

## 【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】	2020年6月2日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【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】	i F r e e 8 資産バランス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

i F r e e 8資産バランス

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

### (3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

### (4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

2020年6月3日から2020年11月30日まで(継続申込期間)

(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

- ・委託会社のホームページ

アドレス <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。

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

申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

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

（ ）前 の申込受付中止日を除きます。

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

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

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

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

## 第二部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、値動きの異なる8つの資産クラスに分散投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

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

##### (注1) 商品分類の定義

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

##### (注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」…目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

### < 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

### < ファンドの特色 >

iFree 8資産バランス

SIMPLE  
& EASY

インデックスってなに？

FREE  
& LOW

費用はどれくらいかかるのかな？



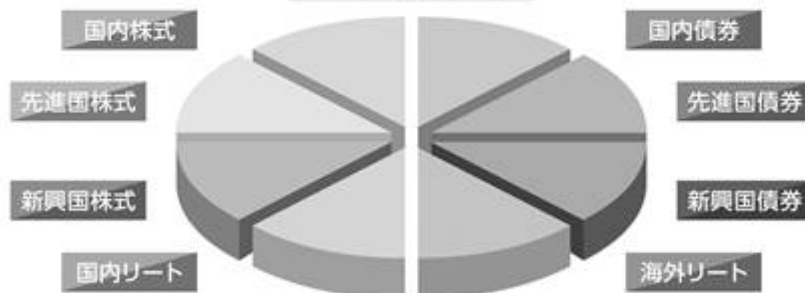
これらの質問については、以降でご説明します。

## ファンドの目的・特色

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

### ■ 8つの資産クラスについて

資産配分のイメージ



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

※先進国株式・債券の資産クラスには、日本の株式・債券を含みません。

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



当ファンドは、「つみたてNISA」対象ファンドです。



# インデックス ってなに？




## 「インデックス」とは

いふなれば「市場のモノサシ」です。

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

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

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



当ファンドの各資産クラスにおける対象インデックスは以下のとおりです。

### ■対象インデックスについて

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

資産クラス	対象インデックス
先進国債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債券	JPモルガン ガバメント・ボンド・イン デックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)
国内リート	東証REIT指数(配当込み)
海外リート	S&P先進国REIT指数(除く日本) (円ベース)

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





# 費用はどれくらいかかるのかな？



## ファンドへの投資にかかる主な費用は

購入時	保有期間中	売却時
<b>購入時手数料</b> 購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供等に対するものです。	<b>運用管理費用（信託報酬）</b> ファンドの運用・管理等に対するものです。	<b>換金時手数料 信託財産留保額</b> 換金する際に必要な費用等です。
<b>無料</b>	<b>低水準</b>	<b>無料</b>

当ファンドは、費用を低く抑えたファンドです。

※上記は主な費用であり、他にも費用・税金がかかります。

— Aさんの場合 —



### 運用管理費用っていくらくらい？

Aさんは当ファンドを10万円分保有しています。  
 当ファンドの運用管理費用の料率は年率0.242%（税込）です。  
 1年間ファンドの値段（基準価額）が変わらなかったと仮定した場合の1年間にかかる費用はおおよそ…

Aさんの保有残高	×	運用管理費用の料率	≒	1年間にかかる運用管理費用
10万円		0.242%		242円(税込)

※上記の運用管理費用は簡便に計算した概算値です。

## ■ インデックスの概要について

### ● 東証株価指数(TOPIX)

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

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

### ● MSCIコクサイ指数

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

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

### ● FTSE RAFI エマージング インデックス

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

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

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

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

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

### ● NOMURA-BPI総合指数

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

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

### ● FTSE世界国債インデックス

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

### ● JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)

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

JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P.Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P.Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P.Morgan Chase & Co. All rights reserved.

### ● 東証REIT指数(配当込み)

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

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

**株**東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、**株**東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、**株**東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

### ● S&P先進国REIT指数

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

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

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

### ファンドの仕組みなど



- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- 安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。
  - 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
  - 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的
  - 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的
- 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される場合、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、「ファンドの特色」の運用が行なわれないことがあります。

### 分配方針

毎年9月7日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

#### 【分配方針】

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

### (2) 【ファンドの沿革】

2016年9月8日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

### (3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ）

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

（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。

\*再信託受託会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

<委託会社の概況(2020年2月末日現在)>

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長(金商)第352号)

・大株主の状況

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

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

#### 主要投資対象

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

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券(東証株価指数)
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券(MSCIコクサイ指数(円ベース))
3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券(FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算))
4. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)の受益証券(NOMURA-BPI総合指数)
5. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券(FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース))

6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券( JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算) )
7. ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券( 東証REIT指数(配当込み) )
8. ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券( S & P先進国R E I T指数(除く日本)(円ベース) )

#### 投資態度

イ. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、次の資産クラスに投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

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

ロ. 各資産クラスの配分比率については、均等とすることを目標とします。

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

ニ. 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

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

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

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

#### (2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
  - イ. 有価証券
  - ロ. 約束手形
  - ハ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1. から8. までに掲げる親投資信託(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券、ならびに次の9. から12. までに掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

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

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

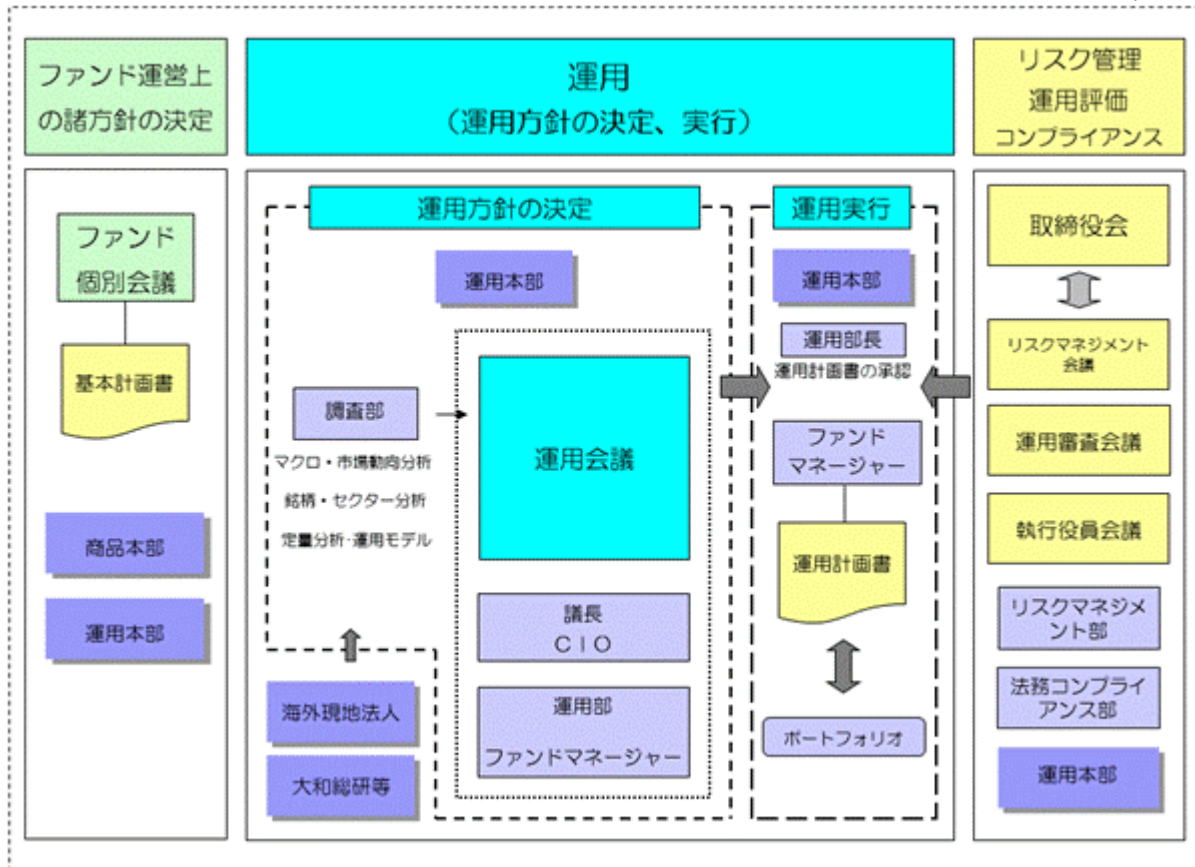
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

### (3) 【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。





### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．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。

#### ハ．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。

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．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。

ロ．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。

ハ．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2020年2月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

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

原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

#### 外国為替予約取引（信託約款）

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

#### 信用リスク集中回避（信託約款）

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

#### 資金の借入れ（信託約款）

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

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

### <参考> マザーファンドの概要

#### 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

##### (1) 投資方針

###### 投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

###### 投資態度

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないません。

イ．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないません。

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

## (2) 投資対象

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

## (3) 主な投資制限

株式

株式への投資には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとし、
- ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとし、
- ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとし、

## 2. 外国株式インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- イ．主として外国の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとし、
- 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. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

### (3) 主な投資制限

株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

### 3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

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

ロ．新興国の企業のDR（預託証券）

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

##### 投資態度

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

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

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

ハ 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ニ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

#### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前21.の有価証券の性質を有するもの

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



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

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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

#### 投資信託証券

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

#### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

#### 先物取引等

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

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

### 金利先渡取引および為替先渡取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 4. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA - BPI 総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

## 3. コール・ローン

## 4. 手形割引市場において売買される手形

## 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

## 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

## (3) 主な投資制限

## 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## 投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

## 外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

## 先物取引等

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

ロ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

## スワップ取引

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

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

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

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

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

## 金利先渡取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

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

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

ニ．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

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

—

## 5. 外国債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

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

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

#### 投資信託証券

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### 同一銘柄の株式

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

## 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

新興国通貨建ての債券を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- イ．主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
- ロ．運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
  - イ．有価証券
  - ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。）
  - ハ．約束手形
  - ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ．為替手形

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

- 1．転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券

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

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。



## 投資信託証券

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

### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

### 先物取引等

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

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

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

### スワップ取引

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

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

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

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

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

### 金利先渡取引および為替先渡取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委

託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

—

## 7. ダイワJ-REITマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

わが国の金融商品取引所（ ）上場（上場予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

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

#### 投資態度

イ．東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行いません。

ロ．投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。

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

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

### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

4．新投資口予約権証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限りま。

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

### (3) 主な投資制限

株式

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引

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

## 8. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

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

#### 投資態度

- イ. 主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク(S & P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)をいいます。以下同じ。)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ. 組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。
- ハ. 運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ニ. 保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ホ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)に定めるものに限りま。
  - ハ. 約束手形
  - ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
4. 外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
6. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。

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

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

### (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

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

## 3 【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

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

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

### 〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



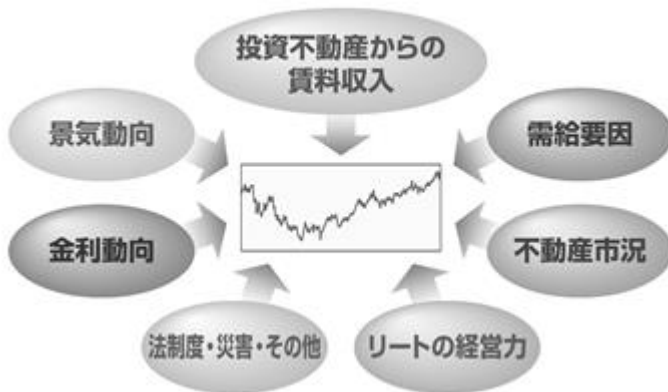
※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがより高いものになると考えられます。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

### リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

#### 〈リーートの主な価格変動要因〉



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

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

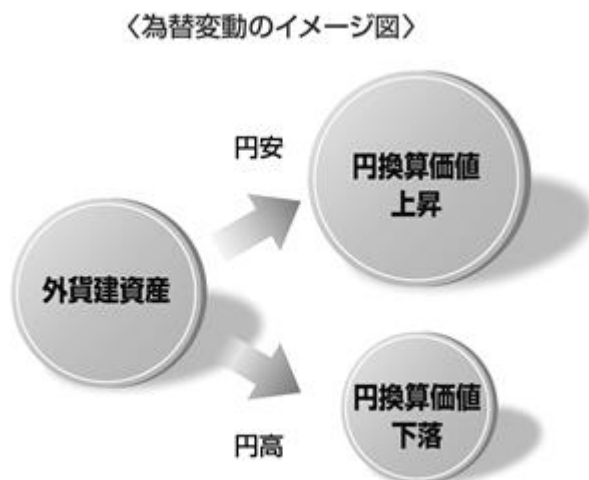
ロ．リーートの価格や配当は、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リーートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リーートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。

- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
  - ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
  - ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。
- 八．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
  - ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもありえます。
- 二．組入リートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

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

## ロ．カントリー・リスク

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

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

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

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

その他

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

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

## (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

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

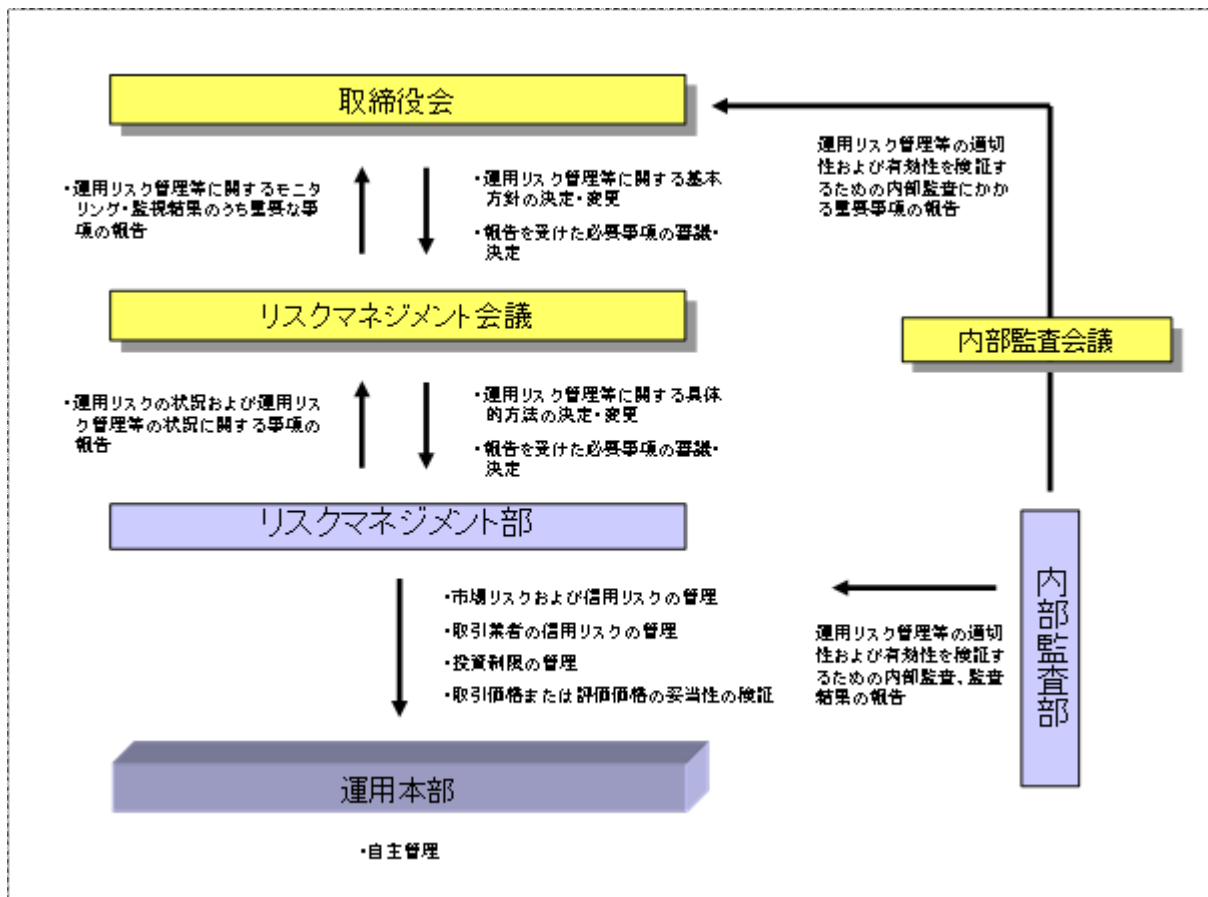
## (3) その他の留意点

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

## (4) リスク管理体制



運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

## 参考情報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年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年における年間騰落率の推移を表示しています。



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

### ※資産クラスについて

日本株：東証株価指数(TOPIX) (配当込み)  
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)  
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)  
 日本国債：NOMJURA-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。●NOMJURA-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。NOMJURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。 Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

## (2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.242%（税抜0.22%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

#### <マザーファンドより支弁する手数料等>

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

##### イ．収益分配金に対する課税

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

##### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

##### ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

「つみたてNISA」をご利用の場合

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

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

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

#### <注1> 個別元本について

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

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

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

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

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

- ( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2020年2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】 (2020年2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	19,258,019,160	98.94
内 日本	19,258,019,160	98.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	206,892,887	1.06
純資産総額	19,464,912,047	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】 (2020年2月28日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	878,391,034	2.8476 2,501,359,019	2.9474 2,588,969,733	13.30
2	ダイワ日本債券インデックスマ ザーファンド(BPI)	日本	親投資 信託受 益証券	1,958,676,208	1.3185 2,582,520,737	1.3175 2,580,555,904	13.26
3	ダイワ新興国債券インデック ス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,759,132,094	1.3797 2,427,175,995	1.4137 2,486,885,041	12.78
4	ダイワ新興国株式ファンダメン タル・インデックス・マザーファ ンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,567,647,085	1.5086 2,365,056,449	1.5067 2,361,973,862	12.13
5	ダイワ・グローバルREITイン デックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	948,160,751	2.4759 2,347,559,284	2.4572 2,329,820,597	11.97
6	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	743,326,217	3.2629 2,425,458,554	3.1276 2,324,827,076	11.94

7	トピックス・インデックス・マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	2,340,657,210	1.0174 2,381,471,726	0.9844 2,304,142,957	11.84
8	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	873,585,350	2.5544 2,231,498,032	2.6109 2,280,843,990	11.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.94%
合計	98.94%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年9月7日)	4,423,564,263	4,423,564,263	1.1184	1.1184
第2計算期間末 (2018年9月7日)	9,247,296,645	9,247,296,645	1.1443	1.1443
2019年2月末日	12,307,647,791	-	1.1835	-
3月末日	12,737,215,397	-	1.1921	-
4月末日	13,087,622,978	-	1.2038	-
5月末日	13,293,789,269	-	1.1679	-
6月末日	14,147,121,538	-	1.1953	-
7月末日	14,917,966,773	-	1.2129	-
8月末日	15,231,696,697	-	1.1864	-



第3計算期間末 (2019年9月9日)	15,633,295,158	15,633,295,158	1.2108	1.2108
9月末日	16,150,575,236	-	1.2240	-
10月末日	17,217,339,870	-	1.2627	-
11月末日	18,006,938,755	-	1.2681	-
12月末日	18,953,275,230	-	1.2854	-
2020年1月末日	19,803,963,928	-	1.2807	-
2月末日	19,464,912,047	-	1.2203	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.8
第2計算期間	2.3
第3計算期間	5.8

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	5,119,041,794	1,173,761,616
第2計算期間	5,936,562,291	1,810,640,911
第3計算期間	6,888,328,647	2,057,961,207

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年2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	136,646,339,633	97.12
内 日本	136,646,339,633	97.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,049,186,934	2.88
純資産総額	140,695,526,567	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)	4,183,605,000	2.97
内 日本	4,183,605,000	2.97

(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 (2020年2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	717,700.5	7,380.47 5,296,972,760	7,127.00 5,115,051,463	3.64
2	ソニー	日本	株式	電気機 器	406,200	6,391.26 2,596,130,797	6,611.00 2,685,388,200	1.91
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	500,200	4,585.35 2,293,597,034	5,013.00 2,507,502,600	1.78
4	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,361,500	565.52 2,466,526,575	531.90 2,319,881,850	1.65
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	842,600	2,640.04 2,224,501,679	2,529.50 2,131,356,700	1.51
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	534,500	3,777.63 2,019,146,698	3,763.00 2,011,323,500	1.43
7	キーエンス	日本	株式	電気機 器	58,200	33,554.68 1,952,882,948	34,410.00 2,002,662,000	1.42
8	リクルートホールディ ングス	日本	株式	サービ ス業	439,700	3,439.91 1,512,528,757	3,758.00 1,652,392,600	1.17
9	三井住友フィナンシャ ルG	日本	株式	銀行業	438,100	3,792.42 1,661,463,048	3,484.00 1,526,340,400	1.08
10	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	469,800	2,878.90 1,352,510,794	3,058.00 1,436,648,400	1.02
11	任天堂	日本	株式	その他 製品	39,400	42,022.42 1,655,683,501	36,270.00 1,429,038,000	1.02

12	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	505,700	2,893.07 1,463,025,986	2,799.50 1,415,707,150	1.01
13	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	465,500	2,818.55 1,312,039,091	2,927.50 1,362,751,250	0.97
14	東京海上HD	日本	株式	保険業	226,500	5,894.78 1,335,169,424	5,801.00 1,313,926,500	0.93
15	信越化学	日本	株式	化学	108,000	11,839.09 1,278,622,124	12,145.00 1,311,660,000	0.93
16	みずほフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	8,608,100	168.51 1,450,582,766	147.60 1,270,555,560	0.90
17	HOYA	日本	株式	精密機 器	128,300	8,900.36 1,141,916,985	9,609.00 1,232,834,700	0.88
18	第一三共	日本	株式	医薬品	183,900	7,109.79 1,307,491,571	6,590.00 1,211,901,000	0.86
19	花王	日本	株式	化学	153,800	7,983.86 1,227,919,232	7,868.00 1,210,098,400	0.86
20	ダイキン工業	日本	株式	機械	81,800	14,519.52 1,187,697,097	14,725.00 1,204,505,000	0.86
21	三菱商事	日本	株式	卸売業	443,900	2,782.47 1,235,140,806	2,690.00 1,194,091,000	0.85
22	日立	日本	株式	電気機 器	308,600	4,086.62 1,261,130,979	3,637.00 1,122,378,200	0.80
23	ファナック	日本	株式	電気機 器	61,000	20,505.47 1,250,833,987	17,970.00 1,096,170,000	0.78
24	伊藤忠	日本	株式	卸売業	442,500	2,303.15 1,019,144,576	2,461.50 1,089,213,750	0.77
25	村田製作所	日本	株式	電気機 器	188,700	5,109.20 964,107,361	5,721.00 1,079,552,700	0.77
26	三井物産	日本	株式	卸売業	556,000	1,840.32 1,023,222,820	1,783.50 991,626,000	0.70
27	日本電産	日本	株式	電気機 器	77,300	15,367.90 1,187,939,397	12,780.00 987,894,000	0.70
28	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	565,000	1,543.73 872,210,609	1,699.00 959,935,000	0.68
29	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	42,800	20,880.12 893,669,548	22,325.00 955,510,000	0.68
30	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	53,400	22,499.16 1,201,455,472	17,780.00 949,452,000	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	97.12%
合計	97.12%

(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	0.09%
鉱業	0.26%
建設業	2.69%
食料品	3.70%
繊維製品	0.55%
パルプ・紙	0.23%
化学	6.97%
医薬品	5.94%
石油・石炭製品	0.48%
ゴム製品	0.65%
ガラス・土石製品	0.79%
鉄鋼	0.66%
非鉄金属	0.68%
金属製品	0.56%
機械	4.90%
電気機器	14.04%
輸送用機器	7.64%
精密機器	2.42%
その他製品	2.14%
電気・ガス業	1.49%
陸運業	3.99%
海運業	0.15%
空運業	0.44%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	9.06%
卸売業	4.98%
小売業	4.35%
銀行業	5.59%
証券、商品先物取引業	0.79%
保険業	2.32%
その他金融業	1.20%

不動産業	2.32%
サービス業	4.86%
合計	97.12%

(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 2020年3月	買建	279	4,699,569,950	4,183,605,000	2.97%

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

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

#### ダイワJ-REITマザーファンド

##### (1) 投資状況（2020年2月28日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	368,834,011,630	98.20
内 日本	368,834,011,630	98.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,755,651,765	1.80
純資産総額	375,589,663,395	100.00

##### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	6,577,050,000	1.75
内 日本	6,577,050,000	1.75

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

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

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

## (2) 投資資産（2020年2月28日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	34,349	799,671.15 27,467,904,517	809,000.00 27,788,341,000	7.40
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	35,471	721,136.94 25,579,448,675	736,000.00 26,106,656,000	6.95
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	114,510	193,084.72 22,110,132,123	171,300.00 19,615,563,000	5.22
4	日本プロロジスリート	日本	投資証券	53,374	286,872.46 15,311,530,716	292,700.00 15,622,569,800	4.16
5	オリックス不動産投資	日本	投資証券	70,674	229,525.56 16,221,489,769	205,000.00 14,488,170,000	3.86
6	日本リテールファンド	日本	投資証券	67,039	219,832.12 14,737,326,086	205,100.00 13,749,698,900	3.66
7	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	79,643	202,439.06 16,122,854,325	172,600.00 13,746,381,800	3.66
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	48,111	293,213.31 14,106,785,759	269,200.00 12,951,481,200	3.45
9	GLP投資法人	日本	投資証券	88,345	136,051.91 12,019,506,055	136,800.00 12,085,596,000	3.22
10	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	33,642	346,527.11 11,657,865,159	321,500.00 10,815,903,000	2.88
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	22,590	494,867.91 11,179,066,302	475,000.00 10,730,250,000	2.86
12	API投資法人	日本	投資証券	17,774	533,845.58 9,488,571,387	514,000.00 9,135,836,000	2.43
13	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	103,713	91,089.01 9,447,115,131	85,300.00 8,846,718,900	2.36
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	10,973	820,874.96 9,007,461,021	806,000.00 8,844,238,000	2.35
15	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	11,787	666,231.91 7,852,875,625	661,000.00 7,791,207,000	2.07
16	産業ファンド	日本	投資証券	45,681	155,491.13 7,102,990,445	169,700.00 7,752,065,700	2.06

17	森ヒルズリート	日本	投資証券	40,810	169,303.13 6,909,261,059	169,800.00 6,929,538,000	1.84
18	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	114,266	81,892.48 9,357,527,243	60,400.00 6,901,666,400	1.84
19	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	155,589	62,946.80 9,793,831,093	43,950.00 6,838,136,550	1.82
20	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,187	822,185.62 6,731,233,678	833,000.00 6,819,771,000	1.82
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	23,176	269,594.64 6,248,125,392	268,400.00 6,220,438,400	1.66
22	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	32,810	174,888.72 5,738,098,977	180,400.00 5,918,924,000	1.58
23	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	30,166	192,697.14 5,812,902,148	182,100.00 5,493,228,600	1.46
24	日本リート投資法人	日本	投資証券	11,521	446,543.38 5,144,626,383	466,000.00 5,368,786,000	1.43
25	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	32,979	156,058.20 5,146,643,562	158,000.00 5,210,682,000	1.39
26	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	45,507	116,042.39 5,280,741,067	112,600.00 5,124,088,200	1.36
27	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	15,444	345,391.93 5,334,233,109	330,500.00 5,104,242,000	1.36
28	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	12,599	453,272.11 5,710,775,349	402,000.00 5,064,798,000	1.35
29	イオンリート投資	日本	投資証券	38,280	138,584.76 5,305,024,878	131,200.00 5,022,336,000	1.34
30	インベスコ・オフィス・リート	日本	投資証券	227,881	20,619.15 4,698,714,268	21,980.00 5,008,824,380	1.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.20%
合計	98.20%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2020年3月	買建	3,260	7,061,170,600	6,577,050,000	1.75%

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

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

## ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

## (1) 投資状況（2020年2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	18,612,400,470	85.66
内 日本	18,612,400,470	85.66
地方債証券	1,470,135,400	6.77
内 日本	1,470,135,400	6.77
特殊債券	633,983,400	2.92
内 日本	633,983,400	2.92
社債券	839,674,400	3.86
内 日本	839,674,400	3.86
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	172,934,836	0.80
純資産総額	21,729,128,506	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（2020年2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	345 10年国債	日本	国債証券	280,000,000	101.85 285,188,400	102.63 287,378,000	0.100000 2026/12/20	1.32
2	137 5年国債	日本	国債証券	250,000,000	100.99 252,495,500	101.32 253,317,500	0.100000 2023/09/20	1.17
3	130 5年国債	日本	国債証券	247,000,000	100.55 248,367,880	100.64 248,585,740	0.100000 2021/12/20	1.14
4	138 5年国債	日本	国債証券	240,000,000	101.05 242,540,000	101.42 243,410,400	0.100000 2023/12/20	1.12
5	135 5年国債	日本	国債証券	230,000,000	100.96 232,210,300	101.16 232,686,400	0.100000 2023/03/20	1.07
6	133 5年国債	日本	国債証券	230,000,000	100.83 231,916,100	100.97 232,247,100	0.100000 2022/09/20	1.07
7	334 10年国債	日本	国債証券	220,000,000	103.50 227,706,600	103.78 228,329,200	0.600000 2024/06/20	1.05
8	128 5年国債	日本	国債証券	227,000,000	100.41 227,948,860	100.42 227,962,480	0.100000 2021/06/20	1.05
9	356 10年国債	日本	国債証券	218,000,000	101.45 221,163,480	102.67 223,822,780	0.100000 2029/09/20	1.03
10	335 10年国債	日本	国債証券	210,000,000	103.21 216,751,500	103.54 217,452,900	0.500000 2024/09/20	1.00
11	349 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.92 203,851,200	102.86 205,734,000	0.100000 2027/12/20	0.95
12	352 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.76 203,534,100	102.83 205,668,000	0.100000 2028/09/20	0.95
13	353 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.61 203,237,250	102.78 205,560,000	0.100000 2028/12/20	0.95
14	140 5年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.19 202,380,000	101.58 203,176,000	0.100000 2024/06/20	0.94
15	139 5年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.16 202,334,000	101.51 203,028,000	0.100000 2024/03/20	0.93
16	131 5年国債	日本	国債証券	190,000,000	100.64 191,223,600	100.75 191,428,800	0.100000 2022/03/20	0.88
17	350 10年国債	日本	国債証券	185,000,000	101.97 188,644,500	102.87 190,318,750	0.100000 2028/03/20	0.88
18	347 10年国債	日本	国債証券	180,000,000	101.94 183,502,800	102.83 185,097,600	0.100000 2027/06/20	0.85

19	129 5年国債	日本	国債証券	182,000,000	100.49 182,900,900	100.52 182,950,040	0.100000 2021/09/20	0.84
20	406 2年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.52 180,948,600	100.59 181,069,200	0.100000 2021/11/01	0.83
21	348 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.97 173,352,400	102.85 174,848,400	0.100000 2027/09/20	0.80
22	141 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.23 172,100,600	101.68 172,859,400	0.100000 2024/09/20	0.80
23	134 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.85 171,455,300	101.07 171,824,100	0.100000 2022/12/20	0.79
24	132 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.71 171,215,500	100.85 171,455,200	0.100000 2022/06/20	0.79
25	340 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.30 165,291,200	103.80 166,089,600	0.400000 2025/09/20	0.76
26	329 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.49 165,593,600	103.56 165,702,400	0.800000 2023/06/20	0.76
27	351 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	101.89 163,038,400	102.87 164,606,400	0.100000 2028/06/20	0.76
28	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	102.74 164,384,000	102.73 164,379,200	0.800000 2022/09/20	0.76
29	408 2年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.49 160,795,200	100.66 161,060,800	0.100000 2022/01/01	0.74
30	403 2年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.45 160,731,200	100.49 160,784,000	0.100000 2021/08/01	0.74

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	85.66%
地方債証券	6.77%
特殊債券	2.92%
社債券	3.86%
合計	99.20%

(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。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2020年2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	7,271,378,325	86.78
内 中国	2,521,605,454	30.09
内 台湾	1,082,523,206	12.92
内 タイ	225,670,171	2.69
内 シンガポール	3,649,444	0.04
内 マレーシア	95,485,962	1.14
内 インドネシア	136,667,821	1.63
内 インド	628,811,009	7.50
内 ロシア	775,665,202	9.26
内 トルコ	151,962,318	1.81
内 メキシコ	267,544,386	3.19
内 チリ	53,364,019	0.64
内 ブラジル	875,437,603	10.45
内 南アフリカ	452,991,730	5.41
投資証券	909,935,043	10.86
内 トルコ	4,454,200	0.05
内 アメリカ	876,775,046	10.46
内 メキシコ	14,561,442	0.17
内 南アフリカ	14,144,355	0.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	197,764,347	2.36
純資産総額	8,379,077,715	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)	188,337,784	2.25
内 アメリカ	188,337,784	2.25
為替予約取引(買建)	87,508,500	1.04

内 日本	87,508,500	1.04
------	------------	------

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

(注2) 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（2020年2月28日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証券	-	413,000	2,290.26 945,896,604	2,122.94 876,775,046	10.46
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	312,000	886.51 276,592,456	1,140.76 355,917,120	4.25
3	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	3,719,000	87.23 324,453,553	90.41 336,263,054	4.01
4	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	3,000,000	76.70 230,114,781	76.65 229,975,200	2.74
5	LUKOIL PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	18,690	9,233.70 172,579,960	9,958.13 186,117,450	2.22
6	GAZPROM PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	226,870	850.59 192,982,113	714.35 162,066,635	1.93
7	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	3,621,000	45.53 164,908,201	44.36 160,650,734	1.92
8	CHINA MOBILE LTD	中国	株式	コミュニケーション・サービス	157,500	986.36 155,353,587	890.13 140,196,420	1.67
9	SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR	ロシア	株式	金融	79,960	1,674.16 133,870,386	1,616.82 129,281,587	1.54
10	VALE SA	ブラジル	株式	素材	96,890	1,223.94 118,588,903	1,083.28 104,959,891	1.25
11	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	128,636	887.36 114,147,331	756.86 97,360,112	1.16

12	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	77,000	1,337.14 102,960,025	1,240.43 95,513,418	1.14
13	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	中国	株式	一般消費財・サービス	4,100	18,956.01 77,719,922	22,436.43 91,989,375	1.10
14	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	1,557,800	71.89 112,006,116	57.56 89,673,199	1.07
15	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニケーション・サービス	15,200	4,971.77 75,571,115	5,604.76 85,192,474	1.02
16	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	38,570	1,973.62 76,122,717	2,134.82 82,340,200	0.98
17	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	メキシコ	株式	コミュニケーション・サービス	923,000	79.29 73,195,907	86.94 80,246,912	0.96
18	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	262,902	277.33 72,912,868	289.88 76,210,820	0.91
19	CNOOC LTD	中国	株式	エネルギー	480,000	181.41 87,078,648	156.96 75,344,256	0.90
20	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	94,360	922.58 87,055,489	730.06 68,889,330	0.82
21	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	465,100	163.03 75,830,296	144.87 67,380,200	0.80
22	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	102,400	654.84 67,056,733	616.30 63,109,939	0.75
23	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	1,199,000	45.15 54,141,263	44.64 53,531,993	0.64
24	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	株式	金融	15,170	3,483.77 52,848,858	3,499.18 53,082,682	0.63
25	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	43,360	1,143.70 49,590,990	1,197.88 51,940,467	0.62
26	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	78,100	720.71 56,288,251	653.57 51,044,504	0.61
27	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	45,300	1,299.80 58,880,986	1,115.44 50,529,631	0.60
28	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	38,003	1,173.25 44,587,106	1,299.60 49,388,699	0.59

29	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	91,500	531.97 48,675,885	531.41 48,624,381	0.58
30	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	ロシア	株式	素材	12,970	2,480.23 32,168,850	3,512.70 45,559,758	0.54

(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	86.78%
投資証券	10.86%
合計	97.64%

