	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	1,300,000.000	1,285,479.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,210,000.000	1,077,021.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	800,000.000	782,960.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,330,000.000	1,264,963.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,110,000.000	2,112,932.900	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	1,500,000.000	1,488,600.000	

1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,200,000.000	1,231,404.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	930,000.000	844,440.000	
1% United Kingdom Gilt 20240422	200,000.000	200,030.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	70,000.000	65,877.000	
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,302,167.280	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,368,647.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,772,016.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,827,546.880	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,766,974.400	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,154,611.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,811,062.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,744,926.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,082,899.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,552,800.480	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,596,000.000	2,367,027.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,480,000.000	2,015,464.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,316,635.300	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,743,154.000	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,524,954.080	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,620,000.000	2,238,354.000	

	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,244,000.000	1,980,074.800	
	3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,889,811.900	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,227,670.200	
	3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	868,589.040	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,352,000.000	1,945,933.600	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,317,869.280	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,966,000.000	2,445,704.000	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,063,375.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,441,388.100	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,529,460.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	2,760,987.600	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 75,569,997.660 (10,958,405,361)	
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	2,634,436.200	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,409,000.000	2,489,918.310	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,434,584.960	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,351,460.760	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,021,518.340	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,526,886.670	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,074,000.000	2,195,038.640	

	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,517,804.080	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,358,000.000	1,637,136.900	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,189,190.400	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,240,349.460	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	547,180.090	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,184,310.350	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	712,000.000	738,080.560	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,522,000.000	2,557,787.180	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,078,000.000	2,017,031.480	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,132,000.000	1,105,386.680	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,795,842.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,200,000.000	2,227,962.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	750,000.000	752,340.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,500,000.000	1,517,955.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	600,000.000	591,402.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	290,000.000	275,259.300	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 42,548,861.360 (3,534,959,402)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 425,000.000	カナダ・ドル 468,685.750	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	555,091.160	

5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,294,207.970	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,593,927.370	
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,540,731.600	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,732,577.450	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,876,000.000	1,913,388.680	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	979,938.240	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,781,029.650	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	1,892,369.080	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,213,918.930	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,422,829.450	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,197,000.000	1,281,508.200	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,154,774.640	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,719,000.000	1,706,210.640	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,831,000.000	1,786,579.940	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,068,417.860	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,237,000.000	1,197,811.840	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,422,561.200	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,116,582.800	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840,000.000	794,648.400	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,400,000.000	1,338,414.000	

	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20191101	500,000.000	496,420.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,168,860.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,568,800.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,600,000.000	1,584,672.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200501	700,000.000	696,255.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	600,000.000	593,610.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	300,000.000	272,016.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200801	300,000.000	297,930.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	298,131.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20201101	2,200,000.000	2,192,190.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	600,000.000	600,180.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 39,025,268.850 (3,333,538,465)	
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	710,762.160	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	842,252.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	454,731.600	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	650,412.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	372,749.700	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	497,920.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	401,200.000	

	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	504,664.530	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	368,000.000	401,686.720	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	130,187.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	528,716.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	223,997.760	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	568,000.000	565,557.600	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	247,500.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	450,432.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	198,200.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	150,000.000	141,219.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	200,000.000	197,580.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	300,000.000	306,930.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 7,826,699.070 (648,755,086)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,095,000.000	10,092,266.750	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,884,643.400	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,575,269.400	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,564,239.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,862,714.600	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	5,983,652.800	

	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,659,382.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 49,622,167.950 (620,773,321)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	19,801,676.080	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	8,985,980.760	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	5,550,000.000	6,129,586.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,261,544.500	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	8,363,000.000	9,363,716.580	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	6,900,000.000	7,037,034.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	1,500,000.000	1,525,680.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 58,105,218.420 (1,005,801,331)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,436,704.620	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,333,839.800	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,403,353.500	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,422,974.800	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,300,053.600	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,449,448.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,400,000.000	2,436,912.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ	