(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	13.96%
素材	8.36%
資本財・サービス	2.83%
一般消費財・サービス	5.17%
生活必需品	4.04%
ヘルスケア	0.60%
金融	28.82%
情報技術	9.48%
コミュニケーション・サービス	8.23%
公益事業	2.60%
不動産	2.69%
合計	86.78%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMGMKT 2020年3月	買建	34	202,725,969	188,337,784	2.25%

為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2020年3月	買建	800,000	88,684,470	87,508,500	1.04%
--------	----	-----------------	----	---------	------------	------------	-------

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## 外国株式インデックスマザーファンド

### (1) 投資状況 (2020年2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	117,152,349,537	89.52
内 香港	1,561,659,250	1.19
内 シンガポール	514,525,704	0.39
内 イスラエル	274,232,779	0.21
内 ノルウェー	257,727,639	0.20
内 スウェーデン	1,244,323,844	0.95
内 デンマーク	890,817,912	0.68
内 イギリス	6,805,823,959	5.20
内 アイルランド	252,863,453	0.19
内 オランダ	1,772,774,470	1.35
内 ベルギー	395,238,518	0.30
内 フランス	4,820,025,566	3.68
内 ドイツ	3,746,338,577	2.86
内 スイス	4,300,016,841	3.29
内 ポルトガル	73,251,797	0.06
内 スペイン	1,250,254,529	0.96
内 イタリア	1,050,406,635	0.80
内 フィンランド	429,128,973	0.33
内 オーストリア	86,731,048	0.07
内 カナダ	4,519,492,722	3.45
内 アメリカ	80,147,097,959	61.24
内 オーストラリア	2,630,414,934	2.01
内 ニューージーランド	129,202,428	0.10
投資証券	3,626,907,918	2.77

内 香港	91,065,055	0.07
内 シンガポール	65,933,320	0.05
内 イギリス	84,715,294	0.06
内 フランス	129,111,603	0.10
内 カナダ	40,804,632	0.03
内 アメリカ	2,845,465,398	2.17
内 オーストラリア	369,812,616	0.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,091,630,743	7.71
純資産総額	130,870,888,198	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)	10,222,664,995	7.81
内 イギリス	555,146,495	0.42
内 ドイツ	1,570,313,466	1.20
内 カナダ	405,827,080	0.31
内 アメリカ	7,393,906,054	5.65
内 オーストラリア	297,471,900	0.23
為替予約取引(買建)	8,634,361,600	6.60
内 日本	8,634,361,600	6.60

(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 (2020年2月28日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	130,350	29,268.91 3,815,213,809	29,931.29 3,901,544,121	2.98
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	209,250	16,619.57 3,477,659,684	17,309.63 3,622,041,626	2.77



3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	12,100	197,804.24 2,393,432,212	206,198.94 2,495,007,283	1.91
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	69,050	22,083.63 1,524,876,628	20,764.34 1,433,777,850	1.10
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	8,967	143,183.24 1,283,924,979	144,238.58 1,293,387,425	0.99
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	8,580	143,030.91 1,227,206,193	143,894.97 1,234,618,916	0.94
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	92,170	14,423.09 1,329,378,970	13,281.51 1,224,157,615	0.94
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	76,100	15,071.90 1,146,973,583	15,223.90 1,158,538,912	0.89
9	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	86,900	11,747.11 1,020,824,450	11,502.95 999,606,390	0.76
10	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	49,750	20,224.41 1,006,167,321	19,698.49 980,000,091	0.75
11	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	72,267	13,365.12 965,864,747	12,420.30 897,578,181	0.69
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	37,750	24,126.79 910,789,282	22,725.32 857,881,136	0.66
13	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	210,591	4,090.93 861,534,903	3,909.93 823,396,890	0.63
14	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	26,050	32,063.97 835,266,770	31,277.28 814,773,212	0.62
15	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	255,401	3,646.20 931,245,067	3,187.69 814,140,721	0.62
16	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	127,850	6,359.96 813,130,175	6,109.47 781,096,622	0.60

17	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	31,650	24,162.91 764,758,832	24,592.20 778,343,253	0.59
18	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	27,326	30,628.25 836,949,816	27,786.46 759,292,959	0.58
19	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	20,690	34,927.55 722,652,816	36,449.74 754,145,286	0.58
20	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	119,404	6,587.57 786,587,979	6,025.21 719,434,867	0.55
21	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	117,250	5,859.31 687,006,464	6,010.98 704,788,566	0.54
22	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	52,012	16,571.53 861,920,466	12,917.11 671,845,100	0.51
23	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	121,955	7,438.61 907,180,078	5,451.80 664,874,586	0.51
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	73,921	9,542.18 705,370,545	8,544.29 631,602,786	0.48
25	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	63,250	10,407.14 658,255,418	9,614.05 608,088,789	0.46
26	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	40,350	14,879.85 600,405,259	14,922.96 602,141,803	0.46
27	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	159,713	4,213.71 672,995,896	3,731.56 595,979,121	0.46
28	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	130,790	4,831.55 631,930,072	4,492.10 587,521,955	0.45
29	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	54,818	12,796.96 701,507,837	10,300.64 564,660,807	0.43
30	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	120,922	5,959.55 720,641,648	4,647.49 561,984,040	0.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

株式	89.52%
投資証券	2.77%
合計	92.29%

(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

業種	投資比率
エネルギー	4.12%
素材	3.78%
資本財・サービス	9.18%
一般消費財・サービス	8.87%
生活必需品	7.79%
ヘルスケア	12.42%
金融	14.49%
情報技術	16.99%
コミュニケーション・サービス	7.79%
公益事業	3.61%
不動産	0.48%
合計	89.52%

(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 2020年3月	買建	457	8,247,358,448	7,393,906,054	5.65%
	イギリス	FT 100 2020年3月	買建	58	606,639,580	555,146,495	0.42%
	オーストラリア	SPI 200 INDEX 2020年3 月	買建	25	312,769,042	297,471,900	0.23%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX 2020 年3月	買建	25	429,494,064	405,827,080	0.31%
	ドイツ	SMI 2020年3月	買建	31	380,394,606	355,750,445	0.27%
		EURO STOXX 50 2020年3 月	買建	292	1,328,481,034	1,214,563,021	0.93%

為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2020年3月	買建	8,050,000	964,991,425	968,576,000	0.74%
		英ポンド買/円売 2020年3月	買建	2,520,000	359,734,997	355,521,600	0.27%
		スイス・フラン買/円売 2020年3月	買建	2,800,000	315,997,405	316,512,000	0.24%
		豪ドル買/円売 2020年3月	買建	2,650,000	193,993,905	190,588,000	0.15%
		米ドル買/円売 2020年3月	買建	59,100,000	6,477,079,470	6,464,358,000	4.94%
		カナダ・ドル買/円売 2020年3月	買建	4,150,000	343,560,580	338,806,000	0.26%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

### (1) 投資状況 (2020年2月28日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		465,162,308	1.63
	内 アメリカ	465,162,308	1.63
投資証券		27,332,073,547	95.72
	内 ガーンジー	59,345,047	0.21
	内 マン島	6,670,759	0.02
	内 韓国	3,841,362	0.01
	内 香港	510,481,273	1.79
	内 シンガポール	1,166,125,001	4.08
	内 イスラエル	19,192,605	0.07
	内 イギリス	1,383,094,952	4.84
	内 アイルランド	32,086,856	0.11
	内 オランダ	57,287,601	0.20
	内 ベルギー	300,460,698	1.05
	内 フランス	839,620,045	2.94

内 ドイツ	71,850,734	0.25
内 スペイン	164,897,630	0.58
内 イタリア	4,181,938	0.01
内 カナダ	611,468,424	2.14
内 アメリカ	20,073,899,744	70.30
内 オーストラリア	1,903,220,322	6.67
内 ニュージーランド	124,348,556	0.44
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	755,965,482	2.65
純資産総額	28,553,201,337	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	765,827,566	2.68
内 ドイツ	261,377,152	0.92
内 アメリカ	504,450,414	1.77
為替予約取引(買建)	611,958,000	2.14
内 日本	611,958,000	2.14

(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 (2020年2月28日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	143,619	10,000.04 1,436,196,647	9,488.67 1,362,754,058	4.77
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	16,600	62,145.84 1,031,622,654	65,383.33 1,085,363,290	3.80
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	59,947	16,449.84 986,123,288	13,766.29 825,248,026	2.89
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	29,400	23,098.70 679,102,773	23,123.65 679,835,407	2.38
5	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	79,400	9,226.80 732,614,809	8,270.71 656,695,120	2.30

6	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証 券	27,400	23,424.03 641,819,972	22,725.32 622,673,990	2.18
7	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証 券	68,400	9,273.42 634,304,320	8,585.87 587,274,042	2.06
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証 券	40,878	13,214.76 540,193,984	13,480.68 551,063,307	1.93
9	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証 券	63,817	8,362.09 533,646,416	7,976.35 509,026,900	1.78
10	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信 託受益 証券	47,500	10,400.66 494,033,444	9,792.89 465,162,308	1.63
11	LINK REIT	香港	投資証 券	424,500	1,123.32 476,857,407	1,039.66 441,336,519	1.55
12	VENTAS INC	アメリカ	投資証 券	72,979	6,365.43 464,548,241	6,019.74 439,314,919	1.54
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証 券	12,967	34,065.99 441,734,118	32,466.78 420,996,823	1.47
14	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証 券	24,000	17,756.33 426,152,374	16,926.63 406,239,178	1.42
15	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証 券	28,200	15,151.67 427,280,159	14,034.39 395,770,010	1.39
16	GOODMAN GROUP	オースト リア	投資証 券	328,950	1,063.05 349,713,168	1,118.66 367,985,510	1.29
17	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証 券	96,900	3,811.77 369,364,113	3,586.02 347,485,445	1.22
18	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	フランス	投資証 券	24,900	17,007.71 423,493,646	13,409.66 333,900,634	1.17
19	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証 券	105,397	3,335.97 351,601,918	3,166.90 333,782,202	1.17
20	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証 券	22,328	14,859.06 331,773,603	14,685.50 327,897,978	1.15
21	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証 券	18,200	17,863.24 325,111,825	17,156.43 312,247,124	1.09
22	WP CAREY INC	アメリカ	投資証 券	33,700	9,093.96 306,466,922	8,834.28 297,715,367	1.04
23	UDR INC	アメリカ	投資証 券	57,400	5,244.10 301,014,463	5,144.30 295,283,067	1.03
24	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証 券	25,400	11,610.30 294,903,892	11,018.50 279,870,070	0.98

25	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,094,270	282.36 309,015,518	255.38 279,462,332	0.98
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	35,700	8,071.66 288,159,064	7,679.79 274,168,767	0.96
27	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	72,000	3,847.33 277,012,853	3,707.48 266,939,165	0.93
28	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	213,010	1,261.80 268,790,166	1,209.31 257,595,698	0.90
29	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	90,300	2,714.08 245,086,103	2,713.86 245,061,919	0.86
30	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	アメリカ	投資証券	101,300	2,276.58 230,619,895	2,351.65 238,222,216	0.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	1.63%
投資証券	95.72%
合計	97.35%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DJ US REIT IDXFTRS 2020年3月	買建	130	528,022,730	504,450,414	1.77%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFTR 2020年3月	買建	230	263,577,865	261,377,152	0.92%

為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2020年3月	買建	3,620,000	396,074,641	395,963,100	1.39%
		香港ドル買/円売 2020年3月	買建	350,000	4,953,760	4,910,500	0.02%
		ユーロ買/円売 2020年3月	買建	1,720,000	206,893,444	206,950,400	0.72%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2020年3月	買建	60,000	4,260,090	4,134,000	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

### ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資状況 (2020年2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	15,206,498,734	95.80
内 タイ	1,550,935,031	9.77
内 マレーシア	997,902,938	6.29
内 フィリピン	26,810,930	0.17
内 インドネシア	1,531,775,983	9.65
内 ポーランド	1,358,546,114	8.56
内 ロシア	1,335,308,484	8.41
内 ハンガリー	550,059,933	3.47
内 ルーマニア	388,999,886	2.45
内 トルコ	474,438,251	2.99
内 チェコ	631,964,208	3.98
内 メキシコ	1,492,635,706	9.40
内 ドミニカ共和国	23,028,286	0.15
内 コロンビア	930,874,903	5.86
内 ペルー	582,474,466	3.67
内 チリ	378,432,434	2.38
内 ブラジル	1,547,758,083	9.75
内 ウルグアイ	22,305,746	0.14
内 南アフリカ	1,382,247,352	8.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	666,790,349	4.20
純資産総額	15,873,289,083	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)	258,058,060	1.63
内 日本	258,058,060	1.63

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

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

(注3) 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 (2020年2月28日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	14,010,000	110.90 378,497,633	111.81 381,609,670	10.000000 2023/01/01	2.40
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	30,050,000	112.86 239,441,292	113.59 240,984,592	10.500000 2026/12/21	1.52
3	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	10,700,000	78.97 205,859,384	83.27 217,065,772	- 2023/07/01	1.37
4	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	7,250,000	116.13 205,101,733	118.32 208,964,952	10.000000 2027/01/01	1.32
5	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	7,390,000	113.90 205,057,243	115.60 208,107,182	10.000000 2025/01/01	1.31
6	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	30,900,000	94.12 205,338,788	94.70 206,602,745	8.000000 2030/01/31	1.30
7	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	30,730,000	110.64 191,086,204	113.07 195,276,556	8.500000 2029/05/31	1.23
8	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,240,000	102.91 178,714,708	105.06 182,455,038	2.500000 2026/07/25	1.15
9	Colombian TES	コロンビア	国債証券	4,550,000,000	121.77 172,866,782	119.75 170,002,778	10.000000 2024/07/24	1.07
10	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	7,200,000	86.26 151,294,893	91.86 161,122,106	- 2022/01/01	1.02

11	Colombian TES	コロンビア	国債証券	4,310,000,000	111.76 150,292,683	111.30 149,672,714	7.500000 2026/08/26	0.94
12	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	23,520,000	90.96 151,049,017	88.21 146,473,763	8.750000 2048/02/28	0.92
13	Colombian TES	コロンビア	国債証券	4,335,000,000	106.12 143,532,127	105.03 142,064,643	7.000000 2022/05/04	0.89
14	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	6,030,000	89.82 131,946,006	94.38 138,648,757	- 2021/07/01	0.87
15	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	23,230,000	101.20 132,129,675	105.50 137,738,215	7.500000 2027/06/03	0.87
16	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	4,450,000	106.02 131,301,480	108.72 134,652,560	2.750000 2029/10/25	0.85
17	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	22,750,000	103.15 131,883,438	105.02 134,279,713	8.000000 2023/12/07	0.85
18	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	6,100,000	84.79 126,007,255	89.15 132,474,819	- 2022/07/01	0.83
19	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	20,350,000	112.38 128,536,194	114.44 130,886,169	10.000000 2024/12/05	0.82
20	Colombian TES	コロンビア	国債証券	4,090,000,000	101.94 130,090,487	101.99 130,158,883	6.000000 2028/04/28	0.82
21	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	29,000,000	118.38 119,134,630	129.15 129,967,670	3.775000 2032/06/25	0.82
22	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	4,200,000	104.22 121,824,433	107.59 125,766,998	2.750000 2028/04/25	0.79
23	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	30,610,000	113.24 120,279,898	116.60 123,855,045	3.850000 2025/12/12	0.78
24	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	21,950,000	98.32 121,293,970	99.90 123,243,042	6.500000 2021/06/10	0.78
25	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	32,900,000	102.72 117,272,677	107.84 123,122,512	2.125000 2026/12/17	0.78
26	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	26,050,000	125.49 113,437,042	133.40 120,590,352	4.875000 2029/06/22	0.76
27	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	4,230,000	100.49 118,300,459	100.45 118,261,238	1.750000 2021/07/25	0.75
28	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	25,100,000	116.75 101,685,775	129.43 112,729,647	3.400000 2036/06/17	0.71
29	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	13,150,000,000	106.17 108,898,569	109.19 112,005,414	8.375000 2024/03/15	0.71
30	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	30,600,000	104.64 111,117,339	105.07 111,566,489	3.650000 2021/12/17	0.70

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	95.80%
合計	95.80%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ルーマニア・レイ買/円 売 2020年3月	買建	880,000	22,179,280	22,035,200	0.14%
		チェコ・コルナ買/円売 2020年3月	買建	5,840,000	27,902,546	27,681,600	0.17%
		ハンガリー・フォリント 買/円売 2020年3月	買建	48,880,000	17,410,839	17,327,960	0.11%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2020年3月	買建	2,640,000	19,182,416	18,612,000	0.12%
		ポーランド・ズロチ買/ 円売 2020年3月	買建	2,280,000	63,730,138	63,429,600	0.40%
		タイ・バーツ買/円売 2020年3月	買建	4,950,000	17,170,065	17,176,500	0.11%
		トルコ・リラ買/円売 2020年3月	買建	2,190,000	39,395,873	38,500,200	0.24%
		メキシコ・ペソ買/円売 2020年3月	買建	9,500,000	54,867,830	53,295,000	0.34%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（2020年2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	197,052,087,030	98.15
内 ユーロ	72,607,070,761	36.17
内 シンガポール	784,046,395	0.39
内 マレーシア	932,158,131	0.46
内 ノルウェー	403,374,931	0.20
内 スウェーデン	536,240,772	0.27
内 デンマーク	973,110,903	0.48
内 イギリス	12,619,247,858	6.29
内 ポーランド	1,107,922,770	0.55
内 カナダ	3,705,415,414	1.85
内 アメリカ	96,916,081,909	48.27
内 メキシコ	1,698,102,692	0.85
内 南アフリカ	1,049,070,262	0.52
内 オーストラリア	3,720,244,232	1.85
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,708,107,152	1.85
純資産総額	200,760,194,182	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)	2,047,327,370	1.02
内 日本	2,047,327,370	1.02

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

(注2) 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（2020年2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	8,800,000	101.61 978,572,303	103.67 998,412,181	2.000000 2024/05/31	0.50
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,300,000	111.23 888,580,573	115.27 920,845,680	3.125000 2028/11/15	0.46
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,168,000	100.04 894,199,646	101.41 906,427,161	1.625000 2022/11/15	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,907,000	100.76 871,916,882	101.21 875,732,692	2.250000 2021/04/30	0.44
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,550,000	102.04 843,100,480	104.06 859,756,601	2.125000 2024/03/31	0.43
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	108.99 799,108,635	112.94 828,091,280	2.875000 2028/08/15	0.41
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	105.16 794,058,659	109.42 826,262,267	2.375000 2029/05/15	0.41
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,150,000	99.93 781,891,340	104.08 814,386,540	1.750000 2029/11/15	0.41
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	107.23 774,484,696	111.38 804,443,129	2.625000 2029/02/15	0.40
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	108.81 773,974,315	112.64 801,259,591	2.875000 2028/05/15	0.40
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,029,000	99.50 765,391,395	102.58 789,066,862	1.625000 2026/05/15	0.39
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	98.53 744,035,471	102.94 777,303,723	1.625000 2029/08/15	0.39
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	107.65 742,190,153	111.43 768,256,707	2.750000 2028/02/15	0.38
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	101.83 724,347,263	105.09 747,521,254	2.000000 2026/11/15	0.37
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,284,000	182.31 720,398,611	188.19 743,596,803	4.500000 2041/04/25	0.37
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,140,000	103.96 698,550,081	106.92 718,402,412	2.250000 2027/02/15	0.36
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,366,000	99.67 694,352,020	102.57 714,590,536	1.625000 2026/02/15	0.36
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,800,000	125.03 656,742,831	135.92 713,944,081	3.375000 2048/11/15	0.36
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	103.32 696,748,618	105.49 711,340,636	2.375000 2024/08/15	0.35
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	101.11 695,671,218	102.44 704,807,677	2.000000 2022/11/30	0.35

21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	103.71 669,641,783	107.30 692,794,326	2.250000 2027/08/15	0.35
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,900,000	117.10 627,933,503	127.53 683,873,045	3.000000 2049/02/15	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	102.85 666,407,657	105.19 681,595,254	2.250000 2024/11/15	0.34
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	103.11 658,991,049	105.96 677,210,969	2.250000 2025/11/15	0.34
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	104.53 652,063,057	107.98 673,551,279	2.375000 2027/05/15	0.34
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	102.32 648,125,945	105.00 665,049,882	2.125000 2025/05/15	0.33
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,850,000	114.37 607,028,728	124.86 662,713,496	2.875000 2049/05/15	0.33
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	101.75 639,498,470	104.47 656,586,202	2.000000 2025/08/15	0.33
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	101.71 639,253,372	104.22 655,015,061	2.000000 2025/02/15	0.33
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	103.78 624,621,515	107.46 646,812,278	2.250000 2027/11/15	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。

#### □．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	98.15%
合計	98.15%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
----	----	-----	-----------	----	----	----	----------

為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2020年4月	買建	90,000	6,447,051	6,466,500	0.00%
		豪ドル買/円売 2020年3月	買建	105,000	7,586,880	7,552,650	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2020年3月	買建	101,000	8,352,700	8,247,660	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2020年4月	買建	62,000	5,044,989	5,053,620	0.00%
		ユーロ買/円売 2020年3月	買建	1,366,000	164,204,128	164,357,120	0.08%
		ユーロ買/円売 2020年4月	買建	7,085,000	851,324,956	852,538,050	0.42%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2020年4月	買建	5,800,000	40,616,240	40,658,000	0.02%
		英ポンド買/円売 2020年 3月	買建	182,000	25,926,628	25,678,380	0.01%
		メキシコ・ペソ買/円売 2020年4月	買建	1,343,000	7,485,019	7,480,510	0.00%
		ノルウェー・クローネ 買/円売 2020年4月	買建	3,420,000	39,580,891	39,740,400	0.02%
		ポーランド・ズロチ買/ 円売 2020年4月	買建	987,000	27,364,604	27,408,990	0.01%
		米ドル買/円売 2020年3 月	買建	1,989,000	219,378,744	217,616,490	0.11%
		米ドル買/円売 2020年4 月	買建	5,434,000	592,982,261	593,501,480	0.30%
英ポンド買/円売 2020年 4月	買建	362,000	50,969,672	51,027,520	0.03%		

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●iFree 8資産バランス

2020年2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	12,203円
純資産総額	194億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-4.7%
3カ月間	-3.8%
6カ月間	2.9%
1年間	3.1%
3年間	12.0%
5年間	-
設定来	22.0%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年9月	第2期 18年9月	第3期 19年9月						
分配金	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を分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

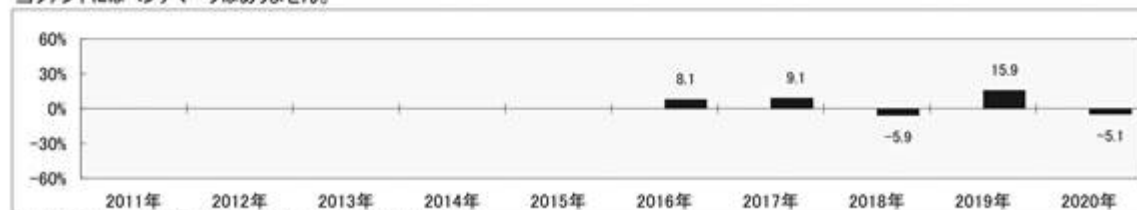
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国債券INDEXMF	13.3%	外国債券	930	25.3%	日本円	38.2%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	1.3%
日本債券インデックスMF(BPI)	13.3%	外国株式・先物	1,607	22.2%	米ドル	26.4%	日本ビルファンド	日本	0.9%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	12.8%	国内債券	276	13.2%	ユーロ	7.0%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.8%
ダイワ新興国株式 F-INDEX・MF	12.1%	外国リート・先物	314	12.1%	香港ドル	3.7%	S&P500 EMINI FUT 202003	アメリカ	0.7%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	12.0%	国内リート・先物	65	11.9%	ブラジル・レアル	2.6%	野村不動産マスターF	日本	0.6%
ダイワJ-REIT MF	11.9%	国内株式・先物	2,125	11.8%	英ポンド	2.1%	PROLOGIS INC	アメリカ	0.6%
トピックス・インデックス・MF	11.8%	外国投資信託等	10	1.5%	南アフリカ・ランド	1.9%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAG	台湾	0.5%
外国株式INDEXMF	11.7%				メキシコ・ペソ	1.8%	日本プロロジスリート	日本	0.5%
					台湾ドル	1.6%	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	0.5%
		コール・ローン、その他		4.0%	その他	14.8%	EQUINIX INC	アメリカ	0.5%
合計	98.9%	合計	5,327	-	合計	100.0%	合計		6.8%

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2016年は設定日(9月8日)から年末、2020年は2月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

### 2 【換金(解約)手続等】

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

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

#### <一部解約>

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

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

#### ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

#### ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・わが国および外国の公社債：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
  2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
  3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <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9月8日から翌年9月7日までとします。

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

#### (5) 【その他】

信託の終了

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

信託約款の変更等

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

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

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

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書)を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知っている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
  - ・委託会社のホームページ  
アドレス <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。)を持分にに応じて請求する権利を有します。

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

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

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

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

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2018年9月8日から2019年9月9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】

iFree 8資産バランス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年9月7日現在	第3期 2019年9月9日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	2,991,483	8,805,078
コール・ローン	120,823,062	178,639,108
親投資信託受益証券	9,152,937,456	15,480,377,432
流動資産合計	9,276,752,001	15,667,821,618
資産合計	9,276,752,001	15,667,821,618
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	19,650,628	17,290,452
未払受託者報酬	861,881	1,514,307
未払委託者報酬	8,619,273	15,143,408
その他未払費用	323,574	578,293
流動負債合計	29,455,356	34,526,460
負債合計	29,455,356	34,526,460
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 8,081,201,558	1 12,911,568,998
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,166,095,087	2,721,726,160
（分配準備積立金）	91,031,169	740,647,513
元本等合計	9,247,296,645	15,633,295,158
純資産合計	9,247,296,645	15,633,295,158
負債純資産合計	9,276,752,001	15,667,821,618



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	2017年9月8日 至 2018年9月7日	自	2018年9月8日 至 2019年9月9日
営業収益				
受取利息		6		16
有価証券売買等損益		67,962,000		757,199,976
その他収益		-		9,082
営業収益合計		67,962,006		757,209,074
営業費用				
支払利息		52,972		102,587
受託者報酬		1,462,529		2,667,535
委託者報酬		14,655,830		26,676,147
その他費用		555,749		1,017,619
営業費用合計		16,727,080		30,463,888
営業利益		51,234,926		726,745,186
経常利益		51,234,926		726,745,186
当期純利益		51,234,926		726,745,186
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		46,902,967		60,735,806
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		468,284,085		1,166,095,087
剰余金増加額又は欠損金減少額		934,829,745		1,197,729,439
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		934,829,745		1,197,729,439
剰余金減少額又は欠損金増加額		241,350,702		308,107,746
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		241,350,702		308,107,746
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,166,095,087		2,721,726,160

## (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3期	
	自 2018年9月8日	至 2019年9月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年9月7日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年9月9日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1. 1 期首元本額	3,955,280,178円	8,081,201,558円
期中追加設定元本額	5,936,562,291円	6,888,328,647円
期中一部解約元本額	1,810,640,911円	2,057,961,207円
2. 計算期間末日における受益権の総数	8,081,201,558口	12,911,568,998口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期		第3期	
	自	至	自	至
	2017年9月8日	2018年9月7日	2018年9月8日	2019年9月9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(4,368,334円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,075,111,392円)及び分配準備積立金(86,662,835円)より分配対象額は1,166,142,561円(1万口当たり1,443.03円)であり、分配を行っておりません。</p>	<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(666,056,012円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,981,164,177円)及び分配準備積立金(74,591,501円)より分配対象額は2,721,811,690円(1万口当たり2,108.04円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年9月8日 至 2019年9月9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、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	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期 2019年9月9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2期 2018年9月7日現在	第3期 2019年9月9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	60,796,121	743,617,482
合計	60,796,121	743,617,482

## (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2期 2018年9月7日現在	第3期 2019年9月9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3期 自 2018年9月8日 至 2019年9月9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2期 2018年9月7日現在	第3期 2019年9月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1443円 (11,443円)	1.2108円 (12,108円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	1,317,325,324	1,963,868,593	
	ダイワ新興国債券インデックス・マ ザーファンド	1,410,629,846	1,929,318,440	
	トピックス・インデックス・マザー ファンド	1,947,225,962	1,945,084,013	
	外国株式インデックスマザーファンド	767,747,981	1,944,552,086	
	外国債券インデックスマザーファンド	669,429,376	1,900,643,884	
	ダイワJ-REITマザーファンド	609,288,680	1,985,001,590	
	ダイワ・グローバルREITインデッ クス・マザーファンド	784,640,527	1,930,843,408	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	1,420,958,920	1,881,065,418	
親投資信託受益証券 合計			15,480,377,432	
合計			15,480,377,432	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	223,401,778	920,724,520
コール・ローン	9,022,977,824	18,679,834,936
株式 3 4	139,864,958,440	143,418,368,822
派生商品評価勘定	301,760	35,009,360
未収入金	683,520	-
未収配当金	71,488,355	73,411,423
未収利息	806,491	2,053,379
前払金	42,100,000	-
その他未収収益 5	5,810,811	15,104,823
流動資産合計	149,232,528,979	163,144,507,263
資産合計	149,232,528,979	163,144,507,263
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,660,640	1,687,560
前受金	-	20,970,000
未払金	698,389,362	453,240
未払解約金	54,554,300	85,204,320

受入担保金		7,376,155,919	18,345,738,651
その他未払費用		35,039	-
流動負債合計		8,152,795,260	18,454,053,771
負債合計		8,152,795,260	18,454,053,771
純資産の部			
元本等			
元本	1	133,142,800,795	144,845,005,615
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	7,936,932,924	154,552,123
元本等合計		141,079,733,719	144,690,453,492
純資産合計		141,079,733,719	144,690,453,492
負債純資産合計		149,232,528,979	163,144,507,263

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年9月8日 至 2019年9月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1. 1 期首	2017年9月8日	2018年9月8日
期首元本額	133,145,475,897円	133,142,800,795円
期中追加設定元本額	17,186,580,603円	24,777,146,793円
期中一部解約元本額	17,189,255,705円	13,074,941,973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	4,245,628,279円	3,981,452,767円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	9,359,879,940円	7,641,426,702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	55,756,555円	8,942,503円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	72,184,941円	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)	1,120,195,925円	916,911,182円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	59,077,590円	49,098,482円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	1,527,462,202円	1,292,228,501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	31,360,033円
D-I's TOPIXイン デックス	28,183,767円	40,960,686円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	21,998,547円	19,815,592円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	675,429円	3,797,856円
iFree TOPIXイン デックス	645,665,905円	1,268,101,330円
iFree 8資産バランス	1,069,562,722円	1,947,225,962円
iFree 年金バランス	3,937,772円	56,205,644円
DCダイワ日本株式インデッ クス	64,280,342,277円	66,167,265,247円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,467,642,627円	2,958,171,733円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,732,367,900円	3,319,476,310円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,662,328,093円	3,065,450,046円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,477,138,807円	4,884,951,746円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	15,088,706円	14,890,058円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	49,393,510円	54,597,360円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	15,685,699円	21,081,691円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	936,142円	188,769,158円
ダイワつみたてインデックス バランス30	- 円	198,705円

ダイワつみたてインデックス バランス50	- 円	300,351円
ダイワつみたてインデックス バランス70	- 円	479,367円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	334,996円	- 円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	343,410円	- 円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	684,622円	- 円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	4,016,770円	- 円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	8,266,286円	- 円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	9,446,810円	- 円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	210,484,127円	168,466,009円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	166,035,147円	172,376,788円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,876,268,731円	9,412,289,074円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	22,729,071円	- 円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	25,269,263円	3,092,274円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	856,720,435円	832,285,188円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	129,305,829円	127,742,510円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	223,180,217円	223,926,223円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	123,650,057円	171,710,495円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	8,208,650,119円	9,672,817,615円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	225,913,379円	7,600,163,548円

	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	1,838,368,259円	2,571,694,149円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,384,836,660円	1,434,474,057円
	ダイワライフスタイル25	178,510,387円	195,535,287円
	ダイワライフスタイル50	632,015,638円	684,411,989円
	ダイワライフスタイル75	539,009,109円	560,900,654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)	13,567,628,138円	13,019,214,082円
	計	133,142,800,795円	144,845,005,615円
2.	期末日における受益権の総数	133,142,800,795口	144,845,005,615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154,552,123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 6,921,220,300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 17,639,775,940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 659,600,000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 518,600,000円
6.	5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分3,819,373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11,253,905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 2018年9月8日 至 2019年9月9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	2019年9月9日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	2018年9月7日現在	2019年9月9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	777,795,821	18,853,215,056
合計	777,795,821	18,853,215,056

(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(2017年9月20日から2018年9月7日まで、及び2018年9月20日から2019年9月9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	2018年9月7日 現在				2019年9月9日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株値指数								
先物取引								
買 建	1,239,760,000	-	1,216,440,000	23,320,000	1,209,035,000	-	1,242,400,000	33,365,000
合計	1,239,760,000	-	1,216,440,000	23,320,000	1,209,035,000	-	1,242,400,000	33,365,000

(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)

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1口当たり純資産額	1.0596円	0.9989円
(1万口当たり純資産額)	(10,596円)	(9,989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	2,900	2,815.00	8,163,500	貸付株式数 1,100株
日本水産	87,700	611.00	53,584,700	
マルハニチロ	12,600	2,703.00	34,057,800	
ハウスイ	500	793.00	396,500	貸付株式数 200株
カネコ種苗	2,600	1,140.00	2,964,000	
サカタのタネ	10,500	3,750.00	39,375,000	貸付株式数 4,100株
ホクト	7,300	1,911.00	13,950,300	貸付株式数 2,300株
ホクリヨウ	1,100	600.00	660,000	貸付株式数 300株
ヒノキヤグループ	2,400	1,851.00	4,442,400	貸付株式数 700株 (200株)
ショーボンドHD	12,500	3,740.00	46,750,000	貸付株式数 4,900株 (3,200株)
ミライト・ホールディングス	24,500	1,591.00	38,979,500	貸付株式数 9,700株 (5,200株)
タマホーム	4,400	1,479.00	6,507,600	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	1,400	634.00	887,600	
日本アクア	3,600	627.00	2,257,200	貸付株式数 1,300株
ファーストコーポレーション	2,600	584.00	1,518,400	貸付株式数 900株
ベステラ	1,600	1,233.00	1,972,800	
スペースバリューHD	10,500	465.00	4,882,500	貸付株式数 400株
住石ホールディングス	18,700	132.00	2,468,400	貸付株式数 7,100株
日鉄鉱業	2,000	4,000.00	8,000,000	
三井松島HLDGS	3,600	1,208.00	4,348,800	
国際石油開発帝石	352,100	910.80	320,692,680	
石油資源開発	12,600	2,640.00	33,264,000	貸付株式数 4,300株
K&Oエナジーグループ	4,200	1,334.00	5,602,800	
ダイセキ環境ソリューション	1,600	662.00	1,059,200	
第一カッター興業	1,100	1,588.00	1,746,800	貸付株式数 400株
安藤・間	56,100	708.00	39,718,800	
東急建設	25,600	754.00	19,302,400	
コムシスホールディングス	31,000	2,942.00	91,202,000	
ミサワホーム	6,900	1,076.00	7,424,400	