			29,783,286.320 (395,522,042)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,309,000.000	2,610,093.600	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,478,000.000	2,479,040.760	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,283,625.950	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,143,590.600	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,054,356.100	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,370,000.000	2,275,271.100	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,335,776.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,150,000.000	2,169,135.000	
	Poland Government Bond 20200725	300,000.000	292,980.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,020,021.800	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,412,115.200	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,203,077.400	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,388,871.250	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,749,870.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,668,755.910	
ポーランド・ズロチ	小計		ポーランド・ズロチ 32,086,580.670 (967,089,541)	
マレーシア・リ ンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	544,768.290	

5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	794,589.840	
4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,189,650.420	
4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,940,237.400	
4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,538,632.780	
4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,270,594.000	
3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	863,441.250	
3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	714,501.330	
4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	593,718.780	
3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,044,000.000	1,043,739.000	
3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	983,432.450	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	927,000.000	854,888.670	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	567,119.080	
3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	659,778.560	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	598,218.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,064,198.170	
4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	865,381.460	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	730,735.500	
3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	701,498.000	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,159,595.190	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	775,793.800	

	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	697,872.240	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	901,569.900	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	638,254.500	
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	351,257.280	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500,000.000	502,115.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	751,380.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	590,000.000	576,589.300	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,049,044.500	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,188,192.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	500,000.000	497,620.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	707,658.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	400,000.000	406,452.000	
	マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 27,722,516.690 (751,557,427)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5% Mexican Bonos 20191211	21,447,000.000	20,719,946.700	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	13,290,000.000	10,965,180.300	
	8% Mexican Bonos 20471107	7,000,000.000	5,847,240.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	9,615,800.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	13,133,000.000	12,654,039.490	
	10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	23,149,524.210	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	22,668,000.000	20,513,633.280	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,141,462.360	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	8,398,262.400	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	8,687,084.220	
	8% Mexican Bonos 20200611	18,928,000.000	18,822,381.760	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	27,826,000.000	26,534,038.820	

	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	11,428,471.500	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	22,906,096.820	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	15,315,307.080	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	5,927,606.720	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 230,626,075.660 (1,293,812,284)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	439,236.000	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	411,246.900	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	292,009.770	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	417,386.940	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	200,938.000	
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	778,554.700	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	300,579.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	378,676.500	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	495,170.000	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	932,067.180	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,158,575.180	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	734,000.000	749,377.300	
	1.5% Austria Government Bond 20861102	150,000.000	137,848.500	
	Austria Government Bond 20230715	900,000.000	905,580.000	
	0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	581,977.800	
	2.1% Austria Government Bond 21170920	340,000.000	381,327.000	

Austria Government Bond 20220920	400,000.000	404,240.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,017,160.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,446,160.290	
1% Belgium Government Bond 20310622	924,000.000	918,012.480	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	594,705.240	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,334,153.210	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	944,000.000	906,070.080	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	340,000.000	346,368.200	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	495,306.700	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,421,014.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	650,000.000	662,103.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	489,357.200	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	298,542.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	940,000.000	943,703.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	553,415.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,298,624.460	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,111,727.930	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,029,339.140	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,783,287.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,561,817.790	

5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,314,743.840	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,864,140.000	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,220,632.810	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,029,739.250	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,494,444.980	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,165,760.500	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,041,096.480	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	2,224,560.800	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,518,452.640	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,487,117.980	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,841,215.860	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,525,426.600	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	3,027,321.430	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,399,715.560	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,038,000.000	2,768,154.260	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,764,669.600	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,522,292.400	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,967,629.300	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,774,474.260	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,724,015.230	

2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,409,000.000	3,313,169.970	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,743,198.400	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,645,807.440	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,277,393.940	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,285,535.340	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,244,855.600	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,834,524.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,615,776.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,361,732.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	800,000.000	853,456.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,200,000.000	1,226,952.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,200,000.000	1,192,236.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20191213	1,000,000.000	1,006,930.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200313	700,000.000	705,957.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200612	800,000.000	808,232.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200911	350,000.000	353,986.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,747,115.610	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,472,326.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,600,407.600	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,421,728.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	360,000.000	365,918.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,133,873.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	500,000.000	507,595.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	900,000.000	911,709.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,362,649.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,223,202.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,491,724.550	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,558,932.910	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,209,000.000	3,414,164.130	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,364,000.000	2,194,894.240	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,558,587.900	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	3,874,309.760	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,697,000.000	4,489,451.950	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	4,926,073.200	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,380,000.000	3,573,640.200	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	1,923,414.390	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,893,772.740	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,294,736.940	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,550,000.000	3,929,459.500	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	4,043,311.800	

2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,199,000.000	3,824,084.600	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,957,958.120	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,238,000.000	3,064,381.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,634,172.600	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,465,670.580	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,299,668.650	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,736,962.570	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2,322,000.000	2,346,706.080	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,361,494.120	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3,070,000.000	3,096,954.600	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,601,000.000	2,735,653.770	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,227,649.400	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	3,920,000.000	4,186,481.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,737,000.000	2,773,374.730	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,269,000.000	2,266,935.210	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	887,000.000	857,950.750	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,801,633.400	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,766,820.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	2,000,000.000	2,021,040.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,120,000.000	1,196,865.600	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20200225	700,000.000	705,250.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,607,000.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,950,000.000	2,109,432.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,415,504.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,147,519.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	2,400,000.000	2,424,888.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	950,000.000	966,197.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	1,100,000.000	1,106,501.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	1,100,000.000	1,098,548.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	726,072.600	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,815,296.070	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,075,399.300	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	925,430.450	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,223,595.660	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,349,000.000	2,138,353.860	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,609,534.080	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,576,795.760	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,446,077.440	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,513,223.300	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,249,000.000	1,767,572.310	

2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,689,487.740	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,388,770.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,305,407.560	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,368,225.420	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,216,644.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,241,316.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	800,000.000	804,704.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	950,000.000	976,818.500	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,446,172.420	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,447,961.700	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,022,076.720	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,806,326.780	
1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,454,898.250	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,323,939.920	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,604,222.910	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,568,859.390	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,452,400.850	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,512,828.310	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,591,000.000	1,515,188.850	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,475,860.160	

0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	770,904.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,213,502.400	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,248,645.980	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,184,521.740	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,641,909.420	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	778,026.480	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,396,272.640	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	649,796.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,315,671.140	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	648,000.000	531,431.280	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,200,000.000	1,065,108.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,010,000.000	1,894,244.100	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,257,659.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,225,987.500	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	970,000.000	965,955.100	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,365,624.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,300,000.000	1,206,244.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	674,436.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,200,000.000	1,125,072.000	
0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015	1,900,000.000	1,877,637.000	

2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	800,000.000	719,560.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,382,610.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	857,367.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,204,723.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	500,000.000	486,780.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	550,000.000	532,548.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	400,000.000	402,572.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	600,000.000	588,396.000	
2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	200,000.000	203,854.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,454,000.000	2,898,861.120	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,595,836.860	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,655,000.000	2,057,280.850	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,008,616.810	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	2,928,855.040	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	2,943,422.100	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,893,337.520	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	2,384,580.240	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,499,938.090	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,398,507.920	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,387,878.830	

4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,675,302.400	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,333,733.120	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,295,071.100	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,266,851.200	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,474,497.230	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,212,616.520	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,864,854.080	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,153,028.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,750,942.700	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,076,846.760	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,413,000.000	1,620,287.100	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,408,529.320	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,828,884.330	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,334,886.830	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	1,975,829.760	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,619,348.220	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,449,474.800	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,627,602.080	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	1,004,936.760	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	1,873,578.000	