ビーアールホールディングス	9,400	358.00	3,365,200	貸付株式数	3,700株
高松コンストラクシヨンG P	5,400	2,333.00	12,598,200	貸付株式数	1,100株
東建コーポレーション	2,700	6,400.00	17,280,000	貸付株式数	1,000株
ソネック	800	873.00	698,400	貸付株式数	300株
ヤマウラ	3,300	851.00	2,808,300		
大成建設	72,000	3,900.00	280,800,000		
大林組	217,000	1,015.00	220,255,000		
清水建設	221,200	923.00	204,167,600	貸付株式数	28,400株
飛島建設	6,300	1,141.00	7,188,300	貸付株式数	800株
長谷工コーポレーション	90,700	1,170.00	106,119,000	貸付株式数	500株
松井建設	8,100	689.00	5,580,900	貸付株式数	2,800株
銭高組	900	3,940.00	3,546,000		
鹿島建設	169,600	1,334.00	226,246,400	貸付株式数	19,200株
不動テトラ	5,000	1,135.00	5,675,000		
大末建設	2,700	930.00	2,511,000		
鉄建建設	4,400	2,615.00	11,506,000	貸付株式数	1,700株
西松建設	15,500	1,888.00	29,264,000		
三井住友建設	52,300	536.00	28,032,800	貸付株式数	20,600株
大豊建設	4,900	2,665.00	13,058,500		
前田建設	51,100	876.00	44,763,600	貸付株式数	20,300株
佐田建設	5,000	387.00	1,935,000	貸付株式数	400株
ナカノフドー建設	5,600	435.00	2,436,000	貸付株式数	700株
奥村組	11,900	2,803.00	33,355,700		
東鉄工業	8,600	3,095.00	26,617,000	貸付株式数	2,800株
イチケン	1,300	1,620.00	2,106,000		
富士ピー・エス	2,900	485.00	1,406,500	貸付株式数	400株
浅沼組	2,400	3,515.00	8,436,000	貸付株式数	200株
戸田建設	83,700	583.00	48,797,100	貸付株式数	33,200株
熊谷組	10,300	2,984.00	30,735,200		
青木あすなろ建設	3,600	1,209.00	4,352,400	貸付株式数	1,300株
北野建設	1,500	2,325.00	3,487,500		
植木組	900	2,367.00	2,130,300	貸付株式数	300株
矢作建設	9,700	676.00	6,557,200	貸付株式数	3,800株
ピーエス三菱	7,500	675.00	5,062,500	貸付株式数	2,300株
日本ハウスHLDGS	13,900	472.00	6,560,800		
大東建託	25,800	13,915.00	359,007,000	貸付株式数	4,300株
新日本建設	8,600	745.00	6,407,000	貸付株式数	2,200株
NIPPO	19,200	1,877.00	36,038,400	貸付株式数	1,300株

東亜道路	1,300	3,260.00	4,238,000		
前田道路	22,300	2,435.00	54,300,500	貸付株式数	7,600株
日本道路	2,000	6,130.00	12,260,000		
東亜建設	6,200	1,289.00	7,991,800	貸付株式数	1,100株
日本国土開発	11,600	544.00	6,310,400	貸付株式数	4,400株
若築建設	3,600	1,500.00	5,400,000		
東洋建設	26,600	430.00	11,438,000	貸付株式数	9,400株
五洋建設	85,800	567.00	48,648,600	貸付株式数	34,000株
世紀東急	10,500	677.00	7,108,500	貸付株式数	1,200株
福田組	2,400	3,815.00	9,156,000	貸付株式数	600株
日本ドライケミカル	1,700	1,110.00	1,887,000	貸付株式数	600株
住友林業	51,400	1,336.00	68,670,400	貸付株式数	2,000株
日本基礎技術	7,300	319.00	2,328,700	貸付株式数	1,500株
巴コーポレーション	9,200	418.00	3,845,600	貸付株式数	3,300株
大和ハウス	200,400	3,440.00	689,376,000		
ライト工業	13,900	1,378.00	19,154,200		
積水ハウス	221,600	1,999.00	442,978,400	貸付株式数	87,700株
日特建設	6,000	625.00	3,750,000		
北陸電気工事	3,400	858.00	2,917,200	貸付株式数	1,000株
ユアテック	11,500	645.00	7,417,500	貸付株式数	4,000株
四電工	1,100	2,707.00	2,977,700	貸付株式数	200株
中電工	9,200	2,256.00	20,755,200		
関電工	32,800	914.00	29,979,200		
きんでん	48,100	1,557.00	74,891,700	貸付株式数	1,100株
東京エネシス	7,400	882.00	6,526,800	貸付株式数	2,400株
トーエネック	2,000	3,145.00	6,290,000	貸付株式数	600株
住友電設	4,900	1,962.00	9,613,800		
日本電設工業	12,300	2,123.00	26,112,900	貸付株式数	4,800株
協和エクシオ	28,300	2,591.00	73,325,300		
新日本空調	5,800	1,744.00	10,115,200	貸付株式数	2,300株
日本工営	4,200	2,772.00	11,642,400	貸付株式数	1,100株
九電工	14,200	3,310.00	47,002,000		
三機工業	16,200	1,244.00	20,152,800	貸付株式数	6,000株
日揮	62,300	1,293.00	80,553,900	貸付株式数	24,600株
中外炉工業	2,000	1,438.00	2,876,000	貸付株式数	700株
ヤマト	6,500	660.00	4,290,000	貸付株式数	2,500株
太平電業	4,900	2,409.00	11,804,100	貸付株式数	400株
高砂熱学	17,500	1,723.00	30,152,500		
三晃金属	900	2,299.00	2,069,100		
NEC ネットエスアイ	7,000	2,824.00	19,768,000		



朝日工業社	1,500	2,857.00	4,285,500	貸付株式数	200株
明星工業	13,100	710.00	9,301,000	貸付株式数	2,700株
大 気 社	9,800	3,140.00	30,772,000	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ダイダン	4,900	1,989.00	9,746,100	貸付株式数	900株
日比谷総合設備	6,500	1,867.00	12,135,500	貸付株式数	2,000株
東芝プラントシステム	15,600	1,733.00	27,034,800		
日本製粉	20,400	1,664.00	33,945,600	貸付株式数	5,000株
日清製粉G本社	73,000	1,979.00	144,467,000		
日東富士製粉	500	6,380.00	3,190,000		
昭和産業	5,900	3,090.00	18,231,000	貸付株式数	2,300株
鳥越製粉	5,700	821.00	4,679,700		
中部飼料	7,900	1,132.00	8,942,800	貸付株式数	1,600株
フィード・ワン	43,500	156.00	6,786,000		
東洋精糖	900	1,032.00	928,800	貸付株式数	300株
日本甜菜糖	3,600	1,781.00	6,411,600	貸付株式数	1,400株
三井製糖	5,000	2,231.00	11,155,000		
塩水港精糖	6,600	205.00	1,353,000		
日新製糖	3,100	1,933.00	5,992,300		
L I F U L L	21,200	656.00	13,907,200		
ジェイエイシーリクルート メント	4,700	1,977.00	9,291,900	貸付株式数	1,800株
日本M & Aセンター	46,600	3,180.00	148,188,000		
メンバーズ	2,000	1,883.00	3,766,000	貸付株式数	800株
中広	500	600.00	300,000	貸付株式数	200株
アイティメディア	1,100	677.00	744,700		
タケエイ	6,300	948.00	5,972,400	貸付株式数	400株
E・Jホールディングス	700	1,227.00	858,900	貸付株式数	100株
トラスト・テック	6,800	1,212.00	8,241,600		
コシダカホールディングス	14,800	1,678.00	24,834,400	貸付株式数	6,000株
アルトナー	1,400	763.00	1,068,200	貸付株式数	200株
パソナグループ	7,500	1,514.00	11,355,000	貸付株式数	2,800株
C D S	1,500	1,310.00	1,965,000		
リンクアンドモチベーショ ン	13,300	605.00	8,046,500	貸付株式数	5,100株
G C A	7,200	716.00	5,155,200	貸付株式数	2,700株
エス・エム・エス	22,700	2,628.00	59,655,600		
サニーサイドアップ	1,400	969.00	1,356,600		
パーソルホールディングス	61,800	2,107.00	130,212,600	貸付株式数	22,800株

リニカル	3,400	1,022.00	3,474,800	貸付株式数	1,300株 (600株)
クックパッド	19,100	292.00	5,577,200	貸付株式数	5,900株
エスクリ	1,600	846.00	1,353,600	貸付株式数	600株
アイ・ケイ・ケイ	2,900	690.00	2,001,000	貸付株式数	1,100株
森永製菓	16,300	5,210.00	84,923,000	貸付株式数	6,200株
中村屋	1,600	4,195.00	6,712,000	貸付株式数	500株
江崎グリコ	19,400	4,670.00	90,598,000	貸付株式数	5,900株
名糖産業	3,100	1,269.00	3,933,900	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	2,700	2,089.00	5,640,300	貸付株式数	1,000株
不二家	3,600	1,975.00	7,110,000		
山崎製パン	50,500	1,850.00	93,425,000	貸付株式数	19,200株
第一屋製パン	1,100	920.00	1,012,000	貸付株式数	100株
モロゾフ	1,100	4,650.00	5,115,000	貸付株式数	100株
亀田製菓	4,000	4,710.00	18,840,000		
寿スピリッツ	6,900	6,720.00	46,368,000	貸付株式数	100株
カルビー	29,400	3,265.00	95,991,000	貸付株式数	11,200株
森永乳業	13,000	4,470.00	58,110,000	貸付株式数	5,100株
六甲バター	4,500	1,634.00	7,353,000		
ヤクルト	48,000	6,000.00	288,000,000		
明治ホールディングス	45,900	7,520.00	345,168,000		
雪印メグミルク	15,500	2,444.00	37,882,000	貸付株式数	6,100株
プリマハム	9,000	2,161.00	19,449,000	貸付株式数	3,600株
日本ハム	26,700	4,155.00	110,938,500		
林兼産業	2,000	563.00	1,126,000		
丸大食品	6,800	2,161.00	14,694,800	貸付株式数	2,700株
S Foods	5,800	3,015.00	17,487,000	貸付株式数	300株
伊藤ハム米久HLDGS	41,400	641.00	26,537,400	貸付株式数	1,100株
学情	2,400	1,227.00	2,944,800	貸付株式数	900株 (900株)
スタジオアリス	3,100	1,908.00	5,914,800	貸付株式数	500株
クロスキャット	1,600	1,012.00	1,619,200	貸付株式数	600株
シミックホールディングス	3,400	1,668.00	5,671,200	貸付株式数	1,100株
システナ	22,400	1,527.00	34,204,800	貸付株式数	4,700株
NJS	1,300	1,585.00	2,060,500		
デジタルアーツ	3,400	7,670.00	26,078,000	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
日鉄ソリューションズ	9,400	3,670.00	34,498,000		
総合警備保障	24,600	5,420.00	133,332,000		
キューブシステム	3,300	769.00	2,537,700	貸付株式数	1,300株

いちご	80,700	447.00	36,072,900	貸付株式数	31,900株
エイジア	1,200	1,238.00	1,485,600	貸付株式数	400株
日本駐車場開発	71,300	175.00	12,477,500	貸付株式数	5,400株
コア	2,600	1,326.00	3,447,600	貸付株式数	100株
カカクコム	45,900	2,582.00	118,513,800		
アイロムグループ	2,300	1,670.00	3,841,000	貸付株式数	900株
セントケア・ホールディング	4,400	515.00	2,266,000	貸付株式数	1,700株
サイネックス	900	632.00	568,800	貸付株式数	200株
ルネサンス	3,400	1,583.00	5,382,200	貸付株式数	1,200株
ディップ	9,800	2,546.00	24,950,800	貸付株式数	3,900株
SBSホールディングス	6,100	1,529.00	9,326,900		
オプトホールディング	3,700	1,529.00	5,657,300	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
新日本科学	8,300	699.00	5,801,700	貸付株式数	2,900株
ツクイ	14,300	437.00	6,249,100	貸付株式数	5,300株
キャリアデザインセンター	1,500	1,301.00	1,951,500	貸付株式数	100株
ベネフィット・ワン	17,000	1,846.00	31,382,000	貸付株式数	100株
エムスリー	129,600	2,463.00	319,204,800	貸付株式数	51,800株
ツカダ・グローバルHOLD	3,800	575.00	2,185,000	貸付株式数	1,300株
プラス	600	617.00	370,200	貸付株式数	200株
アウトソーシング	35,200	994.00	34,988,800	貸付株式数	13,000株
ウェルネット	5,800	713.00	4,135,400	貸付株式数	1,600株
ワールドホールディングス	1,900	1,551.00	2,946,900	貸付株式数	600株
ディー・エヌ・エー	32,800	2,030.00	66,584,000	貸付株式数	13,000株
博報堂DYHLDGS	86,000	1,585.00	136,310,000		
ぐるなび	8,600	701.00	6,028,600		
タカミヤ	6,300	647.00	4,076,100	貸付株式数	2,500株
ジャパンベストレスキュー	4,400	1,156.00	5,086,400	貸付株式数	1,600株
ファンコミュニケーションズ	16,800	548.00	9,206,400	貸付株式数	500株
ライク	2,400	1,918.00	4,603,200	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	2,500	360.00	900,000	貸付株式数	1,000株
エスプール	2,400	3,100.00	7,440,000		
WDBホールディングス	2,800	2,545.00	7,126,000		
ティア	3,500	623.00	2,180,500	貸付株式数	1,400株
CDG	500	1,424.00	712,000	貸付株式数	200株 (200株)

バリューコマース	3,900	1,721.00	6,711,900	貸付株式数	1,500株 (1,300株)
インフォマート	33,500	1,631.00	54,638,500	貸付株式数	12,600株
サッポロホールディングス	22,500	2,533.00	56,992,500	貸付株式数	9,000株
アサヒグループホールディングン	135,700	5,135.00	696,819,500	貸付株式数	53,700株
キリンHD	275,000	2,101.50	577,912,500	貸付株式数	109,700株
宝ホールディングス	48,400	1,045.00	50,578,000	貸付株式数	600株
オエノンホールディングス	18,100	373.00	6,751,300	貸付株式数	6,700株
養命酒	1,900	1,898.00	3,606,200	貸付株式数	700株
コカ・コーラボトラーズJHD	47,200	2,358.00	111,297,600	貸付株式数	18,800株
サントリー食品インター	43,300	4,770.00	206,541,000	貸付株式数	17,100株
ダイドーグループHD	3,600	4,315.00	15,534,000	貸付株式数	1,400株
伊藤園	19,600	4,985.00	97,706,000	貸付株式数	7,700株
キーコーヒー	6,300	2,154.00	13,570,200	貸付株式数	2,500株
ユニカフェ	1,800	981.00	1,765,800		
ジャパンフーズ	900	1,193.00	1,073,700		
日清オイリオグループ	8,300	3,345.00	27,763,500	貸付株式数	1,100株
不二製油グループ	15,800	2,947.00	46,562,600	貸付株式数	6,200株
かどや製油	700	3,575.00	2,502,500		
J-オイルミルズ	3,300	4,045.00	13,348,500	貸付株式数	1,200株
ローソン	16,000	5,430.00	86,880,000	貸付株式数	6,300株
サンエー	4,800	4,565.00	21,912,000	貸付株式数	100株
カワチ薬品	5,000	1,995.00	9,975,000	貸付株式数	1,800株
エービーシー・マート	9,900	6,830.00	67,617,000	貸付株式数	3,900株
ハードオフコーポレーション	2,400	708.00	1,699,200	貸付株式数	900株
高千穂交易	2,400	1,071.00	2,570,400	貸付株式数	800株
アスクル	6,600	3,045.00	20,097,000	貸付株式数	2,500株
ゲオホールディングス	9,700	1,320.00	12,804,000	貸付株式数	3,800株
アダストリア	8,800	2,276.00	20,028,800	貸付株式数	3,400株
ジーフット	3,900	615.00	2,398,500	貸付株式数	300株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	676.00	540,800	貸付株式数	300株
伊藤忠食品	1,500	4,180.00	6,270,000		
くら寿司	3,500	4,335.00	15,172,500	貸付株式数	1,400株
キャンドゥ	3,100	1,620.00	5,022,000	貸付株式数	1,000株 (600株)
エレマテック	5,900	974.00	5,746,600	貸付株式数	1,800株

パルグループHLDGS	3,300	3,340.00	11,022,000	貸付株式数	100株
JALUX	1,800	2,291.00	4,123,800	貸付株式数	700株
エディオン	27,000	1,027.00	27,729,000	貸付株式数	6,700株
あらた	4,700	3,715.00	17,460,500	貸付株式数	1,800株
サーラコーポレーション	13,100	596.00	7,807,600	貸付株式数	1,900株
ワッツ	2,800	620.00	1,736,000	貸付株式数	800株 (400株)
トーメンデバイス	1,000	2,320.00	2,320,000	貸付株式数	300株
ハローズ	2,400	2,100.00	5,040,000	貸付株式数	100株
J Pホールディングス	17,300	275.00	4,757,500	貸付株式数	300株
フジオフードシステム	2,700	2,746.00	7,414,200	貸付株式数	900株
あみやき亭	1,300	3,380.00	4,394,000		
東京エレクトロデバイス	2,400	2,035.00	4,884,000		
ひらまつ	12,500	345.00	4,312,500	貸付株式数	4,900株
フィールズ	5,500	491.00	2,700,500		
双日	351,700	339.00	119,226,300		
アルフレッサホールディングス	70,600	2,449.00	172,899,400		
大黒天物産	1,500	3,225.00	4,837,500		
ハニーズホールディングス	5,600	1,450.00	8,120,000	貸付株式数	2,200株 (2,100株)
ファーマライズHD	1,400	558.00	781,200	貸付株式数	500株 (500株)
キッコーマン	42,700	4,885.00	208,589,500		
味の素	142,900	1,929.00	275,654,100	貸付株式数	20,800株
キューピー	36,000	2,533.00	91,188,000	貸付株式数	14,200株
ハウス食品G本社	24,200	4,070.00	98,494,000	貸付株式数	5,000株
カゴメ	25,700	2,749.00	70,649,300	貸付株式数	10,200株
焼津水産化工	3,100	1,042.00	3,230,200		
アリアケジャパン	5,900	8,370.00	49,383,000	貸付株式数	1,700株
ピエトロ	800	1,605.00	1,284,000	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,500	2,025.00	3,037,500		
やまみ	300	1,987.00	596,100		
ニチレイ	33,600	2,390.00	80,304,000		
横浜冷凍	17,700	1,029.00	18,213,300	貸付株式数	7,000株
東洋水産	33,300	4,405.00	146,686,500	貸付株式数	9,400株
イートアンド	2,200	1,716.00	3,775,200	貸付株式数	800株
大冷	700	2,050.00	1,435,000	貸付株式数	200株
ヨシムラ・フード・HLDGS	1,700	823.00	1,399,100	貸付株式数	600株

日清食品HD	27,500	7,570.00	208,175,000	貸付株式数	10,300株
永谷園ホールディングス	3,400	2,070.00	7,038,000	貸付株式数	1,100株
一正蒲鉾	2,500	1,082.00	2,705,000	貸付株式数	900株 (800株)
フジッコ	6,900	1,914.00	13,206,600	貸付株式数	2,500株
ロックフィールド	6,900	1,361.00	9,390,900	貸付株式数	2,700株
日本たばこ産業	374,300	2,239.50	838,244,850	貸付株式数	148,100株
ケンコーマヨネーズ	3,600	2,154.00	7,754,400	貸付株式数	100株
わらべや日洋HD	4,200	1,758.00	7,383,600	貸付株式数	100株
なとり	3,500	1,566.00	5,481,000		
イフジ産業	1,000	707.00	707,000	貸付株式数	400株
ピクルスコーポレーション	1,500	2,368.00	3,552,000	貸付株式数	100株
北の達人コーポ	25,400	763.00	19,380,200	貸付株式数	10,000株
ユーグレナ	27,800	910.00	25,298,000	貸付株式数	10,400株 (5,800株)
片倉工業	9,000	1,227.00	11,043,000	貸付株式数	2,900株
グンゼ	4,200	4,430.00	18,606,000	貸付株式数	1,600株
ヒューリック	135,683	1,054.00	143,009,882	貸付株式数	52,400株
神栄	800	760.00	608,000		
ラサ商事	3,400	810.00	2,754,000	貸付株式数	100株
アルペン	4,800	1,613.00	7,742,400	貸付株式数	1,300株
ハブ	2,100	1,170.00	2,457,000		
ラクーンホールディングス	3,400	640.00	2,176,000		
クオールホールディングス	9,300	1,433.00	13,326,900	貸付株式数	100株 (100株)
アルコニックス	6,700	1,182.00	7,919,400		
神戸物産	11,000	5,360.00	58,960,000	貸付株式数	4,300株
ソリトンシステムズ	3,300	1,059.00	3,494,700		
ジンズホールディングス	3,300	6,380.00	21,054,000	貸付株式数	1,200株
ビックカメラ	37,600	1,043.00	39,216,800	貸付株式数	14,800株
DCMホールディングス	34,400	1,039.00	35,741,600	貸付株式数	13,600株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	5,000	1,565.00	7,825,000	貸付株式数	2,000株 (300株)
Monotaro	45,200	2,592.00	117,158,400	貸付株式数	17,800株 (2,500株)
東京一番フーズ	1,600	612.00	979,200	貸付株式数	600株 (500株)
DDホールディングス	2,800	1,453.00	4,068,400		

あい ホールディングス	9,000	1,745.00	15,705,000	貸付株式数	3,500株
ディーブイエックス	2,400	764.00	1,833,600	貸付株式数	900株
きちりホールディングス	1,600	728.00	1,164,800	貸付株式数	600株
アークランドサービスHD	4,600	1,931.00	8,882,600		
J. フロント リテイリング	81,500	1,233.00	100,489,500	貸付株式数	32,200株
ドトール・日レスHD	11,200	2,035.00	22,792,000	貸付株式数	4,400株
マツモトキヨシHLDGS	26,300	3,975.00	104,542,500	貸付株式数	10,400株
ブロンコビリー	3,300	2,301.00	7,593,300	貸付株式数	1,400株 (900株)
ZOZO	68,700	2,124.00	145,918,800	貸付株式数	25,400株
トレジャー・ファクトリー	1,900	1,223.00	2,323,700	貸付株式数	600株
物語コーポレーション	1,600	9,770.00	15,632,000	貸付株式数	600株 (100株)
ココカラファイン	7,200	5,990.00	43,128,000		
三越伊勢丹HD	118,900	815.00	96,903,500		
東洋紡	26,600	1,386.00	36,867,600	貸付株式数	10,500株
ユニチカ	18,800	317.00	5,959,600	貸付株式数	7,200株
富士紡ホールディングス	3,200	2,599.00	8,316,800		
日清紡ホールディングス	42,900	811.00	34,791,900	貸付株式数	16,800株
倉敷紡績	5,900	2,068.00	12,201,200	貸付株式数	600株
ダイワボウHD	5,800	4,095.00	23,751,000	貸付株式数	2,000株
シキボウ	3,200	897.00	2,870,400	貸付株式数	1,200株
日東紡績	9,600	3,045.00	29,232,000	貸付株式数	3,800株
トヨタ紡織	22,600	1,443.00	32,611,800	貸付株式数	7,700株
マクニカ・富士エレHLDGS	17,700	1,428.00	25,275,600	貸付株式数	1,100株
Hamee	1,900	752.00	1,428,800	貸付株式数	700株
ラクト・ジャパン	2,600	3,680.00	9,568,000	貸付株式数	1,000株 (500株)
ウエルシアHD	16,800	5,520.00	92,736,000	貸付株式数	6,600株
クリエイトSDH	9,500	2,377.00	22,581,500	貸付株式数	3,700株
バイタルKSKHD	11,700	1,037.00	12,132,900	貸付株式数	4,400株
八洲電機	5,400	873.00	4,714,200	貸付株式数	1,900株
メディアスホールディングス	3,500	658.00	2,303,000	貸付株式数	1,300株
レスターホールディングス	7,000	1,749.00	12,243,000	貸付株式数	1,000株
ジュテックHD	1,500	929.00	1,393,500	貸付株式数	500株
丸善CHI HD	7,400	379.00	2,804,600		
大光	2,600	640.00	1,664,000	貸付株式数	1,000株

OCCHIホールディングス	1,800	1,139.00	2,050,200		
TOKAIホールディングス	33,100	1,012.00	33,497,200	貸付株式数	1,400株
黒谷	1,400	425.00	595,000	貸付株式数	500株
ミサワ	1,100	447.00	491,700		
ティーライフ	800	832.00	665,600	貸付株式数	300株
Cominix	1,100	782.00	860,200		
エー・ピーカンパニー	1,100	522.00	574,200	貸付株式数	400株
三洋貿易	3,200	2,170.00	6,944,000	貸付株式数	1,000株
チムニー	1,900	2,404.00	4,567,600	貸付株式数	700株
シュッピン	4,200	894.00	3,754,800	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ビューティガレージ	1,000	1,903.00	1,903,000	貸付株式数	100株
ウイン・パートナーズ	4,100	1,035.00	4,243,500	貸付株式数	1,300株
ネクステージ	10,000	1,103.00	11,030,000	貸付株式数	4,000株
ジョイフル本田	18,400	1,318.00	24,251,200	貸付株式数	1,900株
鳥貴族	2,100	2,119.00	4,449,900	貸付株式数	900株
キリン堂ホールディングス	2,500	1,875.00	4,687,500	貸付株式数	200株
ホットランド	3,700	1,175.00	4,347,500	貸付株式数	1,400株
すかいらくHD	71,400	1,878.00	134,089,200	貸付株式数	28,500株 (2,800株)
SFPホールディングス	2,700	2,089.00	5,640,300	貸付株式数	1,000株
綿半ホールディングス	2,400	2,146.00	5,150,400	貸付株式数	900株
日本毛織	20,800	941.00	19,572,800	貸付株式数	5,000株
ダイトウボウ	12,700	81.00	1,028,700	貸付株式数	1,100株
トーア紡コーポレーション	2,600	499.00	1,297,400	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	7,200	269.00	1,936,800	貸付株式数	2,800株
ヨシックス	1,000	3,250.00	3,250,000	貸付株式数	200株
ユナイテッド・スーパー マーケ	18,600	952.00	17,707,200	貸付株式数	500株
三栄建築設計	2,600	1,450.00	3,770,000	貸付株式数	1,000株 (900株)
野村不動産HLDGS	42,400	2,297.00	97,392,800		
三重交通グループHD	12,900	539.00	6,953,100	貸付株式数	5,100株
サムティ	9,000	1,873.00	16,857,000	貸付株式数	3,500株
エー・ディー・ワークス	192,200	34.00	6,534,800		
日本商業開発	4,100	1,484.00	6,084,400	貸付株式数	1,500株
プレサンスコーポレーション	10,100	1,615.00	16,311,500	貸付株式数	1,000株
ユニゾホールディングス	9,400	4,280.00	40,232,000	貸付株式数	3,600株



日本管理センター	4,100	1,372.00	5,625,200	貸付株式数 800株 (800株)
サンセイランディック	1,900	803.00	1,525,700	貸付株式数 700株 (500株)
エストラスト	1,300	727.00	945,100	貸付株式数 300株
フージャースHD	13,800	617.00	8,514,600	貸付株式数 5,400株
オープンハウス	9,200	5,300.00	48,760,000	
東急不動産HD	171,200	667.00	114,190,400	貸付株式数 23,000株
飯田GHD	53,200	1,701.00	90,493,200	貸付株式数 3,800株
イーグランド	1,100	695.00	764,500	
帝国繊維	7,000	1,701.00	11,907,000	
日本コークス工業	55,500	84.00	4,662,000	貸付株式数 600株
ゴルフダイジェスト・オン	2,500	696.00	1,740,000	
ミタチ産業	2,000	654.00	1,308,000	貸付株式数 700株
B E E N O S	2,200	1,246.00	2,741,200	貸付株式数 800株
あさひ	5,300	1,227.00	6,503,100	貸付株式数 1,900株
日本調剤	2,200	3,685.00	8,107,000	
コスモス薬品	2,800	21,900.00	61,320,000	貸付株式数 1,100株
シップヘルスケアHD	13,300	4,655.00	61,911,500	貸付株式数 5,200株
トーエル	3,100	692.00	2,145,200	貸付株式数 1,100株
ソフトクリエイイトHD	2,700	1,721.00	4,646,700	貸付株式数 1,000株
オンリー	1,000	772.00	772,000	貸付株式数 400株
セブン&アイ・HLDGS	266,700	3,937.00	1,049,997,900	貸付株式数 105,600株
クリエイイト・レストランツ・ホール	17,100	1,634.00	27,941,400	貸付株式数 6,700株 (6,400株)
明治電機工業	2,000	1,331.00	2,662,000	
ツルハホールディングス	13,800	11,700.00	161,460,000	貸付株式数 5,400株
デリカフーズHLDGS	2,200	719.00	1,581,800	貸付株式数 800株
スターティアホールディングス	1,200	506.00	607,200	
サンマルクホールディングス	4,900	2,420.00	11,858,000	貸付株式数 1,400株
フェリシモ	1,400	997.00	1,395,800	貸付株式数 500株
トリドールホールディングス	7,900	2,532.00	20,002,800	貸付株式数 3,100株 (2,800株)
帝人	51,500	1,966.00	101,249,000	貸付株式数 13,400株
東レ	490,600	765.70	375,652,420	
クラレ	101,400	1,264.00	128,169,600	貸付株式数 39,900株
旭化成	450,100	988.20	444,788,820	貸付株式数 54,700株
サカイオーベックス	1,500	1,630.00	2,445,000	

TOKYO BASE	5,700	924.00	5,266,800	貸付株式数 2,200株 (2,100株)
稲葉製作所	3,500	1,387.00	4,854,500	貸付株式数 200株
宮地エンジニアリングG	2,000	1,486.00	2,972,000	貸付株式数 700株
トーカロ	16,500	838.00	13,827,000	貸付株式数 1,300株
アルファCO	2,300	1,166.00	2,681,800	
SUMCO	76,500	1,439.00	110,083,500	貸付株式数 30,200株 (3,400株)
川田テクノロジーズ	1,400	6,370.00	8,918,000	
RS TECHNOLOGIES	1,800	3,300.00	5,940,000	貸付株式数 300株
信和	3,300	967.00	3,191,100	
ビーロット	1,500	1,613.00	2,419,500	
ファーストブラザーズ	1,700	1,060.00	1,802,000	貸付株式数 600株
ハウストゥ	3,500	1,591.00	5,568,500	貸付株式数 1,300株
シーアールイー	2,300	1,048.00	2,410,400	
プロパティエージェント	800	1,200.00	960,000	貸付株式数 300株
ケイアイスター不動産	1,800	1,970.00	3,546,000	貸付株式数 600株
アグレ都市デザイン	1,000	428.00	428,000	
ジェイ・エス・ビー	700	4,180.00	2,926,000	
テンポイノベーション	700	1,619.00	1,133,300	貸付株式数 100株
グローバルリンクマネジメント	900	577.00	519,300	貸付株式数 100株
住江織物	1,900	2,910.00	5,529,000	貸付株式数 500株
日本フェルト	3,500	456.00	1,596,000	貸付株式数 900株
イチカワ	900	1,369.00	1,232,100	
エコナックホールディングス	10,800	126.00	1,360,800	貸付株式数 1,200株
日東製網	700	1,412.00	988,400	貸付株式数 200株
芦森工業	1,300	1,328.00	1,726,400	
アツギ	5,100	812.00	4,141,200	貸付株式数 1,900株
ウイルプラスHLDGS	900	788.00	709,200	貸付株式数 300株
ジャパンミート	3,200	2,087.00	6,678,400	貸付株式数 100株
コメダホールディングス	14,800	1,952.00	28,889,600	貸付株式数 5,800株
サツドラホールディングス	1,000	1,725.00	1,725,000	貸付株式数 300株
デファクトスタンダード	500	306.00	153,000	貸付株式数 200株
アレンザホールディングス	3,500	789.00	2,761,500	貸付株式数 1,300株
串カツ田中HLDGS	900	2,099.00	1,889,100	貸付株式数 300株
バロックジャパン	5,100	990.00	5,049,000	
クスリのアオキHLDGS	6,300	8,250.00	51,975,000	貸付株式数 1,600株

ダイニック	2,500	685.00	1,712,500	貸付株式数	1,000株
共和レザー	4,000	735.00	2,940,000	貸付株式数	700株
力の源HD	2,400	921.00	2,210,400	貸付株式数	900株
スシローグローバルHLDGS	7,000	7,060.00	49,420,000	貸付株式数	2,700株
LIXILビバ	5,400	1,442.00	7,786,800	貸付株式数	1,100株
セーレン	15,700	1,234.00	19,373,800		
ソトー	2,400	979.00	2,349,600		
東海染工	800	1,134.00	907,200		
小松マテーレ	10,500	746.00	7,833,000	貸付株式数	4,000株
ワコールホールディングス	17,800	2,536.00	45,140,800	貸付株式数	5,000株
ホギメディカル	7,800	2,956.00	23,056,800	貸付株式数	600株
レナウン	17,900	108.00	1,933,200	貸付株式数	7,100株
クラウディアHLDGS	1,500	492.00	738,000	貸付株式数	100株
TSIホールディングス	23,000	547.00	12,581,000	貸付株式数	2,400株
マツオカコーポレーション	2,000	2,039.00	4,078,000		
ワールド	8,300	2,417.00	20,061,100		
TIS	20,900	6,450.00	134,805,000		
ネオス	2,500	764.00	1,910,000	貸付株式数	1,000株
電算システム	2,400	2,961.00	7,106,400		
グリー	42,900	474.00	20,334,600		
コーエーテクモHD	13,000	2,277.00	29,601,000	貸付株式数	5,100株
三菱総合研究所	2,700	3,565.00	9,625,500	貸付株式数	900株
ボルテージ	1,200	499.00	598,800	貸付株式数	400株
電算	700	2,014.00	1,409,800	貸付株式数	100株 (100株)
AGS	3,500	659.00	2,306,500	貸付株式数	1,400株
ファインデックス	5,200	1,018.00	5,293,600		
ブレインパッド	1,200	6,800.00	8,160,000		
KLab	12,000	1,275.00	15,300,000	貸付株式数	4,700株
ポルトゥウィン・ピットクル	8,400	1,016.00	8,534,400		
イーブックイニシアティブ	1,000	1,810.00	1,810,000	貸付株式数	300株
ネクソン	179,800	1,389.00	249,742,200	貸付株式数	71,200株
アイスタイル	16,000	750.00	12,000,000	貸付株式数	6,100株
エムアップ	2,100	1,927.00	4,046,700	貸付株式数	800株
エイチーム	4,300	1,141.00	4,906,300	貸付株式数	1,700株
エニグモ	4,500	1,252.00	5,634,000	貸付株式数	1,700株
テクノスジャパン	5,200	503.00	2,615,600	貸付株式数	2,000株
enish	2,700	1,133.00	3,059,100	貸付株式数	1,000株

コロプラ	20,600	699.00	14,399,400	貸付株式数 7,800株 (4,500株)
オルトプラス	4,100	260.00	1,066,000	貸付株式数 1,600株
ブロードリーフ	30,900	566.00	17,489,400	貸付株式数 12,300株
クロス・マーケティングG	2,600	323.00	839,800	貸付株式数 900株
デジタルハーツHLDGS	2,800	927.00	2,595,600	
システム情報	3,100	1,062.00	3,292,200	貸付株式数 1,200株
メディアドゥHLDGS	2,200	3,785.00	8,327,000	
じげん	8,900	590.00	5,251,000	
ブイキューブ	3,300	419.00	1,382,700	貸付株式数 1,300株
エンカレッジ・テクノロジー	800	748.00	598,400	貸付株式数 300株
サイバーリンクス	900	1,072.00	964,800	貸付株式数 100株
ディー・エル・イー	4,300	182.00	782,600	
フィックスターズ	6,600	1,558.00	10,282,800	貸付株式数 2,600株
CARTAHOLDINGS	3,100	994.00	3,081,400	貸付株式数 1,200株 (100株)
オブティム	2,800	2,883.00	8,072,400	貸付株式数 1,000株
セレス	2,000	1,297.00	2,594,000	貸付株式数 800株
特種東海製紙	4,000	3,735.00	14,940,000	貸付株式数 1,200株
ティーガイア	5,900	2,109.00	12,443,100	
セック	1,000	3,105.00	3,105,000	
日本アジアグループ	6,500	317.00	2,060,500	貸付株式数 1,200株
豆蔵ホールディングス	4,200	1,696.00	7,123,200	
テクマトリックス	4,400	2,277.00	10,018,800	
プロシップ	1,800	1,155.00	2,079,000	
ガンホー・オンライン・エンター	15,300	2,353.00	36,000,900	貸付株式数 6,000株 (300株)
GMOペイメントゲートウェイ	10,400	8,200.00	85,280,000	貸付株式数 4,100株
ザッパラス	3,000	353.00	1,059,000	貸付株式数 1,200株
システムリサーチ	800	3,935.00	3,148,000	貸付株式数 300株
インターネットイニシアティブ	10,100	2,512.00	25,371,200	
さくらインターネット	7,300	610.00	4,453,000	
ヴィンクス	2,100	1,299.00	2,727,900	貸付株式数 800株
GMOクラウド	1,300	2,607.00	3,389,100	貸付株式数 500株
SRAホールディングス	3,300	2,526.00	8,335,800	貸付株式数 100株
MINORISOソリューションズ	1,200	1,829.00	2,194,800	貸付株式数 400株
システムインテグレータ	1,700	662.00	1,125,400	貸付株式数 600株

朝日ネット	4,900	693.00	3,395,700	貸付株式数	1,500株
e B A S E	3,700	1,013.00	3,748,100	貸付株式数	1,000株
アバント	2,200	1,949.00	4,287,800	貸付株式数	800株
アドソル日進	2,200	2,142.00	4,712,400	貸付株式数	800株
フリービット	4,000	1,145.00	4,580,000	貸付株式数	1,400株
コムチュア	3,500	3,890.00	13,615,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
サイバーコム	1,100	1,673.00	1,840,300	貸付株式数	400株
アステリア	4,100	625.00	2,562,500	貸付株式数	1,600株
アイル	1,000	2,035.00	2,035,000		
王子ホールディングス	284,700	508.00	144,627,600	貸付株式数	33,400株
日本製紙	30,300	1,799.00	54,509,700	貸付株式数	10,800株
三菱製紙	10,500	482.00	5,061,000	貸付株式数	4,000株
北越コーポレーション	41,800	548.00	22,906,400	貸付株式数	13,100株
中越パルプ	2,600	1,499.00	3,897,400	貸付株式数	700株
巴川製紙	2,000	828.00	1,656,000	貸付株式数	300株
大王製紙	30,700	1,371.00	42,089,700	貸付株式数	5,400株
阿波製紙	1,600	398.00	636,800	貸付株式数	100株 (100株)
マークライنز	3,100	1,858.00	5,759,800		
メディカル・データ・ビジ	5,300	1,087.00	5,761,100	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
g u m i	8,000	724.00	5,792,000	貸付株式数	1,000株
ショーケース	1,300	721.00	937,300	貸付株式数	400株
モバイルファクトリー	1,700	1,673.00	2,844,100		
テラスカイ	1,200	1,870.00	2,244,000		
デジタル・インフォメー ション	2,800	1,583.00	4,432,400		
P C Iホールディングス	1,300	2,045.00	2,658,500		
パイプドHD	1,000	1,280.00	1,280,000	貸付株式数	300株
アイピーシー	1,100	1,080.00	1,188,000	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,200	1,037.00	1,244,400	貸付株式数	400株
P R T I M E S	500	3,040.00	1,520,000		
ランドコンピュータ	900	1,011.00	909,900	貸付株式数	100株
ダブルスタンダード	500	4,585.00	2,292,500	貸付株式数	200株
オーブンドア	3,100	2,166.00	6,714,600	貸付株式数	1,200株
マイネット	2,000	495.00	990,000	貸付株式数	800株
アカツキ	2,200	7,290.00	16,038,000	貸付株式数	800株
ベネフィットジャパン	400	1,608.00	643,200	貸付株式数	100株 (100株)

UBICOMホールディングス	1,100	1,636.00	1,799,600	貸付株式数	400株
LINE	18,300	3,975.00	72,742,500	貸付株式数	7,100株 (2,100株)
カナミックネットワーク	3,900	597.00	2,328,300		
ノムラシステムコーポレーション	1,400	389.00	544,600	貸付株式数	200株
レンゴー	65,100	778.00	50,647,800		
トーモク	3,900	1,525.00	5,947,500	貸付株式数	1,500株
ザ・パック	4,800	3,400.00	16,320,000		
チェンジ	1,200	2,130.00	2,556,000	貸付株式数	400株
シンクロ・フード	2,600	472.00	1,227,200		
オークネット	3,400	1,277.00	4,341,800	貸付株式数	300株
セグエグループ	200	1,353.00	270,600		
エイトレッド	700	1,748.00	1,223,600	貸付株式数	200株
AOI TYO HOLDINGS	6,800	631.00	4,290,800	貸付株式数	2,500株
マクロミル	11,000	941.00	10,351,000	貸付株式数	1,000株
ビーグリー	1,500	906.00	1,359,000	貸付株式数	100株
オロ	1,600	2,698.00	4,316,800	貸付株式数	600株
テモナ	800	650.00	520,000	貸付株式数	300株
ニーズウェル	400	703.00	281,200		
サインポスト	1,000	2,271.00	2,271,000	貸付株式数	300株
昭和電工	45,000	2,845.00	128,025,000	貸付株式数	17,800株
住友化学	497,800	485.00	241,433,000		
住友精化	3,000	3,315.00	9,945,000	貸付株式数	1,200株
日産化学	38,300	4,505.00	172,541,500		
ラサ工業	2,200	1,205.00	2,651,000	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,800	5,870.00	34,046,000	貸付株式数	900株
多木化学	1,800	4,655.00	8,379,000	貸付株式数	700株
テイカ	5,200	1,891.00	9,833,200	貸付株式数	600株
石原産業	12,200	881.00	10,748,200	貸付株式数	4,500株
片倉コープアグリ	2,200	1,054.00	2,318,800		
日本曹達	10,000	2,520.00	25,200,000	貸付株式数	3,100株
東ソー	97,700	1,395.00	136,291,500		
トクヤマ	18,200	2,295.00	41,769,000		
セントラル硝子	13,700	2,279.00	31,222,300		
東亜合成	39,600	1,076.00	42,609,600	貸付株式数	15,600株
大阪ソーダ	7,000	2,462.00	17,234,000		
関東電化	14,800	736.00	10,892,800		

デンカ	24,900	2,838.00	70,666,200	貸付株式数	3,700株
イビデン	39,500	2,144.00	84,688,000	貸付株式数	2,500株
信越化学	111,500	11,330.00	1,263,295,000		
日本カ - バイド	2,200	1,198.00	2,635,600	貸付株式数	400株
堺 化 学	4,200	2,362.00	9,920,400		
第一稀元素化学工	6,800	826.00	5,616,800	貸付株式数	2,500株
エア・ウォーター	51,700	1,839.00	95,076,300	貸付株式数	17,900株
大陽日酸	52,100	2,086.00	108,680,600		
日本化学工業	2,100	2,205.00	4,630,500		
東邦アセチレン	1,000	1,220.00	1,220,000	貸付株式数	300株
日本パ - カライジング	34,500	1,163.00	40,123,500		
高压ガス	9,900	780.00	7,722,000	貸付株式数	900株
チタン工業	800	2,578.00	2,062,400	貸付株式数	300株
四国化成	10,600	1,066.00	11,299,600	貸付株式数	2,000株
戸田工業	1,300	2,029.00	2,637,700	貸付株式数	500株
ステラ ケミファ	3,700	2,654.00	9,819,800	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
保土谷化学	2,200	2,858.00	6,287,600		
日本触媒	10,600	6,280.00	66,568,000		
大日精化	5,200	2,926.00	15,215,200	貸付株式数	100株
カネカ	16,400	3,245.00	53,218,000		
協和キリン	72,000	2,020.00	145,440,000	貸付株式数	28,800株
三菱瓦斯化学	64,300	1,301.00	83,654,300		
三井化学	57,500	2,304.00	132,480,000	貸付株式数	19,000株
J S R	63,500	1,758.00	111,633,000		
東京応化工業	10,800	3,970.00	42,876,000	貸付株式数	4,200株
大阪有機化学	5,800	955.00	5,539,000	貸付株式数	700株
三菱ケミカルH L D G S	423,100	787.30	333,106,630		
K H ネオケム	11,100	2,126.00	23,598,600	貸付株式数	4,400株
ダイセル	93,100	848.00	78,948,800		
住友ベ - クライト	10,900	3,945.00	43,000,500		
積水化学	136,100	1,592.00	216,671,200	貸付株式数	41,800株
日本ゼオン	57,100	1,273.00	72,688,300	貸付株式数	17,800株
アイカ工業	19,000	3,045.00	57,855,000		
宇部興産	31,900	2,080.00	66,352,000		
積水樹脂	10,500	1,983.00	20,821,500	貸付株式数	2,600株
タキロンシーアイ	13,900	621.00	8,631,900	貸付株式数	5,000株
旭有機材	4,300	1,247.00	5,362,100	貸付株式数	1,700株
日立化成	29,200	3,460.00	101,032,000	貸付株式数	11,500株
ニチバン	3,300	1,531.00	5,052,300	貸付株式数	1,300株

リケンテクノス	17,400	469.00	8,160,600	貸付株式数	6,700株
大倉工業	3,200	1,551.00	4,963,200	貸付株式数	1,100株
積水化成成品	9,400	712.00	6,692,800		
群栄化学	1,600	2,270.00	3,632,000		
タイガース ポリマー	3,300	532.00	1,755,600		
ミライアル	1,900	1,366.00	2,595,400	貸付株式数	600株
ダイキアクシス	2,200	765.00	1,683,000	貸付株式数	800株
ダイキョーニシカワ	13,300	742.00	9,868,600	貸付株式数	4,900株
竹本容器	2,200	860.00	1,892,000		
森六ホールディングス	3,400	2,471.00	8,401,400		
日本化薬	39,000	1,217.00	47,463,000		
カーリットホールディングス	6,700	557.00	3,731,900	貸付株式数	100株
E P Sホールディングス	9,200	1,308.00	12,033,600	貸付株式数	1,600株
ソルクシーズ	2,600	927.00	2,410,200	貸付株式数	1,000株
レグス	1,500	1,768.00	2,652,000	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	11,500	1,884.00	21,666,000	貸付株式数	400株
フェイス	2,400	727.00	1,744,800	貸付株式数	900株
プロトコーポレーション	5,700	1,217.00	6,936,900		
ハイマックス	700	1,829.00	1,280,300		
アミューズ	3,700	2,643.00	9,779,100	貸付株式数	200株
野村総合研究所	120,500	2,250.00	271,125,000		
ドリームインキュベータ	1,800	1,281.00	2,305,800		
サイバネットシステム	5,100	617.00	3,146,700		
クイック	3,800	1,287.00	4,890,600		
T A C	3,100	195.00	604,500	貸付株式数	1,200株
C Eホールディングス	1,800	1,027.00	1,848,600	貸付株式数	600株
ケネディクス	58,500	547.00	31,999,500	貸付株式数	22,700株
日本システム技術	1,000	1,214.00	1,214,000	貸付株式数	100株
電通	63,600	3,735.00	237,546,000	貸付株式数	28,600株
インテージホールディングス	7,800	923.00	7,199,400	貸付株式数	3,100株
テイクアンドギヴニーズ	2,300	1,153.00	2,651,900		
東邦システムサイエンス	1,800	995.00	1,791,000	貸付株式数	700株
ぴあ	1,700	4,125.00	7,012,500	貸付株式数	600株 (400株)
イオンファンタジー	2,000	2,839.00	5,678,000	貸付株式数	300株
ソースネクスト	24,200	485.00	11,737,000	貸付株式数	9,600株 (9,100株)
シーティーエス	6,800	716.00	4,868,800	貸付株式数	600株



ネクシーズグループ	2,100	1,859.00	3,903,900	貸付株式数	800株
インフォコム	6,800	2,515.00	17,102,000	貸付株式数	2,700株
メディカルシステムネット ワーク	6,700	514.00	3,443,800		
日本精化	5,200	1,114.00	5,792,800	貸付株式数	1,900株
扶桑化学工業	6,400	2,306.00	14,758,400		
トリケミカル	1,400	6,040.00	8,456,000	貸付株式数	500株
F I G	6,400	300.00	1,920,000	貸付株式数	300株
A D E K A	31,200	1,302.00	40,622,400		
日油	23,800	3,495.00	83,181,000		
ミヨシ油脂	2,800	1,087.00	3,043,600	貸付株式数	1,000株
新日本理化	11,300	182.00	2,056,600	貸付株式数	1,400株
ハリマ化成グループ	5,400	1,194.00	6,447,600	貸付株式数	1,300株
アルテリア・ネットワ ークス	6,900	1,425.00	9,832,500		
ヒト・コミュニケーション ズHD	1,400	1,683.00	2,356,200	貸付株式数	500株
花 王	154,700	7,735.00	1,196,604,500	貸付株式数	61,200株 (200株)
第一工業製薬	2,300	2,707.00	6,226,100	貸付株式数	900株
石原ケミカル	1,600	1,618.00	2,588,800	貸付株式数	600株
日華化学	2,100	770.00	1,617,000	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,000	1,450.00	1,450,000	貸付株式数	100株
三洋化成	4,200	4,915.00	20,643,000		
武田薬品	564,100	3,683.00	2,077,580,300		
アステラス製薬	568,000	1,543.50	876,708,000		
大日本住友製薬	47,800	1,850.00	88,430,000		
塩野義製薬	82,500	5,789.00	477,592,500		
田辺三菱製薬	67,100	1,203.00	80,721,300		
わかもと製薬	7,500	243.00	1,822,500	貸付株式数	2,100株
あすか製薬	7,900	1,037.00	8,192,300	貸付株式数	2,500株
日本新薬	16,900	8,960.00	151,424,000	貸付株式数	3,100株
ビオフェルミン製薬	1,100	2,122.00	2,334,200		
中外製薬	67,300	7,840.00	527,632,000	貸付株式数	26,600株
科研製薬	10,900	5,080.00	55,372,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
エーザイ	77,300	5,350.00	413,555,000		
理研ビタミン	3,000	3,450.00	10,350,000	貸付株式数	1,200株
ロート製薬	33,100	2,680.00	88,708,000	貸付株式数	9,900株
小野薬品	152,300	1,969.50	299,954,850		

久光製薬	19,000	4,455.00	84,645,000	貸付株式数	7,500株
有機合成薬品	6,700	223.00	1,494,100		
持田製薬	9,700	4,015.00	38,945,500	貸付株式数	3,600株
参天製薬	120,000	1,854.00	222,480,000	貸付株式数	5,300株
扶桑薬品	2,200	1,911.00	4,204,200		
日本ケミファ	800	2,795.00	2,236,000	貸付株式数	300株
ツムラ	19,900	2,995.00	59,600,500		
日医工	16,700	1,206.00	20,140,200	貸付株式数	3,200株
テ ル モ	182,800	3,137.00	573,443,600	貸付株式数	68,400株
みらかホールディングス	17,100	2,412.00	41,245,200		
キッセイ薬品工業	11,300	2,483.00	28,057,900		
生化学工業	12,300	1,081.00	13,296,300	貸付株式数	4,900株
栄研化学	11,200	1,630.00	18,256,000	貸付株式数	4,200株 (700株)
日水製薬	2,600	1,192.00	3,099,200	貸付株式数	100株
鳥居薬品	4,000	2,840.00	11,360,000		
JCRファーマ	4,500	7,810.00	35,145,000		
東和薬品	9,300	2,433.00	22,626,900	貸付株式数	3,300株
富士製薬工業	4,300	1,300.00	5,590,000	貸付株式数	100株
沢井製薬	13,200	5,650.00	74,580,000		
ゼリア新薬工業	12,600	1,885.00	23,751,000	貸付株式数	1,800株
第一三共	184,900	7,230.00	1,336,827,000		
キョーリン製薬HD	14,000	1,759.00	24,626,000		
大幸薬品	2,800	2,342.00	6,557,600		
ダイト	3,700	2,874.00	10,633,800	貸付株式数	300株
大塚ホールディングス	123,000	4,488.00	552,024,000	貸付株式数	48,600株
大正製薬HD	13,600	7,470.00	101,592,000		
ペプチドリーム	32,700	5,470.00	178,869,000	貸付株式数	12,900株
大日本塗料	7,000	1,070.00	7,490,000		
日本ペイントHOLD	52,200	5,110.00	266,742,000	貸付株式数	20,600株
関西ペイント	71,000	2,275.00	161,525,000	貸付株式数	25,100株
神東塗料	7,900	162.00	1,279,800	貸付株式数	1,000株
中国塗料	20,600	848.00	17,468,800	貸付株式数	3,900株
日本特殊塗料	4,700	1,026.00	4,822,200		
藤倉化成	8,800	533.00	4,690,400	貸付株式数	3,200株
太陽ホールディングス	5,200	3,360.00	17,472,000	貸付株式数	1,100株
DIC	27,200	2,844.00	77,356,800	貸付株式数	10,800株
サカタインクス	13,700	1,038.00	14,220,600		
東洋インキSCホールディングン	13,300	2,306.00	30,669,800	貸付株式数	5,200株

T & K T O K A	4,800	927.00	4,449,600	貸付株式数	300株
アルプス技研	5,600	1,506.00	8,433,600		
サニックス	10,600	349.00	3,699,400	貸付株式数	4,200株 (4,200株)
ダイオーズ	1,400	1,446.00	2,024,400	貸付株式数	500株
日本空調サービス	7,000	690.00	4,830,000	貸付株式数	1,000株
オリエンタルランド	72,900	16,230.00	1,183,167,000	貸付株式数	200株
フォーカスシステムズ	4,200	839.00	3,523,800		
ダスキン	15,900	2,783.00	44,249,700		
パーク24	35,400	2,328.00	82,411,200	貸付株式数	14,100株
明光ネットワークジャパン	7,200	902.00	6,494,400	貸付株式数	2,800株
ファルコホールディングス	3,300	1,638.00	5,405,400	貸付株式数	1,300株
クレスコ	1,900	3,370.00	6,403,000		
フジ・メディア・HD	65,700	1,396.00	91,717,200		
秀英予備校	1,500	438.00	657,000	貸付株式数	600株
田谷	1,400	610.00	854,000	貸付株式数	500株
ラウンドワン	19,100	1,598.00	30,521,800		
リゾートトラスト	26,000	1,632.00	42,432,000	貸付株式数	3,600株
オービック	21,900	12,290.00	269,151,000	貸付株式数	1,000株
ジャストシステム	8,900	3,690.00	32,841,000		
TDCソフト	5,400	727.00	3,925,800	貸付株式数	100株
ヤフー	410,400	290.00	119,016,000	貸付株式数	162,600株
ビー・エム・エル	7,900	2,975.00	23,502,500		
ワタベウェディング	1,000	553.00	553,000	貸付株式数	300株
トレンドマイクロ	32,200	5,170.00	166,474,000	貸付株式数	12,800株
りらいあコミュニケーション	11,000	1,349.00	14,839,000		
IDホールディングス	2,400	1,209.00	2,901,600		
リソー教育	31,400	465.00	14,601,000		
日本オラクル	12,700	9,230.00	117,221,000	貸付株式数	5,000株
早稲田アカデミー	1,700	807.00	1,371,900	貸付株式数	600株
アルファシステムズ	1,900	2,685.00	5,101,500	貸付株式数	700株
フューチャー	8,200	1,790.00	14,678,000		
CAC HOLDINGS	4,500	1,357.00	6,106,500	貸付株式数	100株
ソフトバンク・テクノ	2,600	2,046.00	5,319,600	貸付株式数	1,000株
トーセ	1,700	814.00	1,383,800		
ユー・エス・エス	75,400	2,045.00	154,193,000	貸付株式数	26,800株
オービックビジネスC	6,400	4,365.00	27,936,000	貸付株式数	2,500株 (1,100株)
伊藤忠テクノソリューションズ	28,500	3,045.00	86,782,500		
アイティフォー	7,600	858.00	6,520,800		

東京個別指導学院	2,100	954.00	2,003,400	貸付株式数	800株
東計電算	900	2,997.00	2,697,300		
サイバーエージェント	35,400	4,335.00	153,459,000	貸付株式数	9,600株
楽天	287,200	1,025.00	294,380,000	貸付株式数	113,600株
エクスネット	1,100	967.00	1,063,700		
クリーク・アンド・リバー社	3,700	1,160.00	4,292,000		
テー・オー・ダブリュー	5,400	709.00	3,828,600	貸付株式数	500株
大塚商会	34,000	3,980.00	135,320,000	貸付株式数	13,500株
サイボウズ	7,300	1,034.00	7,548,200	貸付株式数	2,300株
ソフトブレーン	4,900	615.00	3,013,500	貸付株式数	1,400株
山田コンサルティングG P	3,000	1,644.00	4,932,000		
セントラルスポーツ	2,300	3,060.00	7,038,000	貸付株式数	900株
パラカ	1,600	2,096.00	3,353,600	貸付株式数	800株
電通国際情報S	3,900	3,415.00	13,318,500	貸付株式数	1,400株
デジタルガレージ	12,300	3,645.00	44,833,500	貸付株式数	4,800株
イーエムシステムズ	5,100	1,919.00	9,786,900		
ウェザーニューズ	2,100	3,170.00	6,657,000	貸付株式数	800株 (700株)
C I J	4,800	829.00	3,979,200	貸付株式数	1,000株
東洋ビジネスエンジ	600	2,687.00	1,612,200	貸付株式数	200株
日本エンタープライズ	6,100	171.00	1,043,100	貸付株式数	2,400株
WOWOW	2,900	2,574.00	7,464,600	貸付株式数	1,100株
スカラ	4,700	1,003.00	4,714,100		
インテリジェント ウェイブ	2,300	819.00	1,883,700	貸付株式数	900株
フルキャストホールディングス	6,200	1,976.00	12,251,200		
エン・ジャパン	9,000	3,885.00	34,965,000	貸付株式数	3,500株
富士フイルムH L D G S	134,200	4,608.00	618,393,600		
コニカミノルタ	141,200	763.00	107,735,600		
資 生 堂	128,400	8,598.00	1,103,983,200	貸付株式数	50,800株 (2,000株)
ライオン	85,600	2,018.00	172,740,800	貸付株式数	34,200株
高砂香料	4,400	2,631.00	11,576,400	貸付株式数	1,000株
マンダム	14,400	2,589.00	37,281,600	貸付株式数	5,300株 (2,900株)
ミルボン	8,700	5,050.00	43,935,000	貸付株式数	3,400株
ファンケル	28,700	2,612.00	74,964,400	貸付株式数	1,400株
コーセー	10,900	17,920.00	195,328,000	貸付株式数	4,200株

コタ	3,400	1,170.00	3,978,000		
シーボン	800	2,380.00	1,904,000	貸付株式数	200株
ポーラ・オルビスHD	27,500	2,458.00	67,595,000	貸付株式数	10,800株
ノエビアホールディングス	6,200	5,590.00	34,658,000		
アジュバンコスメジャパン	1,400	925.00	1,295,000	貸付株式数	500株
エステー	4,600	1,565.00	7,199,000	貸付株式数	1,100株
アグロカネショウ	2,500	1,419.00	3,547,500		
コニシ	11,400	1,484.00	16,917,600	貸付株式数	1,600株
長谷川香料	8,500	2,048.00	17,408,000	貸付株式数	3,300株
星光PMC	4,300	756.00	3,250,800	貸付株式数	1,400株
小林製薬	18,100	8,160.00	147,696,000	貸付株式数	7,100株 (4,300株)
荒川化学工業	5,800	1,358.00	7,876,400	貸付株式数	1,400株
メック	4,300	1,432.00	6,157,600	貸付株式数	1,700株 (1,500株)
日本高純度化学	2,000	2,410.00	4,820,000	貸付株式数	600株
タカラバイオ	16,800	2,308.00	38,774,400		
JCU	8,300	1,878.00	15,587,400		
新田ゼラチン	4,000	641.00	2,564,000	貸付株式数	1,300株
OATアグリオ	1,000	1,375.00	1,375,000		
デクセリアルズ	16,400	731.00	11,988,400	貸付株式数	300株
アース製薬	4,800	5,040.00	24,192,000		
北興化学	6,700	462.00	3,095,400		
大成ラミック	2,100	2,794.00	5,867,400		
クミアイ化学	26,600	920.00	24,472,000	貸付株式数	10,500株
日本農薬	11,900	445.00	5,295,500	貸付株式数	700株
富士興産	2,500	708.00	1,770,000	貸付株式数	900株 (800株)
ニチレキ	8,200	1,045.00	8,569,000	貸付株式数	2,800株
ユシロ化学	3,400	1,294.00	4,399,600	貸付株式数	1,100株
ビーピー・カストロール	2,300	1,346.00	3,095,800	貸付株式数	900株
富士石油	15,500	238.00	3,689,000	貸付株式数	6,100株
MORESCO	2,400	1,302.00	3,124,800	貸付株式数	900株
出光興産	74,600	2,924.00	218,130,400		
JXTGホールディングス	1,069,900	464.40	496,861,560		
コスモエネルギーHLDGS	18,700	2,032.00	37,998,400	貸付株式数	7,300株
横浜ゴム	37,400	2,087.00	78,053,800	貸付株式数	14,900株
TOYO TIRE	37,100	1,343.00	49,825,300	貸付株式数	14,800株
ブリヂストン	198,600	4,097.00	813,664,200	貸付株式数	78,600株

住友ゴム	57,700	1,238.00	71,432,600	貸付株式数 22,800株 (200株)
藤倉コンポジット	5,500	410.00	2,255,000	貸付株式数 1,000株
オカモト	4,400	4,050.00	17,820,000	
アキレス	4,600	1,673.00	7,695,800	
フ コ ク	2,800	672.00	1,881,600	
ニッタ	7,300	2,775.00	20,257,500	
クリエートメディック	2,100	904.00	1,898,400	貸付株式数 800株
住友理工	12,500	803.00	10,037,500	貸付株式数 4,300株
三ツ星ベルト	8,500	1,756.00	14,926,000	貸付株式数 1,600株
バンドー化学	12,500	843.00	10,537,500	貸付株式数 700株
A G C	63,800	3,155.00	201,289,000	貸付株式数 25,200株
日本板硝子	30,800	636.00	19,588,800	貸付株式数 12,100株
石塚硝子	1,100	1,914.00	2,105,400	
有沢製作所	10,100	1,038.00	10,483,800	貸付株式数 3,700株
日本山村硝子	2,600	1,227.00	3,190,200	
日本電気硝子	26,600	2,325.00	61,845,000	貸付株式数 10,600株
オハラ	2,500	1,393.00	3,482,500	貸付株式数 1,000株
住友大阪セメント	13,000	4,510.00	58,630,000	貸付株式数 3,300株
太平洋セメント	40,700	2,772.00	112,820,400	
リソルホールディングス	700	3,990.00	2,793,000	貸付株式数 200株
日本ヒユ - ム	6,500	670.00	4,355,000	貸付株式数 2,300株
日本コンクリ - ト	13,800	242.00	3,339,600	貸付株式数 5,100株
三谷セキサン	3,000	2,935.00	8,805,000	貸付株式数 1,100株
アジアパイルHD	9,000	497.00	4,473,000	貸付株式数 2,900株
東海カーボン	67,600	1,100.00	74,360,000	貸付株式数 27,000株 (100株)
日本カーボン	3,300	3,820.00	12,606,000	貸付株式数 1,300株
東洋炭素	3,800	2,205.00	8,379,000	貸付株式数 1,500株
ノリタケ	3,800	3,845.00	14,611,000	貸付株式数 1,400株
T O T O	49,700	3,940.00	195,818,000	
日本碍子	78,700	1,476.00	116,161,200	
日本特殊陶業	54,500	1,905.00	103,822,500	貸付株式数 2,100株
ダントーホールディングス	5,600	110.00	616,000	貸付株式数 2,000株
M A R U W A	2,200	6,360.00	13,992,000	
品川リフラクトリーズ	1,700	2,624.00	4,460,800	貸付株式数 600株
黒崎播磨	1,300	5,530.00	7,189,000	貸付株式数 500株 (400株)
ヨータイ	5,600	581.00	3,253,600	貸付株式数 100株
イソライト	3,300	430.00	1,419,000	

東京窯業	8,200	289.00	2,369,800	貸付株式数	1,500株
ニッカトー	2,900	660.00	1,914,000	貸付株式数	200株
フジインコーポレーテッド	5,700	2,473.00	14,096,100		
クニミネ工業	2,800	880.00	2,464,000		
エーアンドエーマテリアル	1,300	985.00	1,280,500	貸付株式数	100株
ニチアス	17,700	1,798.00	31,824,600		
日本製鉄	296,900	1,503.00	446,240,700		
神戸製鋼所	116,900	569.00	66,516,100	貸付株式数	46,000株
中山製鋼所	9,100	435.00	3,958,500	貸付株式数	300株
合同製鐵	3,100	2,137.00	6,624,700		
J F Eホールディングス	172,500	1,281.00	220,972,500		
東京製鐵	34,000	836.00	28,424,000		
共英製鋼	7,200	1,907.00	13,730,400		
大和工業	13,600	2,695.00	36,652,000	貸付株式数	4,300株
東京鐵鋼	2,700	1,222.00	3,299,400	貸付株式数	600株
大阪製鐵	4,300	1,320.00	5,676,000	貸付株式数	1,400株
淀川製鋼所	8,700	1,840.00	16,008,000	貸付株式数	800株
丸一鋼管	22,600	2,637.00	59,596,200		
モリ工業	2,000	1,812.00	3,624,000		
大同特殊鋼	10,500	4,125.00	43,312,500	貸付株式数	3,800株
日本高周波	2,200	407.00	895,400		
日本冶金工	52,800	227.00	11,985,600	貸付株式数	200株
山陽特殊製鋼	8,000	1,426.00	11,408,000		
愛知製鋼	3,500	3,170.00	11,095,000	貸付株式数	1,100株
日立金属	68,900	1,191.00	82,059,900	貸付株式数	1,700株
日本金属	1,500	777.00	1,165,500		
大平洋金属	4,300	2,193.00	9,429,900	貸付株式数	1,700株
新日本電工	40,900	162.00	6,625,800	貸付株式数	16,300株
栗本鉄工所	3,200	1,422.00	4,550,400		
虹 技	1,000	1,226.00	1,226,000	貸付株式数	300株
日本鑄鉄管	600	980.00	588,000	貸付株式数	200株
日本製鋼所	19,300	2,125.00	41,012,500		
三菱製鋼	4,700	1,091.00	5,127,700	貸付株式数	1,200株
日亜鋼業	9,400	277.00	2,603,800	貸付株式数	3,300株
日本精線	900	2,459.00	2,213,100		
エンビプロHD	2,400	589.00	1,413,600	貸付株式数	900株
大紀アルミニウム	10,800	712.00	7,689,600	貸付株式数	3,500株
日本軽金属HD	174,300	189.00	32,942,700	貸付株式数	6,300株
三井金属	17,200	2,366.00	40,695,200	貸付株式数	6,800株

東邦亜鉛	3,500	1,978.00	6,923,000	
三菱マテリアル	42,200	2,670.00	112,674,000	
住友鉱山	87,500	3,292.00	288,050,000	
DOWAホールディングス	14,900	3,460.00	51,554,000	貸付株式数 5,600株
古河機金	10,600	1,351.00	14,320,600	
エス・サイエンス	27,600	53.00	1,462,800	貸付株式数 11,000株 (7,200株)
大阪チタニウム	7,400	1,633.00	12,084,200	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
東邦チタニウム	11,400	806.00	9,188,400	貸付株式数 4,500株
UACJ	9,700	1,704.00	16,528,800	貸付株式数 3,800株
CKサンエツ	1,200	2,840.00	3,408,000	
古河電工	18,400	2,405.00	44,252,000	貸付株式数 7,000株
住友電工	238,900	1,299.00	310,331,100	
フジクラ	76,700	363.00	27,842,100	貸付株式数 30,400株
昭和電線HLDGS	7,700	779.00	5,998,300	貸付株式数 1,400株
東京特殊電線	800	1,832.00	1,465,600	
タツタ電線	12,900	451.00	5,817,900	貸付株式数 2,400株
カナレ電気	1,100	1,749.00	1,923,900	貸付株式数 200株
平河ヒューテック	2,700	1,065.00	2,875,500	貸付株式数 600株
リョービ	7,800	1,670.00	13,026,000	貸付株式数 3,000株
アーステイ	7,700	539.00	4,150,300	貸付株式数 1,000株
アサヒHD	12,000	2,309.00	27,708,000	
東洋製罐グループHD	40,600	1,604.00	65,122,400	
ホッカンホールディングス	3,300	1,469.00	4,847,700	
コロナ	3,500	1,009.00	3,531,500	貸付株式数 400株
横河ブリッジHLDGS	11,800	1,530.00	18,054,000	貸付株式数 1,200株
OSJBHD	31,700	230.00	7,291,000	
駒井ハルテック	1,200	1,462.00	1,754,400	貸付株式数 300株
高田機工	600	2,473.00	1,483,800	
三和ホールディングス	66,000	1,195.00	78,870,000	貸付株式数 24,600株
文化シャッタ-	18,800	897.00	16,863,600	貸付株式数 7,400株
三協立山	8,800	1,155.00	10,164,000	貸付株式数 2,100株
アルインコ	4,900	926.00	4,537,400	
東洋シャッタ-	1,600	672.00	1,075,200	
LIXILグループ	94,300	1,746.00	164,647,800	
日本ファイルコン	4,800	484.00	2,323,200	貸付株式数 1,700株
ノーリツ	13,600	1,211.00	16,469,600	
長府製作所	6,600	2,189.00	14,447,400	貸付株式数 2,400株
リンナイ	11,300	6,930.00	78,309,000	



ユニプレス	12,600	1,697.00	21,382,200	貸付株式数	4,600株
ダイニチ工業	3,300	618.00	2,039,400	貸付株式数	200株
日東精工	8,800	534.00	4,699,200		
三洋工業	900	1,790.00	1,611,000		
岡 部	13,100	825.00	10,807,500	貸付株式数	400株
ジーテクト	7,100	1,566.00	11,118,600		
中国工業	1,000	588.00	588,000		
東 プ レ	11,800	1,676.00	19,776,800	貸付株式数	2,300株
高周波熱錬	12,300	824.00	10,135,200	貸付株式数	4,500株
東京製綱	3,900	931.00	3,630,900	貸付株式数	1,300株
サンコール	3,700	468.00	1,731,600		
モリテックスチル	4,900	338.00	1,656,200		
パイオラックス	10,300	1,786.00	18,395,800	貸付株式数	1,100株
エイチワン	6,200	639.00	3,961,800	貸付株式数	2,300株
日本発条	63,700	778.00	49,558,600	貸付株式数	23,900株
中央発條	700	2,773.00	1,941,100	貸付株式数	200株
アドバネクス	800	1,669.00	1,335,200	貸付株式数	300株 (300株)
三浦工業	27,600	3,070.00	84,732,000	貸付株式数	10,900株
タ ク マ	23,300	1,207.00	28,123,100		
テクノプロ・ホールディング	12,400	6,160.00	76,384,000	貸付株式数	4,800株
アトラ	1,200	429.00	514,800	貸付株式数	400株
インターワークス	1,100	556.00	611,600		
アイ・アールジャパンHD	2,500	3,720.00	9,300,000	貸付株式数	400株
K e e P e r 技研	2,200	1,337.00	2,941,400		
ファーストロジック	1,400	645.00	903,000	貸付株式数	400株
三機サービス	1,300	912.00	1,185,600	貸付株式数	500株
G u n o s y	4,200	1,405.00	5,901,000	貸付株式数	1,600株
デザインワン・ジャパン	1,200	287.00	344,400	貸付株式数	400株
イー・ガーディアン	3,100	1,738.00	5,387,800		
リブセンス	3,300	256.00	844,800		
ジャパンマテリアル	16,900	1,188.00	20,077,200	貸付株式数	6,600株
ベクトル	7,600	949.00	7,212,400	貸付株式数	2,800株
ウチヤマホールディングス	3,000	500.00	1,500,000	貸付株式数	1,100株
チャームケアコーポレーション	2,000	1,923.00	3,846,000	貸付株式数	700株
ライクキッズネクスト	1,400	971.00	1,359,400	貸付株式数	500株
キャリアリンク	2,200	586.00	1,289,200	貸付株式数	800株
I B J	4,100	1,156.00	4,739,600	貸付株式数	1,500株