4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,511,619.380	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,638,780.720	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,297,336.040	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,544,865.560	
4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	926,466.000	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,484,082.840	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	753,000.000	1,081,609.200	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,712,930.800	
3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	741,575.490	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,480,411.140	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	844,276.950	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	588,969.360	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	708,903.160	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	864,739.520	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	532,383.000	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	815,137.510	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,104,503.280	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	350,000.000	356,209.000	
IRISH TREASURY 20221018	50,000.000	50,112.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	499,600.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	689,346.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	202,602.000	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	735,000.000	785,869.350	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,230,710.250	
3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,339,303.680	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,486,409.750	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,073,000.000	1,610,454.970	

4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,165,377.500	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	906,021.630	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	1,000,541.520	
3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	546,565.680	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	872,442.970	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,047,362.260	
2.4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	743,337.000	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,020,213.800	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	835,144.030	
3.375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	666,437.680	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	502,531.560	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	469,056.200	
1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	656,088.480	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	478,825.600	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	534,956.730	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	586,290.700	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,342,074.400	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,826,857.950	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,098,600.920	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,932,026.880	

1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,650,000.000	1,688,676.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,837,985.140	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,785,171.950	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,452,000.000	1,529,144.760	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	850,000.000	950,232.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,730,000.000	1,745,362.400	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	1,380,000.000	1,393,993.200	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	1,828,188.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,450,000.000	1,505,361.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,800,000.000	1,812,618.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	1,300,000.000	1,304,771.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,000,000.000	1,009,570.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,100,000.000	2,093,259.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	650,000.000	650,227.500	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	700,000.000	697,172.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	700,000.000	693,693.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	200,000.000	200,074.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	2,902,262.870	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,151,473.580	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,308,000.000	1,867,091.520	

	4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,041,510.680	
	4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,850,881.250	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	2,618,098.130	
	4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,229,749.280	
	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,716,089.310	
	4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,842,846.680	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,854,525.000	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,649,114.750	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,339,855.320	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,158,444.480	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,601,000.000	1,902,308.200	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,362,719.900	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,499,000.000	2,237,647.240	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,297,571.600	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,338,993.800	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,939,824.000	
	ユーロ 小計		ユーロ 506,874,504.320 (65,483,117,213)	
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	5,832,024.800	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	16,434,000.000	17,894,982.600	

	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,612,000.000	8,352,859.960	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,581,788.600	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,265,744.800	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,441,723.050	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	5,539,000.000	5,450,652.950	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	17,652,000.000	15,874,267.080	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,873,383.270	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	11,862,000.000	10,770,696.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	11,944,000.000	10,746,733.440	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	8,243,000.000	7,454,804.340	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	6,166,000.000	5,768,046.360	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	5,179,000.000	4,809,530.140	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 121,117,237.390 (1,005,273,070)	
国債証券 合計			166,684,616,502 [166,684,616,502]	
合計			166,684,616,502 [166,684,616,502]	

- (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%	45.9%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	100%	6.6%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	100%	2.1%

カナダ・ドル	国債証券	33銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券	19銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	100%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	100%	0.6%
ノルウェー・クローネ	国債証券	7銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券	33銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	299銘柄	100%	39.3%
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。

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

ダイワライフスタイル75

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2019年5月31日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,461,995
親投資信託受益証券	917,707,445
流動資産合計	925,169,440
資産合計	925,169,440
負債の部	
流動負債	
未払解約金	146,316
未払受託者報酬	403,743
未払委託者報酬	4,138,823
その他未払費用	37,785
流動負債合計	4,726,667
負債合計	4,726,667
純資産の部	
元本等	
元本	1,674,947,845
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	245,494,928
（分配準備積立金）	240,936,319
元本等合計	920,442,773
純資産合計	920,442,773
負債純資産合計	925,169,440