アサンテ	2,400	1,945.00	4,668,000	貸付株式数	900株
N・フィールド	4,000	615.00	2,460,000	貸付株式数	1,000株
バリューHR	1,300	2,873.00	3,734,900	貸付株式数	400株
M&Aキャピタルパートナー	2,200	6,490.00	14,278,000	貸付株式数	800株 (500株)
ライドオンエクスプレスHD	2,500	1,539.00	3,847,500		
ERIホールディングス	1,700	788.00	1,339,600		
アビスト	900	2,625.00	2,362,500	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	2,900	1,306.00	3,787,400		
ウィルグループ	3,900	836.00	3,260,400		
エスクローAJ	8,400	224.00	1,881,600	貸付株式数	3,300株
リクルートホールディングス	442,400	3,261.00	1,442,666,400		
エラン	4,000	1,807.00	7,228,000	貸付株式数	1,400株
ツガミ	14,300	917.00	13,113,100	貸付株式数	5,600株
オークマ	8,100	5,460.00	44,226,000		
東芝機械	7,200	2,160.00	15,552,000	貸付株式数	1,800株
アマダホールディングス	96,000	1,153.00	110,688,000		
アイダエンジニア	17,200	815.00	14,018,000		
滝澤鉄工所	2,000	1,270.00	2,540,000		
FUJI	25,400	1,515.00	38,481,000	貸付株式数	100株
牧野フライス	7,500	4,565.00	34,237,500		
オーエスジー	30,000	2,084.00	62,520,000	貸付株式数	11,900株
ダイジェット	700	1,460.00	1,022,000		
旭ダイヤモンド	16,700	629.00	10,504,300	貸付株式数	5,900株
DMG森精機	40,500	1,503.00	60,871,500	貸付株式数	15,900株
ソディック	15,200	763.00	11,597,600	貸付株式数	5,800株
ディスコ	8,700	20,310.00	176,697,000	貸付株式数	700株 (700株)
日東工器	3,400	2,090.00	7,106,000	貸付株式数	600株
日進工具	1,900	1,874.00	3,560,600	貸付株式数	700株
パンチ工業	4,400	483.00	2,125,200		
富士ダイス	2,700	578.00	1,560,600		
土木管理総合試験	2,600	421.00	1,094,600	貸付株式数	800株
ネットマーケティング	2,100	656.00	1,377,600		
日本郵政	505,800	971.00	491,131,800		
ベルシステム24HLDGS	10,300	1,638.00	16,871,400	貸付株式数	300株

鎌倉新書	4,500	1,683.00	7,573,500	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ソネット・メディア・ネットワー	700	609.00	426,300	貸付株式数 200株
一蔵	700	592.00	414,400	貸付株式数 200株
LITALICO	1,400	1,929.00	2,700,600	
グローバルキッズCOMP	900	874.00	786,600	貸付株式数 300株
エボラブルアジア	2,700	1,994.00	5,383,800	貸付株式数 1,000株
アトラエ	1,600	2,643.00	4,228,800	貸付株式数 600株
ストライク	2,300	2,725.00	6,267,500	貸付株式数 900株 (600株)
ソラスト	15,000	1,285.00	19,275,000	
セラク	1,900	724.00	1,375,600	貸付株式数 100株
インソース	3,000	2,448.00	7,344,000	
豊田自動織機	52,300	5,930.00	310,139,000	
豊和工業	3,500	754.00	2,639,000	貸付株式数 300株
OKK	2,700	706.00	1,906,200	貸付株式数 900株
石川製作所	1,500	1,443.00	2,164,500	貸付株式数 600株
東洋機械金属	4,600	561.00	2,580,600	貸付株式数 1,600株
津田駒工業	1,300	1,288.00	1,674,400	貸付株式数 500株 (500株)
エンシュウ	1,700	1,087.00	1,847,900	貸付株式数 300株
島精機製作所	8,800	2,522.00	22,193,600	貸付株式数 3,400株 (2,100株)
オプトラン	7,100	3,275.00	23,252,500	貸付株式数 2,800株
NCホールディングス	2,000	454.00	908,000	
イワキポンプ	2,700	944.00	2,548,800	
フリーー	5,000	926.00	4,630,000	
ヤマシンフィルタ	10,900	706.00	7,695,400	貸付株式数 4,300株 (2,100株)
日阪製作所	7,800	840.00	6,552,000	貸付株式数 900株
やまびこ	12,200	1,027.00	12,529,400	貸付株式数 2,700株
平田機工	3,000	6,620.00	19,860,000	
ペガサスミシン製造	5,900	496.00	2,926,400	
マルマエ	2,600	868.00	2,256,800	貸付株式数 1,000株
タツモ	2,900	1,142.00	3,311,800	貸付株式数 700株
ナブテスコ	37,600	3,260.00	122,576,000	貸付株式数 14,800株 (1,500株)
三井海洋開発	6,800	2,493.00	16,952,400	
レオン自動機	6,300	1,530.00	9,639,000	

S M C	18,900	43,610.00	824,229,000	貸付株式数	5,300株
ヤマハモーターロボHLD GS	4,700	413.00	1,941,100	貸付株式数	1,800株
ホソカワミクロン	2,200	3,785.00	8,327,000		
ユニオンツール	2,600	3,200.00	8,320,000		
オイレス工業	8,800	1,507.00	13,261,600		
日精エーエスビー	2,100	3,240.00	6,804,000	貸付株式数	800株
サト - ホールディングス	7,700	2,713.00	20,890,100		
技研製作所	5,600	3,405.00	19,068,000		
日本エアーテック	1,900	575.00	1,092,500	貸付株式数	600株
カワタ	1,700	937.00	1,592,900	貸付株式数	600株
日精樹脂工業	5,500	986.00	5,423,000	貸付株式数	400株
オカダアイヨン	2,200	1,133.00	2,492,600	貸付株式数	600株
ワイエイシイホールディン グス	2,600	668.00	1,736,800		
小松製作所	292,600	2,343.00	685,561,800	貸付株式数	115,800株 (7,000株)
住友重機械	37,000	3,140.00	116,180,000	貸付株式数	4,600株
日立建機	25,900	2,368.00	61,331,200		
日工	1,700	3,140.00	5,338,000	貸付株式数	500株
巴工業	2,700	2,304.00	6,220,800		
井関農機	6,500	1,386.00	9,009,000	貸付株式数	2,400株
TOWA	5,500	745.00	4,097,500	貸付株式数	1,600株
丸山製作所	1,300	1,158.00	1,505,400		
北川鉄工所	3,000	1,905.00	5,715,000	貸付株式数	100株
シンニッタン	9,800	438.00	4,292,400	貸付株式数	3,400株
ローツェ	2,900	2,354.00	6,826,600	貸付株式数	1,100株
タカキタ	2,200	529.00	1,163,800	貸付株式数	800株
クボタ	346,300	1,582.50	548,019,750	貸付株式数	137,000株
荏原実業	1,800	1,999.00	3,598,200	貸付株式数	500株
東洋エンジニア	8,500	597.00	5,074,500	貸付株式数	900株 (700株)
三菱化工機	2,200	1,718.00	3,779,600	貸付株式数	100株
月島機械	12,700	1,312.00	16,662,400	貸付株式数	4,400株
帝国電機製作所	4,400	1,141.00	5,020,400		
東京機械	2,500	368.00	920,000		
新東工業	15,400	936.00	14,414,400	貸付株式数	5,900株
渋谷工業	5,700	2,694.00	15,355,800	貸付株式数	2,200株
アイチ コーポレーション	11,000	661.00	7,271,000	貸付株式数	1,900株
小森コーポレーション	16,200	1,082.00	17,528,400	貸付株式数	6,200株

鶴見製作所	5,000	1,991.00	9,955,000	貸付株式数	700株
住友精密	1,000	2,943.00	2,943,000	貸付株式数	200株
日本ギア工業	1,700	489.00	831,300	貸付株式数	600株
酒井重工業	1,200	2,690.00	3,228,000	貸付株式数	400株
荏原製作所	28,700	2,640.00	75,768,000	貸付株式数	11,300株
石井鉄工所	1,100	1,995.00	2,194,500	貸付株式数	300株
西島製作所	6,500	1,035.00	6,727,500		
北越工業	6,700	1,209.00	8,100,300	貸付株式数	200株
ダイキン工業	88,200	14,060.00	1,240,092,000		
オルガノ	2,300	4,370.00	10,051,000	貸付株式数	700株
ト - ヨ - カネツ	2,400	1,796.00	4,310,400	貸付株式数	500株
栗田工業	34,900	2,856.00	99,674,400	貸付株式数	1,000株
椿本チエイン	8,500	3,295.00	28,007,500		
大同工業	3,100	790.00	2,449,000		
日 機 装	19,800	1,130.00	22,374,000	貸付株式数	5,800株
木村化工機	5,500	365.00	2,007,500	貸付株式数	800株
レイズネクスト	13,100	1,169.00	15,313,900	貸付株式数	4,800株
アネスト岩田	10,000	897.00	8,970,000	貸付株式数	3,900株
ダイフク	35,600	5,170.00	184,052,000	貸付株式数	14,000株
サムコ	1,800	811.00	1,459,800	貸付株式数	500株
加藤製作所	3,300	1,763.00	5,817,900		
油研工業	1,000	1,572.00	1,572,000	貸付株式数	300株
タダノ	31,100	991.00	30,820,100	貸付株式数	12,300株
フジテック	23,500	1,266.00	29,751,000	貸付株式数	2,700株
C K D	17,900	1,206.00	21,587,400	貸付株式数	700株
キトー	4,900	1,498.00	7,340,200		
平和	18,000	2,108.00	37,944,000	貸付株式数	7,100株
理想科学工業	5,700	1,723.00	9,821,100	貸付株式数	2,200株
S A N K Y O	16,200	3,680.00	59,616,000		
日本金銭機械	7,200	945.00	6,804,000	貸付株式数	500株
マースグループH L D G S	4,100	1,874.00	7,683,400	貸付株式数	1,600株
福島工業	3,900	3,080.00	12,012,000	貸付株式数	400株
オーイズミ	2,800	421.00	1,178,800	貸付株式数	300株
ダイコク電機	2,900	1,516.00	4,396,400	貸付株式数	1,100株
竹内製作所	10,700	1,599.00	17,109,300		
ア マ ノ	18,500	3,255.00	60,217,500	貸付株式数	5,800株
J U K I	9,000	857.00	7,713,000	貸付株式数	3,500株
サンデンホールディングス	7,700	522.00	4,019,400	貸付株式数	2,900株
蛇の目マシン	5,800	378.00	2,192,400	貸付株式数	1,800株
ブラザー工業	84,200	1,878.00	158,127,600	貸付株式数	3,300株

マックス	10,000	1,737.00	17,370,000	貸付株式数	2,500株
モリタホールディングス	11,300	1,639.00	18,520,700	貸付株式数	4,000株
グローリー	17,900	2,940.00	52,626,000	貸付株式数	2,600株
新晃工業	5,900	1,700.00	10,030,000	貸付株式数	700株
大和冷機工業	9,200	1,058.00	9,733,600	貸付株式数	3,400株
セガサミーホールディングス	64,000	1,494.00	95,616,000	貸付株式数	2,300株
日本ピストンリング	2,300	1,264.00	2,907,200	貸付株式数	400株
リケン	3,000	3,670.00	11,010,000	貸付株式数	400株
TPR	8,800	1,699.00	14,951,200	貸付株式数	2,700株
ツバキ・ナカシマ	13,200	1,614.00	21,304,800	貸付株式数	3,400株
ホシザキ	18,800	7,780.00	146,264,000	貸付株式数	7,400株
大豊工業	5,200	774.00	4,024,800	貸付株式数	800株
日本精工	132,700	901.00	119,562,700		
N T N	138,900	302.00	41,947,800		
ジェイテクト	62,000	1,194.00	74,028,000	貸付株式数	6,000株
不二越	6,100	4,525.00	27,602,500	貸付株式数	300株
ミネベアミツミ	120,100	1,771.00	212,697,100		
日本トムソン	19,200	437.00	8,390,400		
THK	38,300	2,712.00	103,869,600	貸付株式数	15,300株
ユーシン精機	4,900	1,020.00	4,998,000		
前澤給装工業	2,500	1,937.00	4,842,500	貸付株式数	900株
イーグル工業	7,900	996.00	7,868,400	貸付株式数	2,000株
前澤工業	4,400	330.00	1,452,000		
日本ピラ - 工業	6,500	1,116.00	7,254,000	貸付株式数	1,000株
キッツ	26,100	688.00	17,956,800	貸付株式数	9,700株
日立	290,900	3,963.00	1,152,836,700		
三菱電機	646,400	1,344.50	869,084,800		
富士電機	41,900	3,180.00	133,242,000		
東洋電機製造	2,700	1,533.00	4,139,100	貸付株式数	300株
安川電機	74,900	3,850.00	288,365,000		
シンフォニアテクノロジー	9,000	1,181.00	10,629,000		
明電舎	12,800	1,792.00	22,937,600		
オリジン	1,700	1,377.00	2,340,900		
山洋電気	3,100	4,430.00	13,733,000		
デンヨー	6,000	1,634.00	9,804,000		
ベイカレントコンサルティング	4,400	4,725.00	20,790,000		

ORCHESTRA HLDGS	1,200	1,117.00	1,340,400	貸付株式数	400株
アイモバイル	1,900	737.00	1,400,300	貸付株式数	700株
キャリアインデックス	2,100	456.00	957,600	貸付株式数	800株
MS - Japan	2,500	1,391.00	3,477,500	貸付株式数	900株
船場	900	901.00	810,900		
グレイステクノロジー	2,200	3,040.00	6,688,000	貸付株式数	800株
ジャパンエレベーターSHD	4,900	2,603.00	12,754,700	貸付株式数	1,800株
フルテック	800	1,230.00	984,000		
グリーンズ	2,300	1,349.00	3,102,700		
ツナググループHLDGS	700	580.00	406,000	貸付株式数	200株
ソウルドアウト	900	1,406.00	1,265,400		
MS&CONSULTING	1,000	924.00	924,000		
日総工産	4,200	1,055.00	4,431,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
キュービーネットHLDGS	3,700	2,222.00	8,221,400	貸付株式数	1,400株
RPAホールディングス	2,600	1,693.00	4,401,800	貸付株式数	1,000株
三桜工業	8,000	497.00	3,976,000	貸付株式数	3,200株
マキタ	78,600	3,200.00	251,520,000	貸付株式数	29,400株
東芝テック	8,100	3,050.00	24,705,000	貸付株式数	1,500株
芝浦メカトロニクス	1,200	2,882.00	3,458,400	貸付株式数	400株
マブチモーター	17,800	3,930.00	69,954,000	貸付株式数	7,000株
日本電産	77,800	14,095.00	1,096,591,000	貸付株式数	28,800株
ユーエムシーエレクトロニクス	3,400	774.00	2,631,600		
トレックス・セミコンダクター	2,900	1,150.00	3,335,000	貸付株式数	400株
東光高岳	3,400	1,099.00	3,736,600		
ダブル・スコープ	9,000	618.00	5,562,000	貸付株式数	3,400株 (100株)
宮越ホールディングス	2,400	1,041.00	2,498,400	貸付株式数	900株 (100株)
ダイヘン	7,000	3,205.00	22,435,000		
ヤーマン	9,300	821.00	7,635,300	貸付株式数	3,700株
JVCケンウッド	49,100	312.00	15,319,200		
ミマキエンジニアリング	5,700	508.00	2,895,600	貸付株式数	2,100株

第一精工	2,600	2,292.00	5,959,200	貸付株式数 900株 (500株)
日新電機	15,100	1,326.00	20,022,600	
大崎電気	12,400	642.00	7,960,800	
オムロン	68,700	5,700.00	391,590,000	
日東工業	10,300	1,991.00	20,507,300	貸付株式数 3,600株
I D E C	8,700	1,855.00	16,138,500	貸付株式数 2,400株
正興電機製作所	1,400	712.00	996,800	
不二電機工業	700	1,198.00	838,600	貸付株式数 200株 (200株)
ジーエス・ユアサ コーポ	23,300	1,805.00	42,056,500	貸付株式数 3,500株
サクサホールディングス	1,600	1,759.00	2,814,400	貸付株式数 200株
メルコホールディングス	2,600	2,759.00	7,173,400	貸付株式数 600株
テクノメディカ	1,500	2,027.00	3,040,500	貸付株式数 500株
日本電気	83,600	4,545.00	379,962,000	貸付株式数 13,300株 (100株)
富士通	62,200	8,550.00	531,810,000	
沖電気	27,900	1,426.00	39,785,400	貸付株式数 11,100株
岩崎通信機	2,900	772.00	2,238,800	貸付株式数 1,100株
電気興業	3,400	2,895.00	9,843,000	貸付株式数 700株
サンケン電気	7,600	1,997.00	15,177,200	貸付株式数 2,700株
ナカヨ	1,200	1,619.00	1,942,800	
アイホン	3,700	1,602.00	5,927,400	貸付株式数 1,100株
ルネサスエレクトロニクス	307,200	683.00	209,817,600	貸付株式数 121,400株
セイコーエプソン	80,200	1,454.00	116,610,800	
ワコム	46,500	340.00	15,810,000	貸付株式数 17,300株
アルバック	12,900	4,595.00	59,275,500	貸付株式数 5,000株
アクセル	2,700	629.00	1,698,300	貸付株式数 1,000株
E I Z O	5,900	3,630.00	21,417,000	貸付株式数 600株
ジャパンディスプレイ	141,700	67.00	9,493,900	貸付株式数 55,600株
日本信号	16,400	1,194.00	19,581,600	
京三製作所	13,400	353.00	4,730,200	貸付株式数 4,700株
能美防災	8,500	2,128.00	18,088,000	貸付株式数 3,100株
ホーチキ	4,000	1,401.00	5,604,000	
星和電機	3,300	508.00	1,676,400	貸付株式数 1,000株
エレコム	6,100	4,320.00	26,352,000	貸付株式数 2,400株
パナソニック	737,900	852.20	628,838,380	
シャープ	64,100	1,186.00	76,022,600	貸付株式数 25,300株 (1,000株)
アンリツ	41,600	1,979.00	82,326,400	貸付株式数 16,600株



富士通ゼネラル	19,700	1,768.00	34,829,600	貸付株式数	7,800株
ソ ニ ー	433,800	6,496.00	2,817,964,800		
T D K	33,800	9,290.00	314,002,000		
帝国通信工業	2,800	1,072.00	3,001,600		
タムラ製作所	25,200	571.00	14,389,200	貸付株式数	2,800株
アルプスアルパイン	67,200	1,906.00	128,083,200		
池上通信機	2,000	1,015.00	2,030,000	貸付株式数	900株
日本電波工業	5,800	436.00	2,528,800	貸付株式数	2,200株
鈴木	3,500	620.00	2,170,000		
日本トリム	1,200	4,555.00	5,466,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,500	1,973.00	6,905,500	貸付株式数	1,300株
フオスタ - 電機	7,300	1,820.00	13,286,000	貸付株式数	2,700株
S M K	1,800	2,700.00	4,860,000	貸付株式数	700株
ヨコオ	4,600	2,784.00	12,806,400		
ティアック	4,500	192.00	864,000	貸付株式数	1,700株
ホシデン	19,200	1,016.00	19,507,200		
ヒロセ電機	9,200	13,190.00	121,348,000	貸付株式数	3,400株
日本航空電子	14,800	1,478.00	21,874,400	貸付株式数	5,500株
T O A	6,800	1,219.00	8,289,200	貸付株式数	2,600株
マクセルホールディングス	13,900	1,540.00	21,406,000	貸付株式数	5,200株
古野電気	8,300	934.00	7,752,200	貸付株式数	1,000株
ユニデンホールディングス	1,900	1,778.00	3,378,200	貸付株式数	600株
スミダコーポレーション	5,400	1,006.00	5,432,400	貸付株式数	1,900株 (1,700株)
アイコム	3,500	2,168.00	7,588,000		
リオン	3,000	2,245.00	6,735,000	貸付株式数	900株
本多通信工業	5,400	474.00	2,559,600	貸付株式数	2,100株
船井電機	6,800	540.00	3,672,000	貸付株式数	2,500株 (2,400株)
横河電機	64,700	1,939.00	125,453,300		
新電元工業	2,300	3,210.00	7,383,000		
アズビル	40,700	2,799.00	113,919,300		
東亜ディーケーケー	3,100	834.00	2,585,400	貸付株式数	1,200株
日本光電工業	28,500	2,994.00	85,329,000		
チ ノ ー	2,300	1,342.00	3,086,600		
共和電業	6,700	406.00	2,720,200	貸付株式数	100株
日本電子材料	2,700	500.00	1,350,000	貸付株式数	1,000株
堀場製作所	12,800	5,880.00	75,264,000	貸付株式数	5,000株

アドバンテスト	44,100	4,555.00	200,875,500		
小野測器	2,800	492.00	1,377,600	貸付株式数	1,000株
エスベック	5,800	1,857.00	10,770,600	貸付株式数	1,000株
キーエンス	31,700	65,290.00	2,069,693,000		
日置電機	3,400	3,310.00	11,254,000		
シスメックス	50,300	6,908.00	347,472,400	貸付株式数	1,300株
日本マイクロニクス	11,300	826.00	9,333,800		
メガチップス	5,000	1,599.00	7,995,000	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,300	3,600.00	11,880,000	貸付株式数	1,100株
IMAGICA GROUP	5,100	466.00	2,376,600		
澤藤電機	800	1,676.00	1,340,800		
デンソー	142,300	4,596.00	654,010,800	貸付株式数	20,200株
原田工業	2,600	826.00	2,147,600	貸付株式数	1,000株
コーセル	8,100	1,070.00	8,667,000	貸付株式数	3,000株
イリソ電子工業	5,900	4,960.00	29,264,000	貸付株式数	2,300株
オプテックスグループ	10,700	1,530.00	16,371,000	貸付株式数	1,700株
千代田インテグレ	3,000	1,986.00	5,958,000	貸付株式数	600株
アイ・オー・データ	2,400	874.00	2,097,600		
レーザーテック	13,200	6,580.00	86,856,000	貸付株式数	5,200株
スタンレー電気	45,500	2,654.00	120,757,000	貸付株式数	6,000株
岩崎電気	2,800	1,181.00	3,306,800	貸付株式数	800株
ウシオ電機	37,400	1,473.00	55,090,200	貸付株式数	14,800株
岡谷電機	4,500	371.00	1,669,500		
ヘリオステクノH	6,100	542.00	3,306,200	貸付株式数	2,300株
エノモト	1,700	907.00	1,541,900		
日本セラミック	6,600	2,722.00	17,965,200	貸付株式数	700株
遠藤照明	3,500	647.00	2,264,500		
古河電池	5,000	573.00	2,865,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
双信電機	3,100	437.00	1,354,700	貸付株式数	1,200株
山一電機	4,700	1,184.00	5,564,800	貸付株式数	1,800株
図研	4,100	1,865.00	7,646,500		
日本電子	12,800	2,434.00	31,155,200	貸付株式数	300株
カシオ	57,000	1,573.00	89,661,000	貸付株式数	15,800株
ファナック	61,400	18,860.00	1,158,004,000		
日本シイエムケイ	16,500	548.00	9,042,000	貸付株式数	6,400株
エンプラス	2,900	3,260.00	9,454,000		
大真空	2,400	991.00	2,378,400		

ローム	30,900	8,230.00	254,307,000	
浜松ホトニクス	46,300	3,720.00	172,236,000	
三井ハイテック	7,100	1,415.00	10,046,500	貸付株式数 2,800株 (200株)
新光電気工業	21,700	898.00	19,486,600	
京セラ	98,500	6,577.00	647,834,500	
協栄産業	700	1,310.00	917,000	貸付株式数 100株
太陽誘電	28,700	2,265.00	65,005,500	貸付株式数 11,400株
村田製作所	203,400	4,818.00	979,981,200	
双葉電子工業	10,400	1,289.00	13,405,600	貸付株式数 3,600株
日東電工	44,600	5,173.00	230,715,800	
北陸電気工業	2,500	976.00	2,440,000	
東海理化電機	17,200	1,742.00	29,962,400	貸付株式数 5,400株
ニチコン	20,200	918.00	18,543,600	貸付株式数 1,800株
日本ケミコン	4,600	1,420.00	6,532,000	貸付株式数 1,700株
K O A	9,600	1,271.00	12,201,600	
三井E & S H D	21,700	842.00	18,271,400	
日立造船	51,200	326.00	16,691,200	貸付株式数 20,100株
三菱重工業	108,300	4,132.00	447,495,600	
川崎重工業	50,200	2,164.00	108,632,800	
I H I	49,600	2,237.00	110,955,200	
名村造船所	19,100	253.00	4,832,300	
サノヤホールディングス	8,300	177.00	1,469,100	貸付株式数 3,300株
スプリックス	2,000	1,493.00	2,986,000	貸付株式数 800株
日本車輛	2,300	2,320.00	5,336,000	貸付株式数 900株
三菱ロジスネクスト	10,600	1,098.00	11,638,800	貸付株式数 3,000株
近畿車輛	1,000	1,292.00	1,292,000	貸付株式数 100株
F P G	19,900	1,103.00	21,949,700	
島根銀行	1,400	713.00	998,200	貸付株式数 200株
じもとホールディングス	42,200	98.00	4,135,600	貸付株式数 2,600株
全国保証	18,000	4,025.00	72,450,000	貸付株式数 7,000株
めぶきフィナンシャルG	332,100	242.00	80,368,200	貸付株式数 42,200株
東京きらぼしF G	8,500	1,313.00	11,160,500	
九州フィナンシャルG	104,600	411.00	42,990,600	
かんば生命保険	22,500	1,554.00	34,965,000	
ゆうちょ銀行	180,400	1,006.00	181,482,400	貸付株式数 71,400株
富山第一銀行	15,700	281.00	4,411,700	
コンコルディア・フィナンシャル	399,700	378.00	151,086,600	
ジェイリース	1,700	306.00	520,200	貸付株式数 600株

西日本フィナンシャルHD	40,100	662.00	26,546,200		
マーキュリアインベストメント	2,600	729.00	1,895,400	貸付株式数	1,000株
イントラスト	1,700	654.00	1,111,800	貸付株式数	600株
日本モーゲージサービス	1,100	1,065.00	1,171,500	貸付株式数	400株
C a s a	2,800	1,227.00	3,435,600		
アルヒ	5,800	2,184.00	12,667,200	貸付株式数	2,200株
プレミアグループ	3,700	1,876.00	6,941,200	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
日産自動車	761,400	672.50	512,041,500		
いすゞ自動車	204,100	1,161.50	237,062,150		
トヨタ自動車	720,200	7,092.00	5,107,658,400		
日野自動車	80,500	870.00	70,035,000		
三菱自動車工業	238,800	464.00	110,803,200	貸付株式数	89,500株
エフテック	4,400	696.00	3,062,400		
レシップホールディングス	3,900	776.00	3,026,400	貸付株式数	800株
G M B	1,200	735.00	882,000		
ファルテック	1,100	719.00	790,900		
武蔵精密工業	15,700	1,280.00	20,096,000		
日産車体	12,400	950.00	11,780,000	貸付株式数	3,100株
新明和工業	27,100	1,312.00	35,555,200	貸付株式数	9,300株
極東開発工業	12,900	1,188.00	15,325,200	貸付株式数	3,600株
日信工業	11,800	1,398.00	16,496,400		
トピー工業	5,300	1,910.00	10,123,000		
ティラド	2,300	1,743.00	4,008,900	貸付株式数	100株
タチエス	10,700	1,237.00	13,235,900	貸付株式数	2,900株
N O K	34,800	1,551.00	53,974,800	貸付株式数	13,000株
フタバ産業	18,100	725.00	13,122,500	貸付株式数	6,200株
K Y B	6,700	2,971.00	19,905,700	貸付株式数	2,600株
市光工業	9,500	778.00	7,391,000	貸付株式数	1,000株
大同メタル工業	10,400	619.00	6,437,600	貸付株式数	3,300株
プレス工業	32,100	453.00	14,541,300	貸付株式数	11,900株
ミクニ	8,400	308.00	2,587,200		
太平洋工業	13,600	1,477.00	20,087,200	貸付株式数	4,900株
ケーヒン	14,800	1,532.00	22,673,600		
河西工業	8,000	773.00	6,184,000		
アイシン精機	53,200	3,310.00	176,092,000		
マ ッ ダ	202,900	928.70	188,433,230		
今仙電機製作所	6,200	849.00	5,263,800	貸付株式数	100株
本田技研	545,300	2,727.00	1,487,033,100		

スズキ	118,100	4,165.00	491,886,500	貸付株式数	43,800株
S U B A R U	200,500	2,946.50	590,773,250		
安永	3,100	1,319.00	4,088,900	貸付株式数	1,100株
ヤマハ発動機	86,800	1,824.00	158,323,200	貸付株式数	34,700株
ショーワ	15,300	1,390.00	21,267,000		
小糸製作所	38,700	5,030.00	194,661,000	貸付株式数	7,400株
T B K	7,500	386.00	2,895,000	貸付株式数	2,400株
エクセディ	8,700	2,027.00	17,634,900	貸付株式数	600株
ミツバ	11,800	567.00	6,690,600	貸付株式数	2,300株
豊田合成	20,900	2,052.00	42,886,800		
愛三工業	10,100	757.00	7,645,700		
盟和産業	1,000	1,038.00	1,038,000	貸付株式数	200株
日本プラスト	5,000	676.00	3,380,000		
ヨロズ	6,000	1,269.00	7,614,000		
エフ・シー・シー	11,600	2,007.00	23,281,200	貸付株式数	4,500株
新家工業	1,600	1,358.00	2,172,800		
シマノ	24,800	15,760.00	390,848,000	貸付株式数	9,700株
テイ・エス テック	15,000	2,961.00	44,415,000		
関西みらいFG	30,100	691.00	20,799,100	貸付株式数	8,800株
33FG	5,700	1,596.00	9,097,200		
第四北越フィナンシャルG	11,100	2,490.00	27,639,000	貸付株式数	100株
ジャムコ	3,200	1,450.00	4,640,000	貸付株式数	900株 (900株)
小野建	5,700	1,319.00	7,518,300	貸付株式数	1,700株 (1,400株)
はるやまHLDGS	2,900	788.00	2,285,200	貸付株式数	1,000株
南陽	1,300	1,519.00	1,974,700		
ノジマ	11,200	1,764.00	19,756,800	貸付株式数	4,400株
佐島電機	4,900	780.00	3,822,000	貸付株式数	1,500株
カッパ・クリエイト	9,000	1,397.00	12,573,000	貸付株式数	3,500株
エコートレーディング	1,500	518.00	777,000		
伯東	4,600	1,119.00	5,147,400		
コンドーテック	5,100	882.00	4,498,200	貸付株式数	1,000株
中山福	3,500	499.00	1,746,500	貸付株式数	100株
ライトオン	5,000	648.00	3,240,000	貸付株式数	1,500株 (1,400株)
ナガイレーベン	9,100	2,171.00	19,756,100	貸付株式数	3,000株
ジーンズメイト	1,900	313.00	594,700	貸付株式数	700株
三菱食品	7,000	2,571.00	17,997,000	貸付株式数	2,300株
良品計画	90,000	1,962.00	176,580,000		

三城ホールディングス	7,700	300.00	2,310,000	貸付株式数	2,900株
松田産業	4,600	1,437.00	6,610,200	貸付株式数	600株
第一興商	9,400	4,835.00	45,449,000		
メディパルHD	68,700	2,340.00	160,758,000		
アドヴァン	9,800	1,150.00	11,270,000		
S P K	1,300	2,365.00	3,074,500		
萩原電気HLDGS	2,400	2,712.00	6,508,800	貸付株式数	100株
アルピス	2,400	2,384.00	5,721,600	貸付株式数	900株
アズワン	4,500	9,000.00	40,500,000	貸付株式数	800株
スズデン	2,200	1,326.00	2,917,200	貸付株式数	800株
尾家産業	2,000	1,138.00	2,276,000	貸付株式数	800株
シモジマ	4,000	1,080.00	4,320,000		
ドウシシャ	5,900	1,752.00	10,336,800	貸付株式数	600株
小津産業	1,400	1,765.00	2,471,000		
コナカ	7,700	430.00	3,311,000	貸付株式数	100株
高速	3,900	1,221.00	4,761,900	貸付株式数	100株
ハウス ローゼ	800	1,595.00	1,276,000		
G - 7ホールディングス	1,900	3,140.00	5,966,000		
たけびし	2,700	1,287.00	3,474,900		
イオン北海道	7,000	729.00	5,103,000	貸付株式数	800株
コジマ	11,000	457.00	5,027,000		
ヒマラヤ	2,200	789.00	1,735,800		
コーナン商事	8,400	2,357.00	19,798,800	貸付株式数	3,300株
ネットワンシステムズ	22,400	2,931.00	65,654,400	貸付株式数	7,200株
エコス	2,400	1,562.00	3,748,800		
ワタミ	8,400	1,438.00	12,079,200	貸付株式数	3,200株
マルシェ	1,500	778.00	1,167,000	貸付株式数	600株
リックス	1,400	1,484.00	2,077,600		
システムソフト	14,500	107.00	1,551,500	貸付株式数	2,200株
パンパシフィックHD	152,500	1,695.00	258,487,500	貸付株式数	600株
丸文	6,000	553.00	3,318,000	貸付株式数	100株
西松屋チェーン	13,700	900.00	12,330,000	貸付株式数	200株 (200株)
ゼンショーホールディングス	30,900	2,409.00	74,438,100	貸付株式数	12,200株
ハピネット	5,200	1,272.00	6,614,400		
幸楽苑ホールディングス	4,100	2,500.00	10,250,000	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,500	1,023.00	1,534,500		
橋本総業HLDGS	1,300	1,500.00	1,950,000		

日本ライフライン	18,800	1,718.00	32,298,400	貸付株式数	7,400株
サイゼリヤ	10,500	2,703.00	28,381,500	貸付株式数	100株
タカショー	3,000	457.00	1,371,000		
エクセル	2,300	1,112.00	2,557,600	貸付株式数	900株
V Tホールディングス	28,300	450.00	12,735,000		
マルカ	2,300	1,942.00	4,466,600		
アルゴグラフィックス	5,400	2,550.00	13,770,000		
魚力	1,800	1,545.00	2,781,000	貸付株式数	700株
I D O M	21,200	419.00	8,882,800	貸付株式数	8,400株
日本エム・ディ・エム	3,700	1,762.00	6,519,400	貸付株式数	600株
ポプラ	1,600	479.00	766,400	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	1,600	2,156.00	3,449,600	貸付株式数	100株
ユナイテッドアローズ	7,200	3,330.00	23,976,000	貸付株式数	2,600株 (1,900株)
進和	3,800	2,081.00	7,907,800	貸付株式数	1,300株
エスケイジャパン	1,500	407.00	610,500	貸付株式数	500株
ダイトロン	2,900	1,236.00	3,584,400		
ハイデイ日高	9,200	2,119.00	19,494,800	貸付株式数	3,400株
シークス	8,000	1,403.00	11,224,000	貸付株式数	3,100株
京都きもの友禅	4,000	339.00	1,356,000	貸付株式数	1,600株
コロワイド	21,100	2,119.00	44,710,900	貸付株式数	8,300株
ピーシーデポコーポ	8,300	511.00	4,241,300	貸付株式数	500株 (500株)
田中商事	2,400	620.00	1,488,000	貸付株式数	800株
オーハシテクニカ	3,600	1,386.00	4,989,600	貸付株式数	1,300株
壱番屋	4,500	5,130.00	23,085,000	貸付株式数	600株 (100株)
白銅	2,000	1,291.00	2,582,000		
トップカルチャー	2,200	343.00	754,600	貸付株式数	800株 (600株)
P L A N T	1,600	710.00	1,136,000	貸付株式数	600株
スギホールディングス	14,000	5,680.00	79,520,000	貸付株式数	5,500株
薬王堂ホールディングス	2,800	2,484.00	6,955,200		
島津製作所	83,100	2,656.00	220,713,600	貸付株式数	2,900株
J M S	6,200	615.00	3,813,000	貸付株式数	1,700株
クボテック	1,300	423.00	549,900	貸付株式数	500株
長野計器	5,100	686.00	3,498,600	貸付株式数	800株
ブイ・テクノロジー	3,000	5,450.00	16,350,000	貸付株式数	1,100株
スター精密	10,400	1,494.00	15,537,600		

東京計器	4,100	862.00	3,534,200	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
愛知時計	900	3,935.00	3,541,500	貸付株式数 100株
インターアクション	3,500	2,030.00	7,105,000	貸付株式数 1,300株
オーバル	6,300	224.00	1,411,200	貸付株式数 800株
東京精密	11,700	3,110.00	36,387,000	貸付株式数 2,900株
マニー	25,800	2,515.00	64,887,000	貸付株式数 300株
ニコン	112,200	1,353.00	151,806,600	
トプコン	34,600	1,330.00	46,018,000	貸付株式数 1,400株
オリンパス	385,000	1,399.00	538,615,000	貸付株式数 152,400株
理研計器	5,700	1,910.00	10,887,000	貸付株式数 1,600株

SCREENホールディングス	11,200	6,330.00	70,896,000	貸付株式数 4,400株
キヤノン電子	6,800	1,778.00	12,090,400	
タムロン	5,400	2,186.00	11,804,400	
HOYA	130,100	9,194.00	1,196,139,400	
シード	2,700	874.00	2,359,800	貸付株式数 1,000株
ノーリツ鋼機	5,100	1,878.00	9,577,800	
エー・アンド・デイ	5,900	703.00	4,147,700	貸付株式数 1,300株
朝日インテック	54,900	2,444.00	134,175,600	貸付株式数 21,700株
キヤノン	347,500	2,809.00	976,127,500	貸付株式数 137,500株
リコー	194,300	968.00	188,082,400	
シチズン時計	69,600	517.00	35,983,200	
リズム時計	2,100	917.00	1,925,700	貸付株式数 800株
大研医器	5,000	522.00	2,610,000	貸付株式数 1,900株
メニコン	8,700	3,970.00	34,539,000	貸付株式数 400株
シンシア	900	641.00	576,900	貸付株式数 300株
中本パックス	1,800	1,388.00	2,498,400	貸付株式数 700株
スノーピーク	2,800	1,315.00	3,682,000	
パラマウントベッドHD	7,400	4,010.00	29,674,000	
トランザクション	4,200	1,111.00	4,666,200	貸付株式数 1,600株
SHOBI	1,800	379.00	682,200	貸付株式数 600株
ニホンフラッシュ	2,800	2,522.00	7,061,600	貸付株式数 300株
前田工織	7,100	1,400.00	9,940,000	貸付株式数 2,700株
永大産業	8,300	318.00	2,639,400	
アートネイチャー	6,800	636.00	4,324,800	貸付株式数 1,500株
バンダイナムコHLDGS	66,800	6,400.00	427,520,000	
アイフィスジャパン	1,500	713.00	1,069,500	貸付株式数 100株
共立印刷	10,400	147.00	1,528,800	



SHOEI	3,100	4,455.00	13,810,500	貸付株式数	1,200株
フランスベッドHLDGS	9,000	1,007.00	9,063,000		
マーベラス	9,500	822.00	7,809,000	貸付株式数	3,600株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	11,300	3,745.00	42,318,500	貸付株式数	4,400株
萩原工業	3,500	1,394.00	4,879,000		
エイベックス	10,800	1,256.00	13,564,800		
トッパン・フォームズ	13,600	946.00	12,865,600	貸付株式数	5,100株
フジシールインターナショナル	14,400	2,819.00	40,593,600	貸付株式数	1,800株
タカラトミー	26,700	1,112.00	29,690,400	貸付株式数	9,300株
廣済堂	6,000	698.00	4,188,000		
エステールホールディングス	1,600	624.00	998,400	貸付株式数	600株
アーク	24,600	90.00	2,214,000	貸付株式数	300株
レック	6,800	972.00	6,609,600	貸付株式数	2,400株
タカノ	2,500	732.00	1,830,000	貸付株式数	900株
三光合成	7,400	348.00	2,575,200	貸付株式数	100株
プロネクサス	5,500	1,050.00	5,775,000	貸付株式数	1,900株
ホクシン	3,700	145.00	536,500		
ウッドワン	2,100	1,018.00	2,137,800		
大建工業	5,000	1,862.00	9,310,000	貸付株式数	1,900株
きもと	10,800	175.00	1,890,000	貸付株式数	4,300株
凸版印刷	96,200	1,813.00	174,410,600		
大日本印刷	91,000	2,407.00	219,037,000		
共同印刷	2,000	2,626.00	5,252,000	貸付株式数	300株
NISSHA	13,300	985.00	13,100,500	貸付株式数	5,200株 (2,700株)
光村印刷	600	1,648.00	988,800	貸付株式数	200株
藤森工業	5,800	2,937.00	17,034,600		
ヴィア・ホールディングス	7,600	664.00	5,046,400		
宝印刷	3,100	1,616.00	5,009,600	貸付株式数	200株
前澤化成工業	4,400	1,129.00	4,967,600	貸付株式数	1,600株
未来工業	3,500	1,875.00	6,562,500		
アシックス	57,900	1,502.00	86,965,800	貸付株式数	22,800株
ツツミ	2,000	1,936.00	3,872,000		
ウェーブロックHLDGS	1,800	722.00	1,299,600		
ジェイエスピー	3,700	1,736.00	6,423,200		
ニチハ	9,000	2,754.00	24,786,000	貸付株式数	1,200株

エフピコ	7,100	6,740.00	47,854,000	貸付株式数 1,000株 (400株)
小松ウオール工業	1,900	1,871.00	3,554,900	貸付株式数 300株
ヤマハ	38,200	4,615.00	176,293,000	
河合楽器	2,000	2,865.00	5,730,000	貸付株式数 700株
クリナップ	5,900	552.00	3,256,800	貸付株式数 1,700株
ピジョン	39,000	4,240.00	165,360,000	貸付株式数 15,600株
天馬	4,400	1,994.00	8,773,600	貸付株式数 100株
兼松サステック	400	1,775.00	710,000	
キングジム	5,300	850.00	4,505,000	
象印マホービン	18,900	1,347.00	25,458,300	貸付株式数 7,400株 (3,400株)
リンテック	15,300	2,069.00	31,655,700	
信越ポリマー	11,800	731.00	8,625,800	
東リ	15,900	246.00	3,911,400	貸付株式数 2,300株
イトーキ	11,700	407.00	4,761,900	貸付株式数 300株
任天堂	37,000	41,890.00	1,549,930,000	
三菱鉛筆	10,600	1,706.00	18,083,600	貸付株式数 4,200株
松風	3,100	1,501.00	4,653,100	貸付株式数 1,200株
タカラスタンダード	13,400	1,672.00	22,404,800	貸付株式数 5,200株
コクヨ	30,700	1,431.00	43,931,700	貸付株式数 12,200株
ナカバヤシ	6,800	507.00	3,447,600	貸付株式数 1,100株
ニフコ	25,800	2,458.00	63,416,400	貸付株式数 5,000株
立川ブラインド	2,800	1,377.00	3,855,600	
グローブライド	3,100	2,901.00	8,993,100	
オカムラ	22,200	1,104.00	24,508,800	
バルカー	5,300	2,218.00	11,755,400	貸付株式数 800株
MUTOHホールディングス	900	1,624.00	1,461,600	
伊藤忠	445,100	2,207.00	982,335,700	
丸紅	628,000	701.40	440,479,200	
スクロール	9,600	330.00	3,168,000	貸付株式数 3,800株
高島	1,100	1,540.00	1,694,000	貸付株式数 300株
ヨンドシーホールディングス	7,000	2,578.00	18,046,000	貸付株式数 2,700株
三陽商会	3,700	1,323.00	4,895,100	貸付株式数 1,200株
長瀬産業	36,000	1,468.00	52,848,000	
ナイガイ	2,200	343.00	754,600	
蝶理	4,100	1,695.00	6,949,500	貸付株式数 1,400株
豊田通商	71,000	3,520.00	249,920,000	

オンワ - ドホールディングス	37,700	514.00	19,377,800	貸付株式数	15,000株
三共生興	11,000	491.00	5,401,000	貸付株式数	300株
兼 松	25,500	1,219.00	31,084,500	貸付株式数	2,700株
美 津 濃	6,300	2,682.00	16,896,600		
ツカモトコーポレーション	1,100	1,015.00	1,116,500	貸付株式数	400株
ファミリーマート	71,100	2,598.00	184,717,800	貸付株式数	28,100株
ルックホールディングス	2,300	1,014.00	2,332,200		
三井物産	524,500	1,742.50	913,941,250		
日本紙パルプ	3,600	3,810.00	13,716,000		
東京エレクトロン	43,100	20,385.00	878,593,500		
日立ハイテクノロジーズ	19,400	5,930.00	115,042,000		
カメイ	8,300	1,041.00	8,640,300	貸付株式数	2,600株
東都水産	900	2,550.00	2,295,000	貸付株式数	300株
OUGホールディングス	1,000	2,662.00	2,662,000	貸付株式数	300株
スターゼン	2,300	4,030.00	9,269,000	貸付株式数	900株 (700株)
セイコーHD	9,800	2,278.00	22,324,400	貸付株式数	3,900株
山 善	25,200	941.00	23,713,200		
椿本興業	1,400	3,350.00	4,690,000	貸付株式数	500株
住友商事	376,300	1,674.50	630,114,350		
日本ユニシス	19,600	3,450.00	67,620,000	貸付株式数	1,000株
内田洋行	2,700	3,705.00	10,003,500	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
三菱商事	446,600	2,708.00	1,209,392,800		
第一実業	2,800	2,773.00	7,764,400		
キャノンマーケティングJPN	18,100	2,158.00	39,059,800	貸付株式数	7,200株
西華産業	3,600	1,275.00	4,590,000	貸付株式数	1,200株
佐藤商事	5,900	805.00	4,749,500	貸付株式数	1,300株
菱洋エレクトロ	6,500	1,812.00	11,778,000	貸付株式数	2,400株
東京産業	6,600	475.00	3,135,000	貸付株式数	2,300株
ユアサ商事	6,600	3,040.00	20,064,000		
神鋼商事	1,500	2,227.00	3,340,500		
小林産業	3,700	272.00	1,006,400		
阪和興業	11,100	2,937.00	32,600,700	貸付株式数	1,400株
正栄食品	4,200	3,075.00	12,915,000	貸付株式数	400株
カナデン	5,800	1,271.00	7,371,800	貸付株式数	1,900株
菱電商事	5,100	1,605.00	8,185,500		
ニプロ	44,700	1,156.00	51,673,200	貸付株式数	16,700株

フルサト工業	3,500	1,393.00	4,875,500	貸付株式数	1,300株
岩谷産業	14,100	3,545.00	49,984,500	貸付株式数	5,200株
すてきナイスグループ	2,500	649.00	1,622,500	貸付株式数	900株
昭光通商	2,300	615.00	1,414,500	貸付株式数	200株
ニチモウ	1,300	1,784.00	2,319,200	貸付株式数	400株
極東貿易	2,000	1,680.00	3,360,000		
イワキ	8,300	488.00	4,050,400	貸付株式数	2,800株
兼松エレクトロニクス	3,400	2,999.00	10,196,600		
三愛石油	17,100	1,019.00	17,424,900	貸付株式数	300株
稲畑産業	15,500	1,285.00	19,917,500	貸付株式数	6,000株
G S Iクレオス	1,700	1,021.00	1,735,700	貸付株式数	100株
明和産業	6,200	572.00	3,546,400	貸付株式数	2,300株
クワザワ	2,300	400.00	920,000	貸付株式数	100株
ゴ-ルドウイン	5,700	16,630.00	94,791,000	貸付株式数	2,100株 (1,400株)
ユニ・チャ-ム	124,500	3,309.00	411,970,500	貸付株式数	51,200株
デサント	15,400	1,440.00	22,176,000	貸付株式数	100株
キング	3,500	536.00	1,876,000	貸付株式数	1,300株
ワキタ	13,600	1,059.00	14,402,400	貸付株式数	1,000株
ヤマトインタ-ナショナル	3,700	399.00	1,476,300	貸付株式数	1,400株
東邦ホールディングス	18,600	2,487.00	46,258,200	貸付株式数	1,900株
サンゲツ	18,700	2,037.00	38,091,900	貸付株式数	1,800株
ミツウロコグループ	8,300	947.00	7,860,100	貸付株式数	500株
シナネンホールディングス	2,600	1,698.00	4,414,800	貸付株式数	800株
伊藤忠エネクス	14,200	834.00	11,842,800		
サンリオ	19,400	2,025.00	39,285,000	貸付株式数	5,100株
サンワテクノス	3,800	780.00	2,964,000	貸付株式数	1,500株
リョ-サン	6,900	2,679.00	18,485,100		
新光商事	6,000	1,859.00	11,154,000		
トーヨー	2,800	1,723.00	4,824,400	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
三信電気	4,400	1,504.00	6,617,600		
東陽テクニカ	7,400	1,054.00	7,799,600	貸付株式数	600株
モスフードサービス	8,300	2,378.00	19,737,400	貸付株式数	3,300株 (100株)
加賀電子	6,300	1,705.00	10,741,500	貸付株式数	1,200株
三益半導体	5,800	1,797.00	10,422,600	貸付株式数	1,200株
ソーダニツカ	6,600	516.00	3,405,600	貸付株式数	900株 (900株)
立花エレテック	4,800	1,541.00	7,396,800	貸付株式数	200株

木曽路	7,800	2,634.00	20,545,200	貸付株式数	3,000株
S R Sホールディングス	7,500	1,033.00	7,747,500	貸付株式数	2,900株
千趣会	11,300	299.00	3,378,700	貸付株式数	4,500株
タカキュー	4,800	173.00	830,400	貸付株式数	1,900株 (1,600株)
ケーヨー	11,500	472.00	5,428,000	貸付株式数	2,100株
上新電機	7,500	1,963.00	14,722,500	貸付株式数	2,900株
日本瓦斯	10,000	3,100.00	31,000,000	貸付株式数	3,700株
ロイヤルホールディングス	11,100	2,592.00	28,771,200	貸付株式数	4,300株
東天紅	500	1,208.00	604,000	貸付株式数	100株
いなげや	7,000	1,552.00	10,864,000	貸付株式数	2,800株
島忠	13,400	2,567.00	34,397,800		
チヨダ	6,600	1,549.00	10,223,400	貸付株式数	2,600株
ライフコーポレーション	4,900	2,108.00	10,329,200	貸付株式数	1,000株
リンガーハット	7,900	2,502.00	19,765,800	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
MrMaxHD	8,700	435.00	3,784,500	貸付株式数	800株
テナアライド	5,600	438.00	2,452,800	貸付株式数	2,200株
AOKIホールディングス	12,600	1,057.00	13,318,200	貸付株式数	5,000株
オークワ	9,100	1,152.00	10,483,200	貸付株式数	3,500株
コメリ	9,800	2,179.00	21,354,200		
青山商事	11,000	1,894.00	20,834,000		
しまむら	7,400	8,210.00	60,754,000	貸付株式数	2,900株
はせがわ	3,100	404.00	1,252,400	貸付株式数	1,200株
高島屋	49,900	1,201.00	59,929,900	貸付株式数	19,700株
松屋	12,700	781.00	9,918,700	貸付株式数	5,000株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	32,700	1,153.00	37,703,100	貸付株式数	10,500株
近鉄百貨店	2,400	3,030.00	7,272,000	貸付株式数	900株
パルコ	6,100	1,290.00	7,869,000		
丸井グループ	53,900	2,160.00	116,424,000		
クレディセゾン	44,600	1,228.00	54,768,800	貸付株式数	300株
アクシアルリテイリング	5,300	3,910.00	20,723,000	貸付株式数	1,900株
井筒屋	3,300	219.00	722,700	貸付株式数	1,200株
イオン	244,900	1,909.50	467,636,550	貸付株式数	96,900株
イズミ	12,900	4,065.00	52,438,500	貸付株式数	5,100株
フォーバル	2,800	944.00	2,643,200		
平和堂	12,900	2,015.00	25,993,500	貸付株式数	5,100株
フジ	7,800	1,838.00	14,336,400	貸付株式数	3,000株
ヤオコー	7,200	4,750.00	34,200,000	貸付株式数	100株

ゼビオホールディングス	7,700	1,143.00	8,801,100	貸付株式数	2,400株
ケーズホールディングス	66,000	1,152.00	76,032,000		
PALTA C	11,500	5,170.00	59,455,000	貸付株式数	3,600株
三谷産業	7,900	286.00	2,259,400	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
OLYMPICグループ	3,700	616.00	2,279,200	貸付株式数	1,400株
日産東京販売HD	9,200	279.00	2,566,800	貸付株式数	800株
新生銀行	46,800	1,458.00	68,234,400	貸付株式数	17,800株
あおぞら銀行	35,400	2,496.00	88,358,400		
三菱UFJフィナンシャルG	4,388,700	525.00	2,304,067,500		
りそなホールディングス	699,600	427.40	299,009,040		
三井住友トラストHD	125,300	3,643.00	456,467,900		
三井住友フィナンシャルG	449,400	3,538.00	1,589,977,200		
千葉銀行	218,900	540.00	118,206,000	貸付株式数	10,300株
群馬銀行	127,700	341.00	43,545,700		
武蔵野銀行	9,500	1,759.00	16,710,500		
千葉興業銀行	17,600	300.00	5,280,000	貸付株式数	6,800株
筑波銀行	26,500	168.00	4,452,000		
七十七銀行	19,900	1,390.00	27,661,000		
青森銀行	5,000	2,466.00	12,330,000	貸付株式数	1,900株
秋田銀行	4,000	1,889.00	7,556,000	貸付株式数	1,400株
山形銀行	7,200	1,426.00	10,267,200	貸付株式数	100株
岩手銀行	4,400	2,297.00	10,106,800	貸付株式数	800株
東邦銀行	57,500	240.00	13,800,000	貸付株式数	19,800株
東北銀行	3,200	971.00	3,107,200	貸付株式数	1,100株
みちのく銀行	4,100	1,567.00	6,424,700		
ふくおかフィナンシャルG	56,200	1,856.00	104,307,200		
静岡銀行	157,700	740.00	116,698,000	貸付株式数	12,700株
十六銀行	8,600	2,178.00	18,730,800		
スルガ銀行	60,500	409.00	24,744,500	貸付株式数	23,700株 (7,000株)
八十二銀行	154,100	399.00	61,485,900	貸付株式数	6,300株
山梨中央銀行	7,600	982.00	7,463,200	貸付株式数	2,600株
大垣共立銀行	13,500	2,238.00	30,213,000	貸付株式数	3,900株
福井銀行	5,400	1,259.00	6,798,600		
北國銀行	6,600	2,311.00	15,252,600		
清水銀行	2,700	1,843.00	4,976,100	貸付株式数	900株 (300株)
富山銀行	1,200	2,237.00	2,684,400	貸付株式数	300株

滋賀銀行	12,700	2,310.00	29,337,000	
南都銀行	9,900	2,250.00	22,275,000	
百五銀行	57,000	325.00	18,525,000	貸付株式数 1,700株
京都銀行	22,900	3,935.00	90,111,500	
紀陽銀行	22,500	1,488.00	33,480,000	貸付株式数 6,000株
ほくほくフィナンシャルG	42,300	964.00	40,777,200	貸付株式数 16,700株
広島銀行	94,200	489.00	46,063,800	
山陰合同銀行	37,800	593.00	22,415,400	
中国銀行	55,000	887.00	48,785,000	貸付株式数 20,400株
鳥取銀行	2,200	1,341.00	2,950,200	貸付株式数 400株
伊予銀行	84,400	507.00	42,790,800	貸付株式数 4,000株
百十四銀行	6,700	1,983.00	13,286,100	貸付株式数 100株
四国銀行	9,000	908.00	8,172,000	貸付株式数 1,800株
阿波銀行	9,800	2,224.00	21,795,200	貸付株式数 3,700株
大分銀行	4,000	2,852.00	11,408,000	
宮崎銀行	4,300	2,287.00	9,834,100	
佐賀銀行	3,900	1,418.00	5,530,200	貸付株式数 1,400株
沖縄銀行	5,800	3,100.00	17,980,000	貸付株式数 2,200株
琉球銀行	14,700	1,042.00	15,317,400	貸付株式数 2,500株
セブン銀行	213,800	284.00	60,719,200	貸付株式数 80,100株
みずほフィナンシャルG	8,660,500	159.00	1,377,019,500	
高知銀行	2,400	774.00	1,857,600	貸付株式数 300株
山口フィナンシャルG	79,400	680.00	53,992,000	貸付株式数 30,200株
芙蓉総合リース	7,300	6,240.00	45,552,000	
興銀リース	12,200	2,771.00	33,806,200	貸付株式数 4,400株
東京センチュリー	12,800	4,500.00	57,600,000	貸付株式数 4,500株
SBIホールディングス	76,000	2,285.00	173,660,000	貸付株式数 300株
日本証券金融	28,300	497.00	14,065,100	貸付株式数 10,400株
アイフル	96,400	224.00	21,593,600	貸付株式数 38,200株
日本アジア投資	5,200	230.00	1,196,000	貸付株式数 900株
長野銀行	2,100	1,570.00	3,297,000	
名古屋銀行	5,200	2,975.00	15,470,000	貸付株式数 600株
北洋銀行	95,900	211.00	20,234,900	
愛知銀行	2,300	3,330.00	7,659,000	貸付株式数 600株
中京銀行	2,600	2,122.00	5,517,200	
大光銀行	2,200	1,615.00	3,553,000	
愛媛銀行	8,900	1,097.00	9,763,300	貸付株式数 2,300株
トマト銀行	2,400	1,023.00	2,455,200	
京葉銀行	27,400	594.00	16,275,600	貸付株式数 4,500株
栃木銀行	32,400	179.00	5,799,600	貸付株式数 4,200株

北日本銀行	2,000	1,686.00	3,372,000	貸付株式数	700株
東和銀行	11,000	694.00	7,634,000		
福島銀行	5,400	230.00	1,242,000	貸付株式数	2,200株
大東銀行	3,000	560.00	1,680,000	貸付株式数	500株
リコーリース	5,100	3,355.00	17,110,500	貸付株式数	1,400株
イオンフィナンシャルサー ビス	40,700	1,618.00	65,852,600	貸付株式数	16,000株
アコム	127,900	387.00	49,497,300	貸付株式数	16,400株
ジャックス	7,000	2,238.00	15,666,000		
オリコ	171,000	137.00	23,427,000	貸付株式数	27,600株
日立キャピタル	15,000	2,168.00	32,520,000		
アプラスフィナンシャル	31,700	70.00	2,219,000	貸付株式数	800株
オリックス	425,200	1,641.00	697,753,200		
三菱UFJリース	143,800	600.00	86,280,000	貸付株式数	7,600株
ジャフコ	10,500	3,915.00	41,107,500		
九州リースサービス	3,000	590.00	1,770,000		
トモニホールディングス	50,300	320.00	16,096,000	貸付株式数	800株
大和証券G本社	511,700	480.40	245,820,680		
野村ホールディングス	1,120,600	445.50	499,227,300		
岡三証券グループ	54,400	354.00	19,257,600	貸付株式数	20,200株
丸三証券	18,600	490.00	9,114,000	貸付株式数	7,400株
東洋証券	22,400	148.00	3,315,200	貸付株式数	8,900株
東海東京HD	74,900	290.00	21,721,000	貸付株式数	16,800株
光世証券	1,500	560.00	840,000	貸付株式数	600株
水戸証券	18,200	192.00	3,494,400	貸付株式数	7,200株
いちよし証券	13,200	640.00	8,448,000	貸付株式数	5,000株
松井証券	31,000	890.00	27,590,000		
SOMPOホールディング ス	112,400	4,490.00	504,676,000		
だいこう証券ビジ	2,600	535.00	1,391,000	貸付株式数	1,000株
日本取引所グループ	172,000	1,792.00	308,224,000		
マネックスG	58,500	317.00	18,544,500		
極東証券	8,600	808.00	6,948,800		
岩井コスモホールディング	6,800	1,073.00	7,296,400	貸付株式数	1,200株
藍澤證券	11,300	693.00	7,830,900	貸付株式数	4,500株
フィデアホール	61,200	116.00	7,099,200	貸付株式数	200株
池田泉州HD	66,500	182.00	12,103,000	貸付株式数	1,000株
アニコムホールディング ス	5,200	3,910.00	20,332,000	貸付株式数	1,900株
MS&AD	166,700	3,438.00	573,114,600		



SONY FH	52,400	2,344.00	122,825,600	貸付株式数	20,400株
マネーパートナーズGP	7,500	264.00	1,980,000	貸付株式数	100株
スパークス・グループ	25,000	246.00	6,150,000		
小林洋行	2,000	244.00	488,000	貸付株式数	700株
第一生命HLDGS	360,500	1,510.00	544,355,000	貸付株式数	142,700株
東京海上HD	227,900	5,663.00	1,290,597,700	貸付株式数	25,100株
アドバンテッジリスクマネ	2,400	809.00	1,941,600	貸付株式数	900株
イー・ギャランティ	5,900	1,294.00	7,634,600	貸付株式数	2,300株
アサックス	2,800	591.00	1,654,800	貸付株式数	1,000株
NECキャピタルソリューション	2,600	2,088.00	5,428,800		
T&Dホールディングス	197,200	1,083.50	213,666,200		
アドバンスクリエイト	1,500	1,826.00	2,739,000	貸付株式数	500株
三井不動産	338,000	2,562.50	866,125,000		
三菱地所	446,300	2,069.00	923,394,700		
平和不動産	11,700	2,550.00	29,835,000		
東京建物	69,400	1,463.00	101,532,200	貸付株式数	27,500株
ダイビル	18,700	1,061.00	19,840,700		
京阪神ビルディング	11,200	1,223.00	13,697,600	貸付株式数	1,000株
住友不動産	143,100	3,954.00	565,817,400	貸付株式数	15,700株
太平洋興発	2,400	752.00	1,804,800	貸付株式数	900株
テーオーシー	14,300	816.00	11,668,800	貸付株式数	1,800株
東京楽天地	900	5,560.00	5,004,000		
スターツコーポレーション	8,700	2,430.00	21,141,000		
フジ住宅	8,100	678.00	5,491,800	貸付株式数	1,300株
空港施設	7,300	528.00	3,854,400	貸付株式数	400株
明和地所	4,200	528.00	2,217,600	貸付株式数	1,200株
ゴールドクレスト	5,000	2,052.00	10,260,000		
リログループ	33,700	2,623.00	88,395,100	貸付株式数	6,800株
日本エスリード	2,600	1,609.00	4,183,400		
日神不動産	9,200	440.00	4,048,000	貸付株式数	1,900株
日本エスコン	11,500	765.00	8,797,500	貸付株式数	4,600株
タカラレーベン	29,000	405.00	11,745,000		
サンヨーハウジ 名古屋	4,000	874.00	3,496,000	貸付株式数	1,300株
イオンモール	31,800	1,718.00	54,632,400	貸付株式数	12,600株
毎日コムネット	1,300	726.00	943,800		
ファースト住建	2,800	1,249.00	3,497,200	貸付株式数	200株
ランド	258,500	7.00	1,809,500	貸付株式数	103,000株
カチタス	7,100	4,235.00	30,068,500	貸付株式数	2,800株 (2,800株)

東祥	3,800	2,246.00	8,534,800	貸付株式数	1,400株
トーセイ	8,800	1,277.00	11,237,600		
穴吹興産	900	2,786.00	2,507,400		
サンフロンティア不動産	8,800	1,254.00	11,035,200	貸付株式数	1,100株
インテリックス	2,000	724.00	1,448,000		
ランドビジネス	3,700	765.00	2,830,500	貸付株式数	1,000株
日本社宅サービス	1,700	1,008.00	1,713,600		
グランディハウス	6,100	462.00	2,818,200		
東武鉄道	68,000	3,355.00	228,140,000	貸付株式数	7,700株
相鉄ホールディングス	22,100	2,806.00	62,012,600	貸付株式数	8,700株
東急	175,400	1,903.00	333,786,200		
京浜急行	88,400	1,945.00	171,938,000		
小田急電鉄	103,400	2,416.00	249,814,400		
京王電鉄	36,100	6,570.00	237,177,000	貸付株式数	4,800株
京成電鉄	48,300	4,275.00	206,482,500	貸付株式数	8,000株
富士急行	8,800	4,465.00	39,292,000	貸付株式数	3,400株 (900株)
新京成電鉄	1,700	2,010.00	3,417,000	貸付株式数	600株
東日本旅客鉄道	114,300	10,080.00	1,152,144,000		
西日本旅客鉄道	57,600	9,213.00	530,668,800		
東海旅客鉄道	57,800	21,050.00	1,216,690,000		
西武ホールディングス	79,800	1,835.00	146,433,000	貸付株式数	10,900株
鴻池運輸	10,400	1,665.00	17,316,000	貸付株式数	2,700株
西日本鉄道	17,700	2,397.00	42,426,900	貸付株式数	7,000株
ハマキョウレックス	5,000	3,630.00	18,150,000		
サカイ引越センター	3,400	6,090.00	20,706,000	貸付株式数	600株
近鉄グループHLDGS	61,200	5,340.00	326,808,000	貸付株式数	24,200株
阪急阪神HLDGS	81,500	4,080.00	332,520,000	貸付株式数	12,800株
南海電鉄	27,100	2,717.00	73,630,700	貸付株式数	10,700株
京阪ホールディングス	27,200	4,520.00	122,944,000	貸付株式数	10,100株
神戸電鉄	1,600	3,985.00	6,376,000	貸付株式数	600株
名古屋鉄道	50,200	3,220.00	161,644,000	貸付株式数	19,900株
山陽電鉄	4,600	2,138.00	9,834,800	貸付株式数	1,800株
ランコム	1,700	5,810.00	9,877,000	貸付株式数	600株
日本通運	23,500	5,590.00	131,365,000	貸付株式数	700株
ヤマトホールディングス	107,100	1,869.50	200,223,450		
山 九	17,000	5,250.00	89,250,000	貸付株式数	6,300株
日 新	5,300	1,469.00	7,785,700	貸付株式数	1,600株
丸 運	3,600	261.00	939,600	貸付株式数	200株
丸全昭和運輸	5,000	3,040.00	15,200,000	貸付株式数	1,300株

センコーグループHLDGS	33,700	843.00	28,409,100	貸付株式数	1,200株
トナミホールディングス	1,500	4,495.00	6,742,500	貸付株式数	100株
ニッコンホールディングス	23,300	2,428.00	56,572,400	貸付株式数	2,800株
日石輸送	700	2,857.00	1,999,900	貸付株式数	100株
福山通運	7,800	3,645.00	28,431,000	貸付株式数	2,500株
セイノーホールディングス	45,600	1,363.00	62,152,800	貸付株式数	1,500株
エスライン	1,900	812.00	1,542,800	貸付株式数	600株
神奈川中央交通	1,500	3,770.00	5,655,000	貸付株式数	600株
日立物流	13,500	3,290.00	44,415,000	貸付株式数	1,000株
丸和運輸機関	3,200	5,330.00	17,056,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
C&Fロジホールディングス	6,200	1,192.00	7,390,400		
日本郵船	51,100	1,722.00	87,994,200		
商船三井	36,300	2,747.00	99,716,100		
川崎汽船	18,900	1,220.00	23,058,000	貸付株式数	7,400株 (100株)
NSユナイテッド海運	3,400	2,273.00	7,728,200	貸付株式数	1,200株
明治海運	6,300	301.00	1,896,300		
飯野海運	28,800	332.00	9,561,600		
共栄タンカー	500	1,325.00	662,500		
九州旅客鉄道	51,200	3,225.00	165,120,000		
SGホールディングス	57,800	2,848.00	164,614,400	貸付株式数	13,400株
日本航空	111,900	3,344.00	374,193,600		
ANAホールディングス	111,700	3,613.00	403,572,100		
パスコ	1,100	889.00	977,900	貸付株式数	400株
西本WISMETTACHD	1,400	3,305.00	4,627,000		
ヤマシタヘルスケアHLDGS	500	1,249.00	624,500		
GENKY DRUGSTORES	3,100	2,091.00	6,482,100	貸付株式数	1,200株 (800株)
国際紙パルプ商事	14,800	303.00	4,484,400		
総合メディカルHD	5,500	1,506.00	8,283,000	貸付株式数	1,300株
ブックオフGHD	3,200	1,208.00	3,865,600	貸付株式数	1,200株
三菱倉庫	21,200	2,656.00	56,307,200		
三井倉庫HOLD	7,400	1,614.00	11,943,600		
住友倉庫	22,400	1,419.00	31,785,600	貸付株式数	8,500株
渋沢倉庫	3,400	1,866.00	6,344,400	貸付株式数	1,200株

ヤマタネ	3,100	1,299.00	4,026,900	貸付株式数	1,100株
東陽倉庫	11,200	303.00	3,393,600	貸付株式数	3,600株
乾汽船	5,400	946.00	5,108,400	貸付株式数	2,100株
日本トランスシティ	13,700	448.00	6,137,600	貸付株式数	300株
ケイヒン	1,100	1,208.00	1,328,800	貸付株式数	400株
中央倉庫	3,800	1,010.00	3,838,000	貸付株式数	100株
川西倉庫	1,200	1,043.00	1,251,600	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,900	908.00	4,449,200	貸付株式数	1,100株
ファイズ	1,100	744.00	818,400	貸付株式数	400株
東洋埠頭	1,900	1,304.00	2,477,600		
宇徳	5,200	500.00	2,600,000	貸付株式数	1,000株
上組	37,800	2,453.00	92,723,400		
サンリツ	1,500	642.00	963,000	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,600	1,005.00	1,608,000	貸付株式数	600株
キューソー流通システム	1,500	1,771.00	2,656,500	貸付株式数	300株 (300株)
近鉄エクスプレス	11,400	1,457.00	16,609,800	貸付株式数	4,200株
東海運	3,400	283.00	962,200	貸付株式数	1,300株
エーアイテイー	4,100	903.00	3,702,300		
内外トランスライン	2,200	1,224.00	2,692,800		
ショーエイコーポ	500	743.00	371,500	貸付株式数	200株
日本コンセプト	2,200	1,331.00	2,928,200	貸付株式数	700株
東京放送HD	41,900	1,719.00	72,026,100	貸付株式数	3,000株
日本テレビHLD S	58,100	1,387.00	80,584,700		
朝日放送グループHD	6,200	705.00	4,371,000	貸付株式数	2,400株
テレビ朝日HD	17,300	1,690.00	29,237,000	貸付株式数	6,900株 (300株)
スカパーJ S A T H D	45,200	428.00	19,345,600		
テレビ東京HD	5,100	2,137.00	10,898,700	貸付株式数	1,900株
日本BS放送	2,000	1,053.00	2,106,000	貸付株式数	800株 (700株)
ビジョン	1,900	4,790.00	9,101,000	貸付株式数	700株
スマートバリュー	1,800	732.00	1,317,600	貸付株式数	700株
USEN-NEXT H L D G S	2,300	809.00	1,860,700	貸付株式数	900株
ワイヤレスゲート	2,700	704.00	1,900,800	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,600	1,389.00	6,389,400		
日本通信	55,800	199.00	11,104,200	貸付株式数	22,900株 (1,000株)
クロップス	1,100	604.00	664,400		