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2018年12月1日 至 2019年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	41,224,468
営業収益合計	41,224,468
営業費用	
支払利息	1,629
受託者報酬	403,743
委託者報酬	4,138,823
その他費用	37,906
営業費用合計	4,582,101
営業損失()	45,806,569
経常損失()	45,806,569
中間純損失()	45,806,569
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,348,893
期首剰余金又は期首欠損金()	291,519,594
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,357,212
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,357,212
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,924,202
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,924,202
中間剰余金又は中間欠損金()	245,494,928

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2018年12月1日	2019年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年5月31日現在
1. 1 期首元本額	673,349,184円
期中追加設定元本額	38,577,332円
期中一部解約元本額	36,978,671円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	674,947,845口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2018年12月1日	2019年5月31日
	該当事項はありません。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年5月31日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2019年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3637円 (13,637円)

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年5月31日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	25,633,881,058
株式	131,113,242,940
未収配当金	1,339,006,285
未収利息	2,210,369

前払金		70,693,300
その他未収収益	5	68,481,875
流動資産合計		158,227,515,827
資産合計		158,227,515,827
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		105,305,520
未払金		1,068,182,272
未払解約金		149,018,200
受入担保金		23,618,009,413
その他未払費用		69,069
流動負債合計		24,940,584,474
負債合計		24,940,584,474
純資産の部		
元本等		
元本	1	137,134,203,836
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2	3,847,272,483
元本等合計		133,286,931,353
純資産合計		133,286,931,353
負債純資産合計		158,227,515,827

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年5月31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	2019年5月31日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2018年12月1日 134,890,694,102円 9,724,969,235円 7,481,459,501円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス ファンド	4,073,523,584円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	7,850,097,932円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2	30,396,804円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	60,746,661円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	976,298,947円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	49,591,649円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,345,583,232円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	16,075,672円

D - I ' s T O P I Xイン デックス	40,214,704円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	19,956,909円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,615,386円
i F r e e T O P I Xイン デックス	1,058,368,415円
i F r e e 8資産バランス	1,668,197,638円
i F r e e 年金バランス	39,259,361円
D Cダイワ日本株式インデッ クス	65,463,869,371円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,822,872,454円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,155,894,448円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,903,880,442円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,924,604,053円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	15,526,759円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	51,731,923円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	18,069,602円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	94,482,729円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	358,303円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	367,695円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	726,124円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	4,245,918円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	4,248,105円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	8,201,794円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	168,418,017円

	ダイワ世界バランスファンド 60VA	165,937,499円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,582,574,749円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	534,691円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	2,894,230円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	825,721,462円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	127,351,633円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	223,926,223円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	162,607,666円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス	8,816,898,397円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	1,824,429,209円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,511,232,486円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX	1,422,634,051円
	ダイワライフスタイル25	193,069,689円
	ダイワライフスタイル50	678,512,244円
	ダイワライフスタイル75	558,497,294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)	13,169,957,682円
	計	137,134,203,836円
2.	期末日における受益権の総数	137,134,203,836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3,847,272,483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 22,131,142,240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 563,220,000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64,882,793円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	2019年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,258,808,300	-	2,153,580,000	105,228,300

合計	2,258,808,300	-	2,153,580,000	105,228,300

(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)

	2019年5月31日現在
1口当たり純資産額	0.9719円
(1万口当たり純資産額)	(9,719円)

「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

	2019年5月31日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	318,612,580
国債証券	68,619,637,360
地方債証券	4,258,984,300
特殊債券	3,038,197,800
社債券	3,214,418,000
未収入金	404,252,000
未収利息	190,215,009
前払費用	3,219,222
流動資産合計	80,047,536,271
資産合計	80,047,536,271
負債の部	
流動負債	

未払金		151,425,000
未払解約金		199,700,940
その他未払費用		616
流動負債合計		351,126,556
負債合計		351,126,556
純資産の部		
元本等		
元本	1	55,694,177,433
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		24,002,232,282
元本等合計		79,696,409,715
純資産合計		79,696,409,715
負債純資産合計		80,047,536,271

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年5月31日現在
1. 1 期首	2018年12月1日
期首元本額	56,170,487,793円
期中追加設定元本額	4,924,937,246円
期中一部解約元本額	5,401,247,606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)	110,544,053円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	695,407,858円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	81,173,073円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	941,805,563円
DCダイワ日本債券インデックス	6,624,352,852円
ダイワ・バランスファンド35VA	11,990,994,559円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	2,032,404,440円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	273,700,515円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	377,796,020円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	76,740,301円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	18,773,312,277円
ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)	3,350,910,901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	1,456,301,610円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,193,875,632円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,669,658,876円
ダイワライフスタイル25	437,855,405円
ダイワライフスタイル50	473,545,800円

ダイワライフスタイル75	133,797,698円
計	55,694,177,433円
2. 期末日における受益権の総数	55,694,177,433口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年5月31日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2019年5月31日現在
1口当たり純資産額	1.4310円
(1万口当たり純資産額)	(14,310円)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年5月31日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	477,211,593
コール・ローン	657,931,001

株式		104,607,938,513
投資証券		3,065,289,476
派生商品評価勘定		60,588
未収入金		29,852,491
未収配当金		246,626,252
差入委託証拠金		529,774,376
流動資産合計		109,614,684,290
資産合計		109,614,684,290
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		38,237,298
未払金		611,537,106
未払解約金		19,660,300
その他未払費用		242
流動負債合計		669,434,946
負債合計		669,434,946
純資産の部		
元本等		
元本	1	44,628,273,602
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		64,316,975,742
元本等合計		108,945,249,344
純資産合計		108,945,249,344
負債純資産合計		109,614,684,290

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <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	2019年5月31日現在
1. 1 期首	2018年12月1日
期首元本額	43,964,024,902円
期中追加設定元本額	2,891,561,132円
期中一部解約元本額	2,227,312,432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	465,436,944円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	12,197,180円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	166,747,782円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	19,605,630円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	536,410,008円
外国株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	2,841,001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)	564,006,956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)	1,670,052,387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)	537,878,792円
D-I's 外国株式インデッ クス	6,496,960円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	441,378円
iFree 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	887,982,883円
iFree 8資産バランス	664,732,732円
iFree 年金バランス	15,735,595円
DCダイワ外国株式インデッ クス	28,307,321,069円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	566,316,775円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	845,096,866円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	647,722,261円
大和DC海外株式インデック スファンド	1,490,572,021円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,377,054円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	13,224,319円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	4,114,724円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	48,899,893円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	73,977円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	151,649円

ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	1,168,038円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	1,759,327円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	201,197,830円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	330,653,891円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	2,865,438,066円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	147,919,110円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	659,889,033円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	105,242,619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)	452,701円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,693,918,139円
ダイワライフスタイル25	19,377,609円
ダイワライフスタイル50	68,025,943円
ダイワライフスタイル75	55,794,460円
計	44,628,273,602円
2. 期末日における受益権の総数	44,628,273,602口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2019年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買 建	1,258,897,640	-	1,220,676,320	38,221,320
合計	1,258,897,640	-	1,220,676,320	38,221,320

(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。

- 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。
- 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	2019年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	609,698,390	-	609,743,000	44,610

アメリカ・ドル	535,646,160	-	535,696,000	49,840
イギリス・ポンド	34,454,250	-	34,450,000	4,250
オーストラリア・ドル	17,365,460	-	17,365,000	460
カナダ・ドル	19,387,968	-	19,387,200	768
ニュージーランド・ドル	2,844,552	-	2,844,800	248
合計	609,698,390	-	609,743,000	44,610

(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)

	2019年5月31日現在
1口当たり純資産額	2.4412円
(1万口当たり純資産額)	(24,412円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年5月31日現在
--	--------------