日本電信電話	433,700	5,101.00	2,212,303,700	
KDDI	519,800	2,792.50	1,451,541,500	
ソフトバンク	672,500	1,500.50	1,009,086,250	貸付株式数 206,000株
光通信	7,500	24,600.00	184,500,000	貸付株式数 2,800株
NTTドコモ	401,400	2,739.50	1,099,635,300	
エムティーアイ	6,900	692.00	4,774,800	貸付株式数 900株
GMOインターネット	24,700	1,881.00	46,460,700	貸付株式数 9,700株
ファイバーゲート	1,200	1,677.00	2,012,400	
アйдママーケティング ミュ	1,300	535.00	695,500	
KADOKAWA	18,300	1,580.00	28,914,000	
学研ホールディングス	2,100	5,360.00	11,256,000	貸付株式数 800株
ゼンリン	12,600	1,798.00	22,654,800	貸付株式数 4,000株
昭文社	2,700	362.00	977,400	
インプレスホールディング ス	4,900	143.00	700,700	貸付株式数 1,900株
東京電力HD	515,700	507.00	261,459,900	貸付株式数 204,300株
中部電力	197,300	1,535.50	302,954,150	貸付株式数 73,900株
関西電力	263,500	1,283.50	338,202,250	貸付株式数 45,800株
中国電力	88,800	1,358.00	120,590,400	貸付株式数 35,300株
北陸電力	62,700	660.00	41,382,000	貸付株式数 16,800株
東北電力	150,700	1,043.00	157,180,100	貸付株式数 48,100株
四国電力	57,800	1,008.00	58,262,400	貸付株式数 21,300株
九州電力	132,700	1,014.00	134,557,800	
北海道電力	60,100	560.00	33,656,000	
沖縄電力	11,900	1,632.00	19,420,800	
電源開発	51,300	2,429.00	124,607,700	
エフオン	3,600	727.00	2,617,200	貸付株式数 1,200株
イーレックス	11,100	1,095.00	12,154,500	貸付株式数 2,100株
レノバ	10,600	837.00	8,872,200	貸付株式数 4,200株
東京瓦斯	126,100	2,621.00	330,508,100	
大阪瓦斯	125,100	1,888.00	236,188,800	
東邦瓦斯	32,000	4,020.00	128,640,000	貸付株式数 11,900株
北海道瓦斯	3,400	1,505.00	5,117,000	貸付株式数 100株
広島ガス	14,100	329.00	4,638,900	貸付株式数 100株
西部瓦斯	7,300	2,257.00	16,476,100	貸付株式数 1,100株
静岡ガス	18,900	853.00	16,121,700	貸付株式数 7,200株
メタウォーター	3,100	3,640.00	11,284,000	貸付株式数 1,000株
アイネット	3,500	1,366.00	4,781,000	貸付株式数 1,400株
松竹	4,200	12,650.00	53,130,000	貸付株式数 1,600株

東宝	41,700	4,625.00	192,862,500	貸付株式数	16,400株
エイチ・アイ・エス	10,400	2,637.00	27,424,800	貸付株式数	4,100株 (3,200株)
東映	2,700	15,050.00	40,635,000	貸付株式数	1,000株
ラックランド	1,200	2,276.00	2,731,200	貸付株式数	400株
NTTデータ	167,700	1,396.00	234,109,200		
共立メンテナンス	9,400	4,220.00	39,668,000	貸付株式数	3,700株 (1,300株)
イチネンホールディングス	6,500	1,049.00	6,818,500	貸付株式数	2,000株
建設技術研究所	4,300	1,565.00	6,729,500		
スペース	4,000	1,222.00	4,888,000	貸付株式数	800株
長大	2,200	948.00	2,085,600	貸付株式数	800株
アインホールディングス	8,500	5,920.00	50,320,000	貸付株式数	3,300株
燦ホールディングス	1,300	2,085.00	2,710,500		
ピー・シー・エー	800	3,925.00	3,140,000	貸付株式数	300株
スバル興業	400	6,500.00	2,600,000		
東京テアトル	2,400	1,365.00	3,276,000	貸付株式数	900株
タナベ経営	1,200	1,260.00	1,512,000	貸付株式数	100株
ビジネスB太田昭和	1,100	2,517.00	2,768,700		
ナガワ	1,700	5,100.00	8,670,000	貸付株式数	400株
よみうりランド	1,300	4,535.00	5,895,500	貸付株式数	500株
東京都競馬	4,000	3,205.00	12,820,000		
常磐興産	2,400	1,689.00	4,053,600	貸付株式数	900株
カナモト	10,100	2,529.00	25,542,900	貸付株式数	3,900株
東京ドーム	22,900	981.00	22,464,900	貸付株式数	9,100株 (300株)
DTS	13,900	2,236.00	31,080,400		
スクウェア・エニックス・HD	29,400	4,260.00	125,244,000		
シーイーシー	6,700	2,222.00	14,887,400	貸付株式数	2,600株
カプコン	27,100	2,896.00	78,481,600		
西尾レントオール	6,300	2,765.00	17,419,500	貸付株式数	100株
アイ・エス・ビー	1,200	1,514.00	1,816,800		
アゴラ・ホスピタリティーG	34,800	33.00	1,148,400	貸付株式数	8,000株 (800株)
日本空港ビルデング	20,300	4,225.00	85,767,500	貸付株式数	8,000株
トランス・コスモス	6,700	2,520.00	16,884,000	貸付株式数	300株
乃村工藝社	28,900	1,346.00	38,899,400	貸付株式数	11,400株
ジャステック	3,600	1,056.00	3,801,600	貸付株式数	1,200株
SCSK	16,500	5,210.00	85,965,000	貸付株式数	3,300株

藤田観光	2,600	2,685.00	6,981,000	貸付株式数 900株 (900株)
KNT-CTホールディングス	3,200	1,450.00	4,640,000	貸付株式数 1,200株
日本管財	6,500	1,886.00	12,259,000	
トーカイ	5,900	2,311.00	13,634,900	貸付株式数 100株
白洋舎	700	2,790.00	1,953,000	貸付株式数 200株
セコム	65,500	9,282.00	607,971,000	
日本システムウエア	2,100	2,412.00	5,065,200	
セントラル警備保障	3,000	5,270.00	15,810,000	貸付株式数 1,100株
アイネス	7,900	1,088.00	8,595,200	貸付株式数 2,600株
丹青社	11,700	1,283.00	15,011,100	貸付株式数 1,400株
メイテック	7,600	5,320.00	40,432,000	貸付株式数 1,800株
TKC	5,300	4,480.00	23,744,000	貸付株式数 2,100株
富士ソフト	9,000	4,585.00	41,265,000	貸付株式数 3,200株
応用地質	6,600	1,056.00	6,969,600	
船井総研ホールディング	12,800	2,354.00	30,131,200	
NSD	10,200	3,160.00	32,232,000	貸付株式数 1,900株
進学会ホールディングス	2,800	449.00	1,257,200	貸付株式数 900株
丸紅建材リース	700	1,669.00	1,168,300	貸付株式数 200株
オオバ	4,800	602.00	2,889,600	
コナミホールディングス	25,900	5,110.00	132,349,000	貸付株式数 800株
いであ	1,200	1,116.00	1,339,200	貸付株式数 400株
学究社	2,000	1,217.00	2,434,000	
ベネッセホールディングス	22,400	2,730.00	61,152,000	貸付株式数 3,900株
イオンディライト	7,600	3,305.00	25,118,000	貸付株式数 3,000株
ナック	4,100	928.00	3,804,800	貸付株式数 1,500株
福井コンピュータHLD S	2,000	2,158.00	4,316,000	
ニチイ学館	8,800	1,646.00	14,484,800	
ダイセキ	10,300	2,649.00	27,284,700	貸付株式数 4,000株
ステップ	2,200	1,413.00	3,108,600	貸付株式数 800株
日鉄物産	4,600	4,165.00	19,159,000	
泉州電業	2,100	2,583.00	5,424,300	貸付株式数 100株
元気寿司	1,800	2,810.00	5,058,000	貸付株式数 600株
トラスコ中山	13,200	2,469.00	32,590,800	貸付株式数 5,200株
ヤマダ電機	193,300	496.00	95,876,800	貸付株式数 76,500株
オートバックスセブン	25,300	1,790.00	45,287,000	貸付株式数 10,000株
モリト	4,600	760.00	3,496,000	
アークランドサカモト	10,800	1,258.00	13,586,400	貸付株式数 2,600株
ニトリホールディングス	27,500	15,245.00	419,237,500	貸付株式数 10,800株

グルメ杵屋	4,500	1,179.00	5,305,500	貸付株式数 1,800株 (1,700株)
愛眼	5,000	241.00	1,205,000	貸付株式数 2,000株
ケーユーホールディングス	3,400	807.00	2,743,800	貸付株式数 1,000株
吉野家ホールディングス	22,100	2,308.00	51,006,800	貸付株式数 8,400株
加藤産業	9,900	3,145.00	31,135,500	
北恵	1,200	920.00	1,104,000	
イノテック	4,000	872.00	3,488,000	貸付株式数 1,400株
イエローハット	12,000	1,530.00	18,360,000	貸付株式数 4,700株
松屋フーズHLDGS	3,000	3,870.00	11,610,000	貸付株式数 1,100株
JBCホールディングス	4,900	1,595.00	7,815,500	貸付株式数 400株
JKホールディングス	5,800	521.00	3,021,800	貸付株式数 600株
サガミホールディングス	8,500	1,354.00	11,509,000	貸付株式数 3,300株
日伝	5,300	1,977.00	10,478,100	貸付株式数 2,000株
関西スーパーマーケット	4,900	1,102.00	5,399,800	
ミロク情報サービス	6,200	2,789.00	17,291,800	貸付株式数 2,400株 (100株)
北沢産業	4,800	264.00	1,267,200	貸付株式数 700株
杉本商事	3,400	1,995.00	6,783,000	貸付株式数 1,200株
因幡電機産業	9,100	4,680.00	42,588,000	貸付株式数 3,000株
王将フードサービス	4,700	7,150.00	33,605,000	貸付株式数 1,800株
プレナス	7,100	1,734.00	12,311,400	貸付株式数 2,800株 (2,500株)
ミニストップ	4,600	1,385.00	6,371,000	貸付株式数 1,800株
アークス	12,100	2,183.00	26,414,300	貸付株式数 4,500株
パローホールディングス	13,900	1,820.00	25,298,000	
東テック	2,200	1,999.00	4,397,800	
ミスミグループ本社	79,600	2,483.00	197,646,800	貸付株式数 26,700株 (26,500株)
藤久	500	722.00	361,000	貸付株式数 100株
アルテック	4,500	203.00	913,500	
ベルク	3,200	5,040.00	16,128,000	貸付株式数 1,200株
大庄	3,400	1,573.00	5,348,200	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
タキヒヨー	1,900	1,744.00	3,313,600	貸付株式数 100株
ファーストリテイリング	8,500	64,680.00	549,780,000	貸付株式数 3,300株
ソフトバンクグループ	503,200	4,629.00	2,329,312,800	
蔵王産業	1,000	1,362.00	1,362,000	
スズケン	29,000	5,710.00	165,590,000	貸付株式数 5,500株
サンドラッグ	23,800	3,300.00	78,540,000	貸付株式数 1,100株



サクスパーホールディング	5,500	893.00	4,911,500	
ジェコス	4,600	853.00	3,923,800	貸付株式数 100株
ヤマザワ	1,300	1,633.00	2,122,900	貸付株式数 100株
やまや	1,100	2,302.00	2,532,200	貸付株式数 400株
グローセル	6,000	406.00	2,436,000	貸付株式数 100株
ベルーナ	15,400	717.00	11,041,800	貸付株式数 6,100株
合計			143,418,368,822	

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

ソニー	20,000株	トヨタ自動車	40,000株
三菱UFJフィナンシャルG	200,000株		

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	226,861,077	98,892,131
金銭信託	4,875,908	31,017,012
コール・ローン	196,933,124	629,279,068
株式	102,362,743,718	115,283,567,339

投資証券		2,656,538,100	3,552,371,525
派生商品評価勘定		12,389,553	52,887,665
未収入金		3,986,228	3,482,459
未収配当金		221,881,854	269,789,646
差入委託証拠金		832,150,645	580,569,760
流動資産合計		106,518,360,207	120,501,856,605
資産合計		106,518,360,207	120,501,856,605
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,381,905	84,480
未払解約金		121,966,000	39,091,700
その他未払費用		1,727	-
流動負債合計		125,349,632	39,176,180
負債合計		125,349,632	39,176,180
純資産の部			
元本等			
元本	1	42,459,485,295	47,561,732,616
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		63,933,525,280	72,900,947,809
元本等合計		106,393,010,575	120,462,680,425
純資産合計		106,393,010,575	120,462,680,425
負債純資産合計		106,518,360,207	120,501,856,605

## 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9月8日 至 2019年9月9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	<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	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1. 1 期首	2017年9月8日	2018年9月8日
期首元本額	39,855,140,897円	42,459,485,295円
期中追加設定元本額	6,718,211,769円	8,658,359,408円
期中一部解約元本額	4,113,867,371円	3,556,112,087円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスVA	515,082,035円	457,582,978円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	16,121,330円	12,171,737円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	202,871,058円	152,670,861円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	25,117,867円	19,307,134円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	661,977,720円	504,911,584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)	- 円	5,564,412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)	538,714,677円	540,017,142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)	1,377,137,596円	1,902,089,680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)	514,089,154円	536,713,569円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,009,461円	7,630,077円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	197,089円	1,026,256円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	618,256,777円	1,046,985,708円
i F r e e 8資産バランス	453,272,929円	767,747,981円
i F r e e 年金バランス	1,657,323円	22,278,762円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	26,565,620,003円	29,369,923,594円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	529,771,994円	582,738,617円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	776,610,799円	867,597,239円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	629,910,173円	670,142,079円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,473,684,673円	1,509,470,556円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	4,120,334円	3,181,354円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	12,251,586円	13,677,264円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,860,258円	4,740,264円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	398,382円	92,504,040円
ダイワつみたてインデックス バランス30	- 円	39,782円
ダイワつみたてインデックス バランス50	- 円	79,729円

ダイワつみたてインデックス バランス70	- 円	104,999円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	72,012円	- 円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	147,768円	- 円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	1,141,693円	- 円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	3,571,817円	- 円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	272,944,755円	198,647,940円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	361,377,335円	338,775,177円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,175,048,786円	2,737,839,798円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	160,280,254円	143,938,226円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	609,047,733円	683,982,082円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	73,285,872円	113,932,367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)	454,226円	1,397,078,388円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,735,417,240円	2,715,828,277円
ダイワライフスタイル25	18,926,893円	19,046,698円
ダイワライフスタイル50	68,555,284円	66,894,558円
ダイワライフスタイル75	57,480,409円	54,871,707円
計	42,459,485,295円	47,561,732,616円
2. 期末日における受益権の総数	42,459,485,295口	47,561,732,616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 2018年9月8日 至 2019年9月9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	2019年9月9日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2018年9月7日現在	2019年9月9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	5,095,402,721	8,444,540,003
投資証券	21,245,147	463,878,248
合計	5,116,647,868	8,908,418,251

（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（2017年12月1日から2018年9月7日まで、及び2018年12月1日から2019年9月9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	2018年9月7日 現在				2019年9月9日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株値指数 先物取引								
買 建	1,263,402,812	-	1,272,633,160	9,230,348	1,561,667,857	-	1,609,895,622	48,227,765
合計	1,263,402,812	-	1,272,633,160	9,230,348	1,561,667,857	-	1,609,895,622	48,227,765

（注） 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2018年9月7日 現在			2019年9月9日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益



	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	55,367,700	-	55,145,000	222,700	614,516,580	-	619,092,000	4,575,420
アメリカ・ドル	55,367,700	-	55,145,000	222,700	614,516,580	-	619,092,000	4,575,420
合計	55,367,700	-	55,145,000	222,700	614,516,580	-	619,092,000	4,575,420

## (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)

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1口当たり純資産額	2.5058円	2.5328円
(1万口当たり純資産額)	(25,058円)	(25,328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	3,300	130.290	429,957.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,850	215.920	615,372.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	5,550	98.050	544,177.500	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,600	126.460	202,336.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	18,500	32.880	608,280.000	
	ABBOTT LABORATORIES	51,616	86.040	4,441,040.640	
	ARCONIC INC	12,533	25.990	325,732.670	
	VERISK ANALYTICS INC	4,650	164.580	765,297.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	10,500	56.190	589,995.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	8,550	89.320	763,686.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	17,762	137.670	2,445,294.540	
	QORVO INC	3,400	75.450	256,530.000	
	AFLAC INC	21,600	51.570	1,113,912.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,650	125.480	458,002.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	4,200	71.370	299,754.000	
	ADOBE INC	14,250	284.940	4,060,395.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,450	48.640	313,728.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	3,300	203.140	670,362.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	11,300	14.770	166,901.000	
	GARMIN LTD	3,900	83.460	325,494.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,530	225.590	1,473,102.700	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	21,150	171.160	3,620,034.000	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,971	141.090	701,358.390	
	WR BERKLEY CORP	4,175	72.220	301,518.500	
	AUTOZONE INC	730	1,143.340	834,638.200	
	DOLLAR TREE INC	6,971	109.620	764,161.020	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	33,900	7.010	237,639.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL	3,200	93.810	300,192.000	
	CELANESE CORP	3,800	118.070	448,666.000	
DR HORTON INC	10,116	50.130	507,115.080		
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,450	30.310	74,259.500		
DENTSPLY SIRONA INC	7,000	50.690	354,830.000		
AUTODESK INC	6,400	150.350	962,240.000		

MOODY'S CORP	5,000	220.540	1,102,700.000	
DEVON ENERGY CORP	12,850	23.350	300,047.500	
ALBEMARLE CORP	3,150	63.230	199,174.500	
ATMOS ENERGY CORP	3,350	109.090	365,451.500	
ALLIANT ENERGY CORP	6,700	52.260	350,142.000	
CITIGROUP INC	67,973	65.970	4,484,178.810	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	12,650	173.250	2,191,612.500	
AMERICAN ELECTRIC POWER	14,250	91.090	1,298,032.500	
ALLEGHANY CORP	410	780.020	319,808.200	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	237.350	261,085.000	
HESS CORP	8,250	64.040	528,330.000	
DAVITA INC	3,500	59.370	207,795.000	
DANAHER CORP	18,900	144.330	2,727,837.000	
FORTIVE CORP	8,700	68.470	595,689.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	16,250	94.890	1,541,962.500	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,900	19.560	95,844.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	5,628	17.780	100,065.840	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	16,800	38.710	650,328.000	
BUNGE LTD	4,000	55.800	223,200.000	
TE CONNECTIVITY LTD	9,825	94.850	931,901.250	
APPLE INC	135,800	213.260	28,960,708.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,400	82.250	773,150.000	
BOEING CO/THE	15,440	363.000	5,604,720.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,465	114.940	513,207.100	
BECTON DICKINSON AND CO	7,949	262.480	2,086,453.520	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	20.950	140,365.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,850	87.620	337,337.000	
CDK GLOBAL INC	3,600	44.920	161,712.000	
NISOURCE INC	11,050	29.330	324,096.500	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,850	83.280	320,628.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	25,621	43.030	1,102,471.630	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	120,904	59.060	7,140,590.240	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	37,650	204.730	7,708,084.500	
ANSYS INC	2,450	217.590	533,095.500	
H&R BLOCK INC	5,800	24.140	140,012.000	
BB&T CORP	22,250	48.720	1,084,020.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	47,450	48.270	2,290,411.500	

JPMORGAN CHASE & CO	94,470	112.610	10,638,266.700	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,950	115.620	803,559.000	
LKQ CORP	9,400	26.900	252,860.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,350	188.420	254,367.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,062	62.300	564,562.600	
CADENCE DESIGN SYS INC	8,300	70.000	581,000.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,810	134.750	513,397.500	
DOLLAR GENERAL CORP	7,500	161.540	1,211,550.000	
SERVICENOW INC	5,460	263.500	1,438,710.000	
CATERPILLAR INC	16,800	122.700	2,061,360.000	
CMS ENERGY CORP	8,200	62.760	514,632.000	
MOSAIC CO/THE	10,950	19.540	213,963.000	
DELTA AIR LINES INC	4,750	57.980	275,405.000	
CORNING INC	23,200	28.330	657,256.000	
CISCO SYSTEMS INC	127,050	48.840	6,205,122.000	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	3,700	61.750	228,475.000	
MORGAN STANLEY	36,750	42.180	1,550,115.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,550	133.770	207,343.500	
MSCI INC	2,450	241.270	591,111.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,000	247.040	247,040.000	
MIDDLEBY CORP	1,600	113.450	181,520.000	
COTY INC-CL A	13,539	10.020	135,660.780	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	6,500	48.900	317,850.000	
BROADCOM INC	11,522	291.910	3,363,387.020	
ACUITY BRANDS INC	1,150	125.840	144,716.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,330	79.820	265,800.600	
ARAMARK	7,050	42.000	296,100.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,050	30.380	183,799.000	
DTE ENERGY COMPANY	5,250	128.880	676,620.000	
CENTENE CORP	12,150	45.890	557,563.500	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,200	118.700	379,840.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	13,900	34.140	474,546.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,350	90.500	484,175.000	
GARTNER INC	2,720	137.190	373,156.800	
SPLUNK INC	4,500	110.360	496,620.000	
DOMINION ENERGY INC	23,341	76.370	1,782,552.170	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,700	57.170	668,889.000	
SMITH (A.O.) CORP	4,150	47.810	198,411.500	
DEERE & CO	8,750	156.520	1,369,550.000	

GLOBAL PAYMENTS INC	4,700	174.370	819,539.000	
VMMWARE INC-CLASS A	2,500	147.170	367,925.000	
BURLINGTON STORES INC	1,900	200.680	381,292.000	
NASDAQ INC	3,450	104.260	359,697.000	
VAIL RESORTS INC	1,120	242.370	271,454.400	
EAST WEST BANCORP INC	4,100	42.250	173,225.000	
TARGA RESOURCES CORP	6,550	37.500	245,625.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,800	155.830	280,494.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,180	103.800	226,284.000	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,050	60.600	63,630.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	9,800	91.140	893,172.000	
COGNEX CORP	5,050	47.320	238,966.000	
TELEFLEX INC	1,330	356.170	473,706.100	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,600	110.740	287,924.000	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,520	269.000	408,880.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,800	157.330	597,854.000	
IDEX CORP	2,250	168.850	379,912.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	23,950	74.700	1,789,065.000	
ROLLINS INC	4,325	33.920	146,704.000	
AMETEK INC	6,525	89.270	582,486.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,350	75.900	557,865.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,650	35.850	130,852.500	
HEICO CORP	1,200	142.860	171,432.000	
XPO LOGISTICS INC	3,450	72.190	249,055.500	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,150	275.620	316,963.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,900	78.050	694,645.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	12,800	303.760	3,888,128.000	
GRUBHUB INC	2,600	60.400	157,040.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,650	192.890	318,268.500	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,500	78.630	117,945.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	790	836.320	660,692.800	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	8,350	19.110	159,568.500	
UGI CORP	5,200	48.000	249,600.000	
CUMMINS INC	4,350	154.900	673,815.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	22,750	54.580	1,241,695.000	

SABRE CORP	7,650	23.520	179,928.000	
CDW CORP/DE	4,350	118.390	514,996.500	
SIGNATURE BANK	1,500	117.470	176,205.000	
COSTAR GROUP INC	1,090	616.010	671,450.900	
SVB FINANCIAL GROUP	1,490	201.280	299,907.200	
AMERCO	220	355.890	78,295.800	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,850	164.750	304,787.500	
MERCADOLIBRE INC	1,270	597.790	759,193.300	
HANESBRANDS INC	11,000	14.120	155,320.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,300	147.740	339,802.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	8,166	93.740	765,480.840	
IPG PHOTONICS CORP	1,020	133.510	136,180.200	
DEXCOM INC	2,700	160.490	433,323.000	
COPART INC	5,850	81.380	476,073.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,650	95.600	444,540.000	
SEATTLE GENETICS INC	3,250	70.460	228,995.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,270	175.060	397,386.200	
TRANSDIGM GROUP INC	1,430	533.910	763,491.300	
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,900	21.210	209,979.000	
KINDER MORGAN INC	60,781	20.410	1,240,540.210	
HCA HEALTHCARE INC	7,900	126.100	996,190.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,150	419.400	482,310.000	
CABOT OIL & GAS CORP	12,050	17.550	211,477.500	
T-MOBILE US INC	10,000	79.150	791,500.000	
ZILLOW GROUP INC - C	3,450	31.450	108,502.500	
COCA-COLA CO/THE	117,250	55.230	6,475,717.500	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	7,100	55.660	395,186.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,850	73.250	355,262.500	
EATON VANCE CORP	3,050	43.450	132,522.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,650	26.920	232,858.000	
CSX CORP	22,150	67.520	1,495,568.000	
FLUOR CORP	3,650	19.340	70,591.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,980	172.930	515,331.400	
EXPEDIA GROUP INC	4,075	131.710	536,718.250	
AUTOLIV INC	2,400	74.720	179,328.000	
AMAZON.COM INC	12,250	1,833.510	22,460,497.500	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	8,000	17.270	138,160.000	

FLOWERVE CORP	3,550	44.020	156,271.000
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,000	226.290	1,357,740.000
EXXON MOBIL CORP	123,655	70.930	8,770,849.150
FLIR SYSTEMS INC	3,750	51.020	191,325.000
AES CORP	20,100	15.310	307,731.000
EVEREST RE GROUP LTD	1,240	249.000	308,760.000
EOG RESOURCES INC	17,300	76.440	1,322,412.000
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	4,850	91.820	445,327.000
ABIOMED INC	1,290	189.430	244,364.700
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,650	86.320	401,388.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,240	74.280	686,347.200
FORD MOTOR CO	117,123	9.340	1,093,928.820
MACY'S INC	9,198	15.390	141,557.220
DISCOVERY INC - A	4,690	27.340	128,224.600
EXACT SCIENCES CORP	3,700	120.860	447,182.000
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	27.260	133,219.620
DISCOVERY INC-C	10,089	25.670	258,984.630
AERCAP HOLDINGS NV	4,000	54.520	218,080.000
FORTINET INC	4,150	80.100	332,415.000
MARKEL CORP	410	1,160.180	475,673.800
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,400	21.810	95,964.000
NEXTERA ENERGY INC	13,850	220.140	3,048,939.000
FREEMPORT-MCMORAN INC	43,408	9.420	408,903.360
US BANCORP	44,400	53.410	2,371,404.000
UNITED RENTALS INC	2,300	116.890	268,847.000
F5 NETWORKS INC	1,750	132.960	232,680.000
FASTENAL CO	16,300	31.560	514,428.000
FISERV INC	16,663	108.620	1,809,935.060
GENERAL ELECTRIC CO	254,450	8.710	2,216,259.500
NEKTAR THERAPEUTICS	5,000	17.010	85,050.000
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	6,100	52.120	317,932.000
GENERAL MOTORS CO	37,800	38.780	1,465,884.000
TRIPADVISOR INC	3,300	37.880	125,004.000
GENERAL DYNAMICS CORP	7,100	192.670	1,367,957.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,490	207.210	1,966,422.900
ALPHABET INC-CL A	8,730	1,206.320	10,531,173.600
ALPHABET INC-CL C	9,167	1,204.930	11,045,593.310
OWENS CORNING	3,150	55.880	176,022.000

GENERAL MILLS INC	17,850	54.960	981,036.000	
FIRSTENERGY CORP	15,268	46.680	712,710.240	
GENUINE PARTS CO	4,300	94.330	405,619.000	
IHS MARKIT LTD	11,334	67.910	769,691.940	
FIFTH THIRD BANCORP	23,800	26.760	636,888.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	6,410	214.700	1,376,227.000	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	27.790	83,370.000	
HALLIBURTON CO	26,300	19.090	502,067.000	
HOME DEPOT INC	32,600	231.130	7,534,838.000	
ASSURANT INC	1,750	124.410	217,717.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,700	13.540	429,218.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,190	215.000	255,850.000	
HERSHEY CO/THE	4,350	158.980	691,563.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,450	32.550	144,847.500	
HUMANA INC	3,930	273.510	1,074,894.300	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,800	105.810	931,128.000	
HELMERICH & PAYNE	2,900	38.430	111,447.000	
HENRY SCHEIN INC	4,500	61.560	277,020.000	
HP INC	45,100	19.100	861,410.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	39,400	14.570	574,058.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,800	41.650	199,920.000	
HOLLYFRONTIER CORP	4,700	48.640	228,608.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	6,000	42.790	256,740.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,500	41.250	103,125.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,900	41.310	491,589.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	19,853	27.280	541,589.840	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	25,800	140.570	3,626,706.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	10,700	39.430	421,901.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,000	51.570	206,280.000	
ZOETIS INC	14,150	128.430	1,817,284.500	
INGERSOLL-RAND PLC	6,979	121.600	848,646.400	
CHENIERE ENERGY INC	6,550	61.990	406,034.500	
ALLEGION PLC	2,650	98.950	262,217.500	
LEGGETT & PLATT INC	3,500	38.980	136,430.000	



LIBERTY GLOBAL PLC- C	14,773	26.530	391,927.690	
WASTE CONNECTIONS INC	7,557	91.890	694,412.730	
JUNIPER NETWORKS INC	9,650	24.170	233,240.500	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,200	85.700	188,540.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,420	105.210	359,818.200	
JOHNSON & JOHNSON	77,700	128.210	9,961,917.000	
ABBVIE INC	42,779	67.620	2,892,715.980	
HOLOGIC INC	7,550	49.710	375,310.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	9,950	138.050	1,373,597.500	
KROGER CO	22,950	24.700	566,865.000	
KLA CORP	4,650	150.980	702,057.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	7,370	386.560	2,848,947.200	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,560	302.640	774,758.400	
L BRANDS INC	6,500	16.710	108,615.000	
LOWE'S COS INC	23,350	114.710	2,678,478.500	
ELI LILLY & CO	25,905	114.050	2,954,465.250	
LAM RESEARCH CORP	4,430	227.920	1,009,685.600	
JONES LANG LASALLE INC	1,450	137.450	199,302.500	
LOEWS CORP	7,900	49.280	389,312.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,799	55.200	320,104.800	
MCDONALD'S CORP	22,100	220.030	4,862,663.000	
3M CO	16,650	163.940	2,729,601.000	
FACEBOOK INC-CLASS A	70,150	187.490	13,152,423.500	
MANPOWERGROUP INC	1,780	82.810	147,401.800	
S&P GLOBAL INC	7,180	267.750	1,922,445.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,840	258.030	474,775.200	
CONCHO RESOURCES INC	5,800	69.680	404,144.000	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	6,600	33.820	223,212.000	
PHILLIPS 66	13,450	100.910	1,357,239.500	
TECHNIPFMC PLC	12,100	25.180	304,678.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,450	28.300	408,935.000	
DXC TECHNOLOGY CO	7,788	34.130	265,804.440	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,650	164.980	602,177.000	
MYLAN NV	14,850	20.520	304,722.000	
METLIFE INC	23,500	46.230	1,086,405.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,100	24.860	449,966.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,510	235.700	355,907.000	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	39.630	190,224.000	

MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,778	174.800	835,194.400	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	740	684.980	506,885.200	
BAKER HUGHES A GE CO	14,473	23.530	340,549.690	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,380	161.040	544,315.200	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,940	36.480	107,251.200	
MERCK & CO. INC.	74,471	86.570	6,446,954.470	
DUPONT DE NEMOURS INC	22,268	69.220	1,541,390.960	
MASCO CORP	8,600	41.750	359,050.000	
M & T BANK CORP	3,869	146.440	566,576.360	
MARSH & MCLENNAN COS	15,150	100.910	1,528,786.500	
HEICO CORP-CLASS A	2,300	109.360	251,528.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	8,372	129.430	1,083,587.960	
WORKDAY INC-CLASS A	4,800	172.300	827,040.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,850	116.800	216,080.000	
SQUARE INC - A	10,100	62.000	626,200.000	
TRANSUNION	5,500	84.910	467,005.000	
VISTRA ENERGY CORP	10,050	25.530	256,576.500	
CAPRI HOLDINGS LTD	4,450	28.070	124,911.500	
BEIGENE LTD-ADR	1,050	120.610	126,640.500	
NETAPP INC	7,450	51.980	387,251.000	
NIKE INC -CL B	36,450	88.690	3,232,750.500	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,900	175.060	1,382,974.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,800	90.520	615,536.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,750	80.560	302,100.000	
ALLY FINANCIAL INC	11,450	32.570	372,926.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,650	367.770	1,710,130.500	
APTIV PLC	7,700	88.750	683,375.000	
NEWMONT GOLDCORP CORP	24,461	38.660	945,662.260	
MCKESSON CORP	5,550	143.600	796,980.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,100	56.920	461,052.000	
XYLEM INC	5,150	78.390	403,708.500	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	45,050	72.970	3,287,298.500	
NUCOR CORP	8,700	50.160	436,392.000	
WESTERN UNION CO	12,946	22.850	295,816.100	
GODADDY INC - CLASS A	5,300	64.530	342,009.000	
NEWELL BRANDS INC	12,292	17.240	211,914.080	
EVERGY INC	7,450	63.960	476,502.000	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	25,724	45.460	1,169,413.040	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	700	216.130	151,291.000	
OKTA INC	3,000	121.250	363,750.000	
LIBERTY BROADBAND-C	3,150	108.500	341,775.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	10,705	27.350	292,781.750	
LINDE PLC	15,996	189.520	3,031,561.920	
WIX.COM LTD	1,450	134.810	195,474.500	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	8,300	20.970	174,051.000	
KKR & CO INC -A	14,700	26.820	394,254.000	
PAYCHEX INC	9,350	84.070	786,054.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,300	399.730	919,379.000	
ALTRIA GROUP INC	54,650	43.850	2,396,402.500	
PFIZER INC	162,213	36.500	5,920,774.500	
ALKERMES PLC	4,000	20.260	81,040.000	
CIGNA CORP	11,080	153.800	1,704,104.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	4,551	53.360	242,841.360	
ALTICE USA INC- A	4,100	29.150	119,515.000	
XCEL ENERGY INC	14,850	64.800	962,280.000	
STERIS PLC	2,500	154.490	386,225.000	
FOX CORP - CLASS B	4,833	33.870	163,693.710	
FOX CORP - CLASS A	9,999	34.230	342,265.770	
STRYKER CORP	9,800	221.400	2,169,720.000	
DOW INC	22,068	43.240	954,220.320	
PARKER HANNIFIN CORP	3,750	173.490	650,587.500	
UBER TECHNOLOGIES INC	5,200	31.860	165,672.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,950	128.870	637,906.500	
POLARIS INC	1,550	80.750	125,162.500	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	73,367	122.870	9,014,603.290	
EXELON CORP	28,772	48.120	1,384,508.640	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,600	103.840	685,344.000	
NVR INC	100	3,649.750	364,975.000	
CONOCOPHILLIPS	33,200	53.630	1,780,516.000	
TWILIO INC - A	3,150	123.700	389,655.000	
DOCUSIGN INC	2,900	56.270	163,183.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,400	249.620	349,468.000	
PEPSICO INC	40,550	137.370	5,570,353.500	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,100	113.710	125,081.000	