	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,650,778,791
コール・ローン	955,340,439
国債証券	170,561,258,660
未収利息	1,222,990,803
前払費用	31,229,606
流動資産合計	174,421,598,299
資産合計	174,421,598,299
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	565,471
未払金	548,772,893
未払解約金	115,345,161
その他未払費用	2,684
流動負債合計	664,686,209
負債合計	664,686,209
純資産の部	
元本等	
元本	1 62,716,189,447
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	111,040,722,643
元本等合計	173,756,912,090
純資産合計	173,756,912,090
負債純資産合計	174,421,598,299

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<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>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年5月31日現在
1. 1 期首	2018年12月1日
期首元本額	61,445,933,589円
期中追加設定元本額	3,051,866,337円
期中一部解約元本額	1,781,610,479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	646,989,957円
V A	

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	22,454,828円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	152,843,057円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	41,724,252円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	484,204,601円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	10,513,906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)	388,409,650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)	1,248,238,563円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマー ジングプラス(為替 ヘッジなし)	771,688,522円
D-I's 外国債券インデッ クス	2,265,454円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	61,299円
iFree 外国債券イン デックス	556,584,417円
iFree 8資産バランス	597,352,248円
iFree 年金バランス	8,446,083円
DCダイワ外国債券インデッ クス	43,740,646,206円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	759,335,471円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	377,634,416円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	231,514,040円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	360,334,480円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	284,809,971円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	92,698,229円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	10,216,687円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	18,593,922円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	2,100,634円
ダイワつみたてインデックス外国債券	25,338,842円
ダイワ世界バランスファンド40VA	218,270,670円
ダイワ世界バランスファンド60VA	154,401,436円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,272,526,588円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	815,488円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	1,574,412円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	314,888,512円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	147,665,486円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	30,559,756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)	364,363円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,627,577,092円
ダイワライフスタイル25	34,660,334円
ダイワライフスタイル50	60,836,672円
ダイワライフスタイル75	17,048,903円
計	62,716,189,447円

2. 期末日における受益権の総数	62,716,189,447口
------------------	-----------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2019年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	777,524,401	-	776,958,930	565,471
アメリカ・ドル	361,822,355	-	361,642,960	179,395
イギリス・ポンド	551,232	-	550,720	512
オーストラリア・ドル	3,850,994	-	3,845,400	5,594
カナダ・ドル	51,595,479	-	51,528,960	66,519
シンガポール・ドル	23,732,703	-	23,721,000	11,703

スウェーデン・ クローナ	2,156,276	-	2,154,480	1,796
デンマーク・ クローネ	7,784,257	-	7,775,100	9,157
ノルウェー・ クローネ	12,093,167	-	12,081,960	11,207
ポーランド・ ズロチ	23,728,799	-	23,695,470	33,329
マレーシア・ リングギット	12,502,080	-	12,499,200	2,880
メキシコ・ペソ	20,124,048	-	20,077,160	46,888
ユーロ	249,504,358	-	249,323,520	180,838
南アフリカ・ ランド	8,078,653	-	8,063,000	15,653
合計	777,524,401	-	776,958,930	565,471

(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)

	2019年5月31日現在
1口当たり純資産額	2.7705円
(1万口当たり純資産額)	(27,705円)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2019年6月28日

資産総額	941,238,335円
負債総額	699,784円
純資産総額（ - ）	940,538,551円
発行済数量	674,400,932口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3946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

2019年6月28日

資産総額	155,598,886,758円
負債総額	18,082,616,590円
純資産総額（ - ）	137,516,270,168円
発行済数量	137,726,173,770口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9985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

2019年6月28日

資産総額	80,712,492,041円
負債総額	123,692,387円
純資産総額（ - ）	80,588,799,654円
発行済数量	55,970,299,440口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.4398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

2019年6月28日

資産総額	114,139,929,196円
負債総額	53,087,710円
純資産総額(-)	114,086,841,486円
発行済数量	45,109,732,813口
1単位当たり純資産額(/)	2.5291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

2019年6月28日

資産総額	177,245,825,755円
負債総額	437,987,039円
純資産総額(-)	176,807,838,716円
発行済数量	62,994,327,197口
1単位当たり純資産額(/)	2.8067円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2019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。

2019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	75	145,253
追加型株式投資信託	721	15,318,969
株式投資信託 合計	796	15,464,222
単位型公社債投資信託	30	111,005
追加型公社債投資信託	14	1,392,102
公社債投資信託 合計	44	1,503,108
総合計	840	16,967,330

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(2018年4月1日から2019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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	1	206
建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
固定負債		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374

役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	210	215
有価証券償還益	17	133
その他	130	172
営業外収益計	359	521
営業外費用		
投資有価証券売却損	0	40
有価証券償還損	3	32
その他	25	60
営業外費用計	29	132
経常利益	18,741	16,961
特別損失		
関係会社整理損失	333	29
特別損失計	333	29
税引前当期純利益	18,407	16,931
法人税、住民税及び事業税	5,843	5,076
法人税等調整額	106	15
法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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	利益剰余金	
				剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
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	13,850	14,225	40,895

	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
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
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	41,112

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

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。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の前事業年度期首残高が480百万円増加しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

(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「受取配当金」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「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円
器具備品	235百万円	264百万円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金	4,406百万円	3,788百万円

3 保証債務

前事業年度（2018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。

当事業年度（2019年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万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 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017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

2018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	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26日

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

2019年6月21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	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月24日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る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(2018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。

当事業年度(2019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		28,489	28,489	-
(2) 未収委託者報酬		11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券		8,380	8,380	-
資産計		48,338	48,338	-
(1) 未払手数料		(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金		(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,805)	(2,805)	-
負債計		(11,298)	(11,298)	-

(*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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	1,836
(3) 長期差入保証金	1,072	1,070

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(2018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

当事業年度(2019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	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
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	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

(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(2018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(2019年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,836百万円)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(2018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。

当事業年度(2019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	87	55	32
(2) その他			
証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
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	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)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 2017年4月1日 至 2018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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	389	86	-
(2) その他			
証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,318百万円	2,350百万円
勤務費用	159	158
退職給付の支払額	166	171
その他	38	52
退職給付債務の期末残高	2,350	2,389

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,350百万円	2,389百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389
退職給付引当金	2,350	2,389
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	159百万円	158百万円
その他	24	41
確定給付制度に係る退職給付費用	184	199

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171百万円、当事業年度174百万円であります。

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		731
	719	
賞与引当金	244	182
システム関連費用	16	170
未払事業税	162	141
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	68	32
その他	297	240
繰延税金資産小計	1,602	1,592
評価性引当額	200	164
繰延税金資産合計	1,402	1,428
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
その他有価証券評価差額金	164	85
繰延税金負債合計	323	244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引（譲渡益）は480百万円減少しております。

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（2018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（2019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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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 2017年4月1日 至 2018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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有) 直接91.0	経営管理	有償減資(注2)	3,293	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

(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 2017年4月1日 至 2018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)(注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	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(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	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。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,063	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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額	15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益	4,550.81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おりません。

(注2) 「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

(注3) 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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,670	11,870
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2019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 (2019年 3月末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	(注1)
大樹生命保険株式会社	() 167,280	(注2)
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	(注3)
三井住友信託銀行株式会社	342,037	(注4)
株式会社山口銀行	10,005	(注5)

() 資本金の額は、2019年4月1日現在のものです。

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注3) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注4) 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。

(注5) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

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

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
使用開始日を記載することがあります。
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
ファンドの形態等を記載することがあります。
図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2019年5月24日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小倉 加奈子	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治	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2018年4月1日から2019年3月31日までの第60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2019年3月31日現在の財政状態及び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12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワライフスタイル75の平成29年12月1日から平成30年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワライフスタイル75の平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワライフスタイル75の2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワライフスタイル75の2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。