DROPBOX INC-CLASS A	5,200	18.970	98,644.000
MONGODB INC	1,250	140.630	175,787.500
SNAP INC - A	20,800	16.620	345,696.000
CORTEVA INC	21,568	28.390	612,315.520
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,800	82.170	969,606.000
AMCOR PLC	47,900	9.870	472,773.000
ROKU INC	2,400	169.860	407,664.000
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,150	125.700	647,355.000
ACCENTURE PLC-CL A	18,480	201.120	3,716,697.600
PENTAIR PLC	4,705	36.320	170,885.600
QUALCOMM INC	35,050	78.840	2,763,342.000
INVESCO LTD	10,950	15.980	174,981.000
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,050	147.210	301,780.500
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,350	54.500	455,075.000
RAYTHEON COMPANY	8,220	190.460	1,565,581.200
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,400	292.000	700,800.000
REPUBLIC SERVICES INC	6,750	88.880	599,940.000
BOOKING HOLDINGS INC	1,290	1,967.630	2,538,242.700
ROSS STORES INC	10,700	109.180	1,168,226.000
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,650	100.610	266,616.500
RESMED INC	4,150	140.300	582,245.000
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,800	104.210	395,998.000
ROBERT HALF INTL INC	3,350	53.410	178,923.500
RALPH LAUREN CORP	1,450	94.580	137,141.000
PERKINELMER INC	3,100	83.740	259,594.000
REGIONS FINANCIAL CORP	30,235	14.850	448,989.750
CHEVRON CORP	55,818	118.260	6,601,036.680
EDISON INTERNATIONAL	10,300	70.980	731,094.000
TESLA INC	3,770	227.450	857,486.500
SYMANTEC CORP	18,450	24.520	452,394.000
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,422	137.830	609,484.260
SYNOPSYS INC	4,350	145.510	632,968.500
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,615	425.720	1,964,697.800
CBRE GROUP INC - A	9,150	53.860	492,819.000
TWITTER INC	21,150	45.420	960,633.000
SOUTHERN CO/THE	30,250	59.680	1,805,320.000
SYSCO CORP	14,500	75.710	1,097,795.000
TRAVELERS COS INC/THE	7,703	152.840	1,177,326.520

SEI INVESTMENTS COMPANY	3,950	58.870	232,536.500	
STEEL DYNAMICS INC	6,200	27.390	169,818.000	
SCHLUMBERGER LTD	41,102	34.200	1,405,688.400	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,600	47.980	220,708.000	
AT&T INC	213,391	36.250	7,735,423.750	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,050	52.140	211,167.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	12,300	18.570	228,411.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,430	534.740	1,299,418.200	
SEMPRA ENERGY	7,900	142.000	1,121,800.000	
TIFFANY & CO	3,250	88.220	286,715.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,600	54.330	412,908.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	27,200	127.090	3,456,848.000	
SALESFORCE.COM INC	24,321	151.070	3,674,173.470	
WESTROCK CO	7,130	35.120	250,405.600	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	22,984	42.820	984,174.880	
UNION PACIFIC CORP	20,950	164.600	3,448,370.000	
MARATHON OIL CORP	24,800	12.450	308,760.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	19,388	52.470	1,017,288.360	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	23,837	133.690	3,186,768.530	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	20,300	120.080	2,437,624.000	
UNUM GROUP	5,900	26.480	156,232.000	
SPRINT CORP	23,165	6.820	157,985.300	
IQVIA HOLDINGS INC	4,894	154.070	754,018.580	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	51.030	221,980.500	
AMEREN CORPORATION	7,200	76.190	548,568.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	27,676	229.000	6,337,804.000	
VERISIGN INC	3,200	207.570	664,224.000	
VALERO ENERGY CORP	12,242	78.130	956,467.460	
ULTA BEAUTY INC	1,610	233.100	375,291.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8,188	44.580	365,021.040	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,500	148.260	370,650.000	
ANTHEM INC	7,480	249.380	1,865,362.400	
WALT DISNEY CO/THE	52,712	139.550	7,355,959.600	
WELLS FARGO & CO	124,822	47.150	5,885,357.300	
WASTE MANAGEMENT INC	12,550	119.330	1,497,591.500	
WILLIAMS COS INC	34,700	24.120	836,964.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,450	103.540	357,213.000	

WHIRLPOOL CORP	1,900	143.880	273,372.000	
WALMART INC	42,000	114.730	4,818,660.000	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	82.690	239,801.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,100	139.740	852,414.000	
WYNN RESORTS LTD	2,900	111.440	323,176.000	
XEROX HOLDINGS CORP	5,911	29.850	176,443.350	
WABTEC CORP	5,411	68.270	369,408.970	
TJX COMPANIES INC	36,050	56.140	2,023,847.000	
WATERS CORP	2,050	217.240	445,342.000	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,800	86.300	155,340.000	
ALLERGAN PLC	9,757	163.260	1,592,927.820	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,650	202.730	334,504.500	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	23,000	52.560	1,208,880.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,723	197.750	736,223.250	
WESTERN DIGITAL CORP	8,400	62.240	522,816.000	
WEC ENERGY GROUP INC	9,080	93.130	845,620.400	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	14,600	60.420	882,132.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	50,500	185.740	9,379,870.000	
PPL CORP	21,100	29.790	628,569.000	
PULTEGROUP INC	7,500	34.570	259,275.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,750	115.780	781,515.000	
NORTHERN TRUST CORP	6,000	89.820	538,920.000	
NVIDIA CORP	16,700	178.650	2,983,455.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,350	244.790	575,256.500	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	13,343	131.720	1,757,539.960	
QURATE RETAIL INC-SERIES A	11,450	11.180	128,011.000	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,300	40.290	213,537.000	
TYSON FOODS INC-CL A	8,800	86.040	757,152.000	
NETFLIX INC	12,620	290.170	3,661,945.400	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	11,700	295.050	3,452,085.000	
NRG ENERGY INC	7,950	37.740	300,033.000	
GLOBE LIFE INC	2,925	91.680	268,164.000	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,850	89.190	432,571.500	

TEXTRON INC	6,850	46.480	318,388.000	
NEWS CORP - CLASS A	11,737	14.110	165,609.070	
OGE ENERGY CORP	5,950	43.110	256,504.500	
OMNICOM GROUP	6,400	77.540	496,256.000	
ORACLE CORP	72,783	53.160	3,869,144.280	
MASTERCARD INC - A	26,350	291.380	7,677,863.000	
ONEOK INC	11,900	71.830	854,777.000	
CENTURYLINK INC	29,452	11.800	347,533.600	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,020	374.960	1,132,379.200	
YUM! BRANDS INC	8,950	119.210	1,066,929.500	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,350	130.760	438,046.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,330	125.960	167,526.800	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,650	53.420	301,823.000	
NOBLE ENERGY INC	14,550	22.710	330,430.500	
BANK OF AMERICA CORP	264,901	27.730	7,345,704.730	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,250	72.130	378,682.500	
NORDSTROM INC	3,000	31.070	93,210.000	
AMERICAN EXPRESS CO	20,900	120.190	2,511,971.000	
ANALOG DEVICES INC	10,649	112.670	1,199,822.830	
ADVANCED MICRO DEVICES	30,400	30.560	929,024.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,300	46.480	385,784.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	25,822	54.850	1,416,336.700	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,150	79.870	411,330.500	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,250	108.410	569,152.500	
AVERY DENNISON CORP	2,500	114.190	285,475.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	16,500	64.450	1,063,425.000	
EMERSON ELECTRIC CO	18,300	62.250	1,139,175.000	
AON PLC	6,970	195.280	1,361,101.600	
AMGEN INC	18,000	207.730	3,739,140.000	
TAPESTRY INC	8,350	23.690	197,811.500	
EATON CORP PLC	12,136	83.250	1,010,322.000	
CELGENE CORP	20,800	97.150	2,020,720.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,980	204.750	1,019,655.000	
APPLIED MATERIALS INC	27,200	50.100	1,362,720.000	
CIT GROUP INC	2,800	43.080	120,624.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,900	42.270	122,583.000	
CME GROUP INC	10,400	223.070	2,319,928.000	

NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,694	22.170	259,255.980	
ECOLAB INC	7,550	206.690	1,560,509.500	
EQUIFAX INC	3,650	146.760	535,674.000	
GAP INC/THE	5,950	16.860	100,317.000	
GILEAD SCIENCES INC	37,250	64.820	2,414,545.000	
HORMEL FOODS CORP	8,350	42.600	355,710.000	
STATE STREET CORP	10,943	51.840	567,285.120	
SUNTRUST BANKS INC	12,948	62.900	814,429.200	
SCHWAB (CHARLES) CORP	35,600	39.900	1,420,440.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	14,200	89.780	1,274,876.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,850	44.980	218,153.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,850	65.020	250,327.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,000	45.430	408,870.000	
FEDEX CORP	7,100	161.870	1,149,277.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,504	88.190	1,190,917.760	
FMC CORP	3,950	87.400	345,230.000	
FLEX LTD	14,750	10.230	150,892.500	
CERNER CORP	9,350	67.360	629,816.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,024	117.860	356,408.640	
CITRIX SYSTEMS INC	3,700	94.410	349,317.000	
INTEL CORP	129,850	50.920	6,611,962.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,500	20.730	238,395.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10,350	60.320	624,312.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	9,450	152.490	1,441,030.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	46,100	6.250	288,125.000	
ILLUMINA INC	4,240	270.000	1,144,800.000	
SEALED AIR CORP	4,400	39.710	174,724.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,410	505.260	1,722,936.600	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,700	107.440	397,528.000	
SNAP-ON INC	1,550	151.070	234,158.500	
CARMAX INC	4,950	86.000	425,700.000	
COMERICA INC	4,500	61.610	277,245.000	
INGREDION INC	1,900	79.170	150,423.000	
DUKE ENERGY CORP	21,228	93.760	1,990,337.280	
TARGET CORP	14,900	109.850	1,636,765.000	
DOVER CORP	4,250	95.140	404,345.000	
VW GRAINGER INC	1,400	278.220	389,508.000	



JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,950	92.320	364,664.000	
CINTAS CORP	2,620	266.190	697,417.800	
CONAGRA BRANDS INC	13,800	28.660	395,508.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,100	71.220	292,002.000	
CLOROX COMPANY	3,750	162.040	607,650.000	
ENTERGY CORP	5,700	113.550	647,235.000	
MICROSOFT CORP	213,150	139.100	29,649,165.000	
INCYTE CORP	5,350	79.240	423,934.000	
CVS HEALTH CORP	37,669	62.230	2,344,141.870	
MEDTRONIC PLC	38,838	108.690	4,221,302.220	
MICRON TECHNOLOGY INC	32,300	48.970	1,581,731.000	
BLACKROCK INC	3,400	423.830	1,441,022.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	14,900	28.500	424,650.000	
HASBRO INC	3,600	112.400	404,640.000	
KELLOGG CO	7,300	64.220	468,806.000	
KEYCORP	29,900	16.800	502,320.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,000	128.910	386,730.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	42,161	56.630	2,387,577.430	
KOHL'S CORP	4,950	48.560	240,372.000	
COOPER COS INC/THE	1,400	302.840	423,976.000	
APACHE CORP	10,610	22.350	237,133.500	
CHUBB LTD	13,349	161.030	2,149,589.470	
ARROW ELECTRONICS INC	2,400	72.800	174,720.000	
ALLSTATE CORP	9,600	105.310	1,010,976.000	
EBAY INC	25,250	40.370	1,019,342.500	
PAYPAL HOLDINGS INC	32,300	110.050	3,554,615.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	4,150	68.050	282,407.500	
XILINX INC	7,550	105.940	799,847.000	
DISH NETWORK CORP-A	6,450	35.700	230,265.000	
ZIONS BANCORP NA	5,200	40.940	212,888.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,500	207.030	1,345,695.000	
TRIMBLE INC	7,050	37.940	267,477.000	
LENNAR CORP-A	8,100	52.000	421,200.000	
LEAR CORP	1,800	120.260	216,468.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,000	42.920	300,440.000	
PROGRESSIVE CORP	16,800	77.390	1,300,152.000	
PACCAR INC	10,037	68.340	685,928.580	

	PVH CORP	2,000	85.390	170,780.000	
	BIOGEN INC	5,610	224.570	1,259,837.700	
	IDEXX LABORATORIES INC	2,520	288.470	726,944.400	
	STARBUCKS CORP	36,050	95.740	3,451,427.000	
	PTC INC	3,150	67.130	211,459.500	
	PERRIGO CO PLC	3,800	49.920	189,696.000	
	EVERSOURCE ENERGY	9,480	82.350	780,678.000	
	INTUIT INC	7,640	287.800	2,198,792.000	
	BORGWARNER INC	6,300	35.420	223,146.000	
	BEST BUY CO INC	6,900	66.350	457,815.000	
	BALL CORP	9,184	78.300	719,107.200	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	40,597	43.450	1,763,939.650	
	ELECTRONIC ARTS INC	8,650	98.530	852,284.500	
	VULCAN MATERIALS CO	3,950	145.010	572,789.500	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,550	181.330	1,369,041.500	
	VF CORP	10,100	87.610	884,861.000	
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	10,071	43.630	439,397.730	
	VIACOM INC-CLASS B	10,071	25.880	260,637.480	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,720	118.810	204,353.200	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,600	109.550	284,830.000	
	CARNIVAL CORP	12,650	45.720	578,358.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	132,490	46.350	6,140,911.500	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,700	31.510	211,117.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,700	53.290	357,043.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	6.870	61,830.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	35,300	5.700	201,210.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 739,258,720.580 (79,063,720,166)	
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	4.519	87,216.700	
	TUI AG-DI	13,797	8.492	117,164.120	
	BP PLC	605,000	5.010	3,031,050.000	
	UNILEVER PLC	33,260	51.900	1,726,194.000	
	BARCLAYS PLC	521,800	1.401	731,041.800	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	52,700	7.870	414,749.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	56,100	1.956	109,759.650	
	PRUDENTIAL PLC	75,700	14.045	1,063,206.500	

ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	145,791	1.881	274,232.870	
EVRAZ PLC	15,000	4.995	74,925.000	
JOHNSON MATTHEY PLC	6,064	31.000	187,984.000	
BAE SYSTEMS PLC	94,300	5.720	539,396.000	
AVIVA PLC	113,866	3.640	414,472.240	
GLAXOSMITHKLINE PLC	146,500	17.152	2,512,768.000	
INFORMA PLC	36,200	8.508	307,989.600	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	10,540	10.936	115,265.440	
MELROSE INDUSTRIES PLC	145,500	2.034	295,947.000	
AUTO TRADER GROUP PLC	28,300	5.192	146,933.600	
DCC PLC	2,800	71.300	199,640.000	
OCADO GROUP PLC	13,500	13.635	184,072.500	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,100	81.250	170,625.000	
HALMA PLC	11,000	20.180	221,980.000	
GVC HOLDINGS PLC	16,700	6.842	114,261.400	
NMC HEALTH PLC	2,700	27.660	74,682.000	
RELX PLC	57,346	19.680	1,128,569.280	
DIAGEO PLC	71,300	34.585	2,465,910.500	
RIO TINTO PLC	33,350	42.370	1,413,039.500	
STANDARD CHARTERED PLC	82,100	6.490	532,829.000	
TESCO PLC	296,700	2.325	689,827.500	
FRESNILLO PLC	5,600	7.192	40,275.200	
SMITH & NEPHEW PLC	26,450	19.765	522,784.250	
GLENCORE PLC	324,525	2.416	784,052.400	
JOHN WOOD GROUP PLC	18,000	3.847	69,246.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	8,150	19.800	161,370.000	
SMITHS GROUP PLC	11,383	16.860	191,917.380	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	41,983	2.824	118,559.990	
PEARSON PLC	23,563	8.590	202,406.170	
SAINSBURY (J) PLC	54,225	2.016	109,317.600	
NEXT PLC	4,200	61.300	257,460.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	93,200	1.504	140,219.400	
WHITBREAD PLC	4,961	44.530	220,913.330	
BUNZL PLC	9,605	20.820	199,976.100	
VODAFONE GROUP PLC	802,183	1.557	1,249,480.240	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,661	48.080	176,020.880	
KINGFISHER PLC	62,411	1.978	123,448.950	

WPP PLC	38,400	9.838	377,779.200	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	20,627	7.842	161,756.930	
SEVERN TRENT PLC	7,133	20.240	144,371.920	
RENTOKIL INITIAL PLC	54,000	4.653	251,262.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	21,200	63.890	1,354,468.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	15,150	9.690	146,803.500	
SCHRODERS PLC	3,450	28.470	98,221.500	
SSE PLC	30,000	11.500	345,000.000	
WEIR GROUP PLC/THE	7,950	14.880	118,296.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	31,000	6.130	190,030.000	
ASTRAZENECA PLC	38,550	72.550	2,796,802.500	
FERGUSON PLC	7,087	63.740	451,725.380	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	183,000	2.321	424,743.000	
3I GROUP PLC	29,391	11.455	336,673.900	
ASHTED GROUP PLC	13,650	22.860	312,039.000	
SAGE GROUP PLC/THE	32,314	7.108	229,687.910	
NATIONAL GRID PLC	102,934	8.410	865,674.940	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,081,465	0.500	1,041,565.080	
RSA INSURANCE GROUP PLC	31,760	5.228	166,041.280	
IMPERIAL BRANDS PLC	28,800	21.350	614,880.000	
CENTRICA PLC	176,160	0.678	119,542.170	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,600	39.800	143,280.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	67,710	29.320	1,985,257.200	
BHP GROUP PLC	63,527	17.594	1,117,694.030	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,600	23.540	249,524.000	
HSBC HOLDINGS PLC	601,650	6.010	3,615,916.500	
ANGLO AMERICAN PLC	31,083	18.480	574,413.840	
MONDI PLC	14,250	16.150	230,137.500	
WM MORRISON SUPERMARKETS	66,300	1.874	124,279.350	
CARNIVAL PLC	4,861	35.150	170,864.150	
EASYJET PLC	4,000	9.460	37,840.000	
COMPASS GROUP PLC	46,489	20.960	974,409.440	
PERSIMMON PLC	9,300	19.115	177,769.500	
BT GROUP PLC	246,100	1.676	412,562.040	
COCA-COLA HBC AG-DI	5,800	28.110	163,038.000	
BURBERRY GROUP PLC	12,189	22.520	274,496.280	

	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	5,136	51.230	263,117.280	
	INTERTEK GROUP PLC	4,800	56.160	269,568.000	
	ITV PLC	102,100	1.205	123,081.550	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	9,199	73.220	673,550.780	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	130,500	22.595	2,948,647.500	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	110,518	22.560	2,493,286.080	
	MEGGITT PLC	24,100	6.430	154,963.000	
	G4S PLC	43,500	1.865	81,127.500	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,550	20.730	115,051.500	
	INVESTEC PLC	18,300	4.449	81,416.700	
	ANTOFAGASTA PLC	11,400	8.930	101,802.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	2.515	178,217.930	
	EXPERIAN PLC	27,554	26.310	724,945.740	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 52,920,801.690 (6,949,559,678)	
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	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	34,500	14.390	496,455.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	257.600	257,600.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	17,600	16.430	289,168.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	561.900	337,140.000	
	BANK HAPOALIM BM	30,700	26.910	826,137.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	45,200	24.180	1,092,936.000	
	NICE LTD	1,850	539.000	997,150.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,100	81.610	334,601.000	
	イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 4,631,187.000 (140,556,525)	
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	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	78,800	3.410	268,708.000	
	BHP GROUP LTD	86,650	36.310	3,146,261.500	
	SOUTH32 LTD	151,600	2.790	422,964.000	
	ALUMINA LTD	69,300	2.220	153,846.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	28,550	31.850	909,317.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	42,500	8.410	357,425.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	13,300	10.980	146,034.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	84,450	27.750	2,343,487.500	

WESTPAC BANKING CORP	101,348	28.630	2,901,593.240	
SANTOS LTD	53,100	7.380	391,878.000	
AUSNET SERVICES	50,000	1.770	88,500.000	
AUST AND NZ BANKING GROUP	83,850	27.070	2,269,819.500	
RIO TINTO LTD	11,300	90.370	1,021,181.000	
ORIGIN ENERGY LTD	53,500	7.630	408,205.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	5.880	352,800.000	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	20.950	71,230.000	
COLES GROUP LTD	34,545	14.690	507,466.050	
OIL SEARCH LTD	38,400	7.110	273,024.000	
SEEK LTD	9,600	20.890	200,544.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	20,500	18.950	388,475.000	
NEWCREST MINING LTD	23,400	36.780	860,652.000	
INCITEC PIVOT LTD	49,800	3.280	163,344.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	52,150	79.540	4,148,011.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	7,150	24.780	177,177.000	
ORICA LTD	11,500	21.620	248,630.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	38,450	12.520	481,394.000	
CIMIC GROUP LTD	2,800	30.910	86,548.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	37,600	38.060	1,431,056.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	10.870	148,919.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	57,700	4.770	275,229.000	
CROWN RESORTS LTD	11,600	12.120	140,592.000	
TELSTRA CORP LTD	120,200	3.610	433,922.000	
AMP LTD	102,000	1.745	177,990.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	13,350	23.020	307,317.000	
MACQUARIE GROUP LTD	9,684	127.080	1,230,642.720	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	17,450	29.930	522,278.500	
BANK OF QUEENSLAND LTD	10,800	9.200	99,360.000	
CSL LTD	13,350	241.990	3,230,566.500	
WESFARMERS LTD	34,300	39.540	1,356,222.000	
COCHLEAR LTD	1,650	215.990	356,383.500	
BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	12.780	208,314.000	
SUNCORP GROUP LTD	39,400	13.740	541,356.000	
BORAL LTD	35,800	4.420	158,236.000	
ASX LTD	5,800	85.720	497,176.000	
COMPUTERSHARE LTD	13,900	15.770	219,203.000	

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	4.450	62,300.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	70,936	8.180	580,256.480	
	SONIC HEALTHCARE LTD	13,250	29.500	390,875.000	
	CHALLENGER LTD	17,400	6.960	121,104.000	
	WORLEYPARSONS LTD	9,400	12.780	120,132.000	
	AGL ENERGY LTD	19,000	18.900	359,100.000	
	BRAMBLES LTD	47,400	11.270	534,198.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	47.930	67,102.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,250	64.440	273,870.000	
	TPG TELECOM LTD	8,700	6.420	55,854.000	
	REA GROUP LTD	1,600	105.210	168,336.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	3,800	54.320	206,416.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 37,062,821.990 (2,711,145,429)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	8,300	33.600	278,880.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	600	1,303.810	782,286.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,996	17.540	105,169.840	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	7,187	99.620	715,968.940	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13,200	38.000	501,600.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,050	129.670	525,163.500	
	BCE INC	4,530	63.540	287,836.200	
	FRANCO-NEVADA CORP	5,700	127.230	725,211.000	
	SUNCOR ENERGY INC	46,230	39.130	1,808,979.900	
	METRO INC/CN	7,700	57.890	445,753.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	10,200	63.260	645,252.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	35,900	72.080	2,587,672.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	13,050	103.540	1,351,197.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	53,800	72.940	3,924,172.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,300	29.000	240,700.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	42,250	100.940	4,264,715.000	
	TOURMALINE OIL CORP	8,200	13.150	107,830.000	
	VERMILION ENERGY INC	4,500	20.010	90,045.000	
	TC ENERGY CORP	27,850	67.350	1,875,697.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	15,529	48.820	758,125.780	
	BOMBARDIER INC-B	62,800	1.780	111,784.000	

BARRICK GOLD CORP	51,400	23.550	1,210,470.000	
CAE INC	7,900	34.310	271,049.000	
THOMSON REUTERS CORP	5,812	93.260	542,027.120	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,300	37.100	196,630.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	46.130	73,808.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,650	56.700	263,655.000	
HYDRO ONE LTD	9,200	24.580	226,136.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	74.220	405,241.200	
WSP GLOBAL INC	3,000	73.120	219,360.000	
QUEBECOR INC -CL B	5,300	30.110	159,583.000	
EMERA INC	7,200	56.920	409,824.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,000	38.850	155,400.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	10,600	65.630	695,678.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	7,200	78.480	565,056.000	
STARS GROUP INC/THE	6,300	21.470	135,261.000	
AIR CANADA	4,100	44.560	182,696.000	
KINROSS GOLD CORP	37,900	6.540	247,866.000	
BANK OF MONTREAL	19,300	92.230	1,780,039.000	
POWER CORP OF CANADA	9,400	28.090	264,046.000	
METHANEX CORP	1,700	44.050	74,885.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,000	501.700	1,505,100.000	
NUTRIEN LTD	17,619	68.120	1,200,206.280	
AURORA CANNABIS INC	19,800	8.020	158,796.000	
CANOPY GROWTH CORP	6,200	36.450	225,990.000	
CRONOS GROUP INC	5,500	15.710	86,405.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,800	62.470	362,326.000	
CAMECO CORP	10,600	11.920	126,352.000	
TELUS CORP	5,400	48.940	264,276.000	
POWER FINANCIAL CORP	8,000	28.850	230,800.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	15,100	23.080	348,508.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	137.710	247,878.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	35,100	31.510	1,106,001.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	800	589.020	471,216.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,200	68.270	628,084.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,237	111.210	248,776.770	
BLACKBERRY LTD	16,000	9.480	151,680.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	17,450	56.250	981,562.500	
ENBRIDGE INC	60,600	45.250	2,742,150.000	



BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	25,550	70.550	1,802,552.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	59,500	22.710	1,351,245.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	9,500	29.260	277,970.000	
ENCANA CORP	41,800	5.960	249,128.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,100	318.350	1,305,235.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,300	57.350	189,255.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,300	49.070	309,141.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	21,250	122.390	2,600,787.500	
CGI INC - CLASS A	7,300	105.600	770,880.000	
HUSKY ENERGY INC	9,358	9.030	84,502.740	
ONEX CORPORATION	2,600	78.920	205,192.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,800	26.150	360,870.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	16.000	72,000.000	
IGM FINANCIAL INC	2,400	37.230	89,352.000	
OPEN TEXT CORP	8,100	54.750	443,475.000	
CI FINANCIAL CORP	7,000	19.080	133,560.000	
SAPUTO INC	7,100	40.510	287,621.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	9.050	174,665.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	12,800	85.420	1,093,376.000	
FORTIS INC	13,000	55.620	723,060.000	
LUNDIN MINING CORP	19,400	6.580	127,652.000	
CENOVUS ENERGY INC	31,400	12.000	376,800.000	
DOLLARAMA INC	9,000	50.410	453,690.000	
ATCO LTD -CLASS I	2,200	47.450	104,390.000	
ALTAGAS LTD	7,900	18.320	144,728.000	
FIRST CAPITAL REALTY INC	4,800	22.350	107,280.000	
KEYERA CORP	6,000	33.470	200,820.000	
INTER PIPELINE LTD	12,800	25.180	322,304.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 55,660,388.270 (4,518,510,319)	
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	37,300	25.500	951,150.000	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	52,700	24.760	1,304,852.000	
SINGAPORE AIRLINES LTD	14,970	9.020	135,029.400	
KEPPEL CORP LTD	42,900	5.960	255,684.000	
UOL GROUP LTD	14,000	7.480	104,720.000	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	13,600	9.660	131,376.000	
	CAPITALAND LTD	77,500	3.560	275,900.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	69,300	0.980	67,914.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	51,400	1.980	101,772.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	30.590	82,593.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	93,700	10.850	1,016,645.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	170,000	0.900	153,000.000	
	VENTURE CORP LTD	8,600	15.480	133,128.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	244,450	3.200	782,240.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	44,000	3.980	175,120.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	28,800	2.130	61,344.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.265	43,566.000	
	SATS LTD	19,600	4.880	95,648.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	23,300	8.450	196,885.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	64,800	2.520	163,296.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	58,900	3.860	227,354.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 6,459,216.400 (499,878,757)	
スイス・フラン	株		スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFY AG-REG	1,250	82.140	102,675.000	
	UBS GROUP AG-REG	115,900	10.730	1,243,607.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	230	588.500	135,355.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,650	54.140	251,751.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	20,890	274.150	5,726,993.500	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,100	74.050	81,455.000	
	SIKA AG-REG	3,840	145.600	559,104.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	81,000.000	243,000.000	
	ABB LTD-REG	53,800	19.210	1,033,498.000	
	SWISS RE AG	9,000	100.100	900,900.000	
	NESTLE SA-REG	90,900	113.200	10,289,880.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	560	815.800	456,848.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,260	231.400	291,564.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	75,170	12.190	916,322.300	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,400	41.420	265,088.000	

	SGS SA-REG	160	2,498.000	399,680.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	580	232.000	134,560.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,300	158.350	205,855.000	
	TEMENOS AG - REG	1,970	174.050	342,878.500	
	ALCON INC	12,430	59.300	737,099.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	850	276.700	235,195.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,472	367.000	1,641,224.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	169.100	235,049.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	19.190	109,383.000	
	NOVARTIS AG-REG	63,850	88.900	5,676,265.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	70	2,028.000	141,960.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	15,310	78.660	1,204,284.600	
	SWISSCOM AG-REG	770	489.400	376,838.000	
	GEBERIT AG-REG	1,130	462.600	522,738.000	
	GIVAUDAN-REG	280	2,741.000	767,480.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	822.200	238,438.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,690	227.400	384,306.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,200	358.300	788,260.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	52.300	79,496.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	14,290	47.150	673,773.500	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,040	482.200	501,488.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,670	148.850	248,579.500	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,330	97.950	228,223.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	7,275.000	247,350.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 38,618,444.400 (4,175,426,208)	
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	2,700	469.700	1,268,190.000	
	ERICSSON LM-B SHS	90,130	77.620	6,995,890.600	
	VOLVO AB-B SHS	44,400	137.150	6,089,460.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,800	492.200	885,960.000	
	SKF AB-B SHARES	10,550	161.650	1,705,407.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,650	222.400	1,478,960.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,900	415.000	2,033,500.000	
	TELE2 AB-B SHS	15,600	142.350	2,220,660.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	48,250	84.980	4,100,285.000	

	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	46,550	87.600	4,077,780.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	26,600	128.750	3,424,750.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	23,550	191.100	4,500,405.000	
	SKANSKA AB-B SHS	10,250	190.700	1,954,675.000	
	SANDVIK AB	33,150	144.200	4,780,230.000	
	INVESTOR AB-B SHS	13,700	463.400	6,348,580.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	19,750	298.500	5,895,375.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,550	149.250	1,425,337.500	
	TELIA CO AB	83,000	42.980	3,567,340.000	
	ALFA LAVAL AB	8,800	184.750	1,625,800.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	11,250	266.600	2,999,250.000	
	ASSA ABLOY AB-B	29,350	213.000	6,251,550.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,200	375.200	825,440.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,250	305.400	1,603,350.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	18,650	292.600	5,456,990.000	
	BOLIDEN AB	7,800	234.550	1,829,490.000	
	EPIROC AB-A	20,650	99.620	2,057,153.000	
	EPIROC AB-B	11,600	95.340	1,105,944.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,450	77.220	884,169.000	
	NORDEA BANK ABP	96,200	64.100	6,166,420.000	
	KINNEVIK AB - B	7,300	277.700	2,027,210.000	
	HEXAGON AB-B SHS	8,000	433.800	3,470,400.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,600	211.700	973,820.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クロー ナ 100,029,771.600 (1,107,329,572)	
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	52,550	357.350	18,778,742.500	
	DANSKE BANK A/S	20,100	91.220	1,833,522.000	
	ISS A/S	4,400	171.250	753,500.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	7,155.000	679,725.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	243.600	414,120.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,600	505.600	2,831,360.000	
	CARLSBERG AS-B	3,200	1,025.500	3,281,600.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,400	291.300	1,864,320.000	
	COLOPLAST-B	3,600	812.800	2,926,080.000	
	DSV A/S	6,560	693.000	4,546,080.000	
	DEMANT A/S	3,425	201.600	690,480.000	

	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	200	7,610.000	1,522,000.000	
	TRYG A/S	3,300	207.000	683,100.000	
	PANDORA A/S	3,150	300.000	945,000.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,050	588.200	1,794,010.000	
	GENMAB A/S	1,950	1,409.500	2,748,525.000	
	ORSTED A/S	5,500	680.600	3,743,300.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 50,035,464.500 (790,059,985)	
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	5.355	184,747.500	
	A2 MILK CO LTD	21,400	15.400	329,560.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	4.645	244,740.400	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	29,400	9.500	279,300.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	4.710	94,671.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	18,700	17.640	329,868.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	11,800	13.520	159,536.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 1,622,422.900 (111,541,575)	
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	41,700	31.100	1,296,870.000	
	DNB ASA	28,100	150.450	4,227,645.000	
	ORKLA ASA	21,950	82.000	1,799,900.000	
	TELENOR ASA	22,300	179.050	3,992,815.000	
	EQUINOR ASA	30,773	163.450	5,029,846.850	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,960	406.000	2,013,760.000	
	MOWI ASA	12,850	215.800	2,773,030.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	5,550	178.150	988,732.500	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,100	256.000	793,600.000	
	AKER BP ASA	2,900	244.400	708,760.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 23,624,959.350 (281,137,016)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	27,720	66.990	1,856,962.800	

EVONIK INDUSTRIES AG	5,300	23.480	124,444.000	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	59,350	7.114	422,215.900	
COMMERZBANK AG	28,135	5.490	154,461.150	
VOLKSWAGEN AG	890	153.250	136,392.500	
VOLKSWAGEN AG-PREF	5,520	150.400	830,208.000	
SIEMENS AG-REG	22,700	92.550	2,100,885.000	
E.ON SE	64,200	8.513	546,534.600	
UNIPER SE	5,950	28.880	171,836.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,850	62.320	613,852.000	
GEA GROUP AG	4,500	24.950	112,275.000	
CONTINENTAL AG	3,170	117.460	372,348.200	
BASF SE	27,570	61.460	1,694,452.200	
ALLIANZ SE-REG	12,590	204.300	2,572,137.000	
THYSSENKRUPP AG	11,450	12.225	139,976.250	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,200	93.320	485,264.000	
RWE AG	16,250	26.780	435,175.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,650	14.135	93,997.750	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	77.300	91,214.000	
BRENTAG AG	4,700	45.470	213,709.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	12,200	44.650	544,730.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	32.800	108,896.000	
HOCHTIEF AG	710	100.200	71,142.000	
SAP SE	29,292	111.300	3,260,199.600	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,390	223.200	979,848.000	
ZALANDO SE	3,550	46.930	166,601.500	
HEIDELBERGCEMENT AG	4,500	64.460	290,070.000	
KION GROUP AG	1,850	46.090	85,266.500	
WIRECARD AG	3,470	157.300	545,831.000	
COVESTRO AG	5,200	41.420	215,384.000	
INNOGY SE	4,130	45.000	185,850.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,050	177.300	186,165.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	4,650	59.940	278,721.000	
DELIVERY HERO SE	3,200	46.390	148,448.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	108.700	135,875.000	
METRO AG	5,000	14.230	71,150.000	
1&1 DRILLISCH AG	1,550	28.560	44,268.000	
AROUNDTOWN SA	27,100	7.100	192,410.000	

SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,500	35.915	161,617.500	
KNORR-BREMSE AG	1,450	85.840	124,468.000	
BEIERSDORF AG	3,090	114.000	352,260.000	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,950	32.820	63,999.000	
MERCK KGAA	3,750	98.000	367,500.000	
ADIDAS AG	5,320	278.900	1,483,748.000	
PUMA SE	2,360	69.600	164,256.000	
HENKEL AG & CO KGAA	3,100	85.250	264,275.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	99,250	15.092	1,497,881.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,270	62.240	390,244.800	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	27,400	45.405	1,244,097.000	
QIAGEN N.V.	6,498	30.900	200,788.200	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	38,150	16.928	645,803.200	
HANNOVER RUECK SE	1,730	149.300	258,289.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	29,200	30.485	890,162.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,640	137.400	774,936.000	
LANXESS AG	2,500	56.740	141,850.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,530	249.500	381,735.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	10,600	31.760	336,656.000	
SYMRISE AG	3,920	86.480	339,001.600	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	26,300	2.352	61,857.600	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,550	50.900	78,895.000	
HUGO BOSS AG -ORD	1,760	51.240	90,182.400	
RTL GROUP	1,000	42.780	42,780.000	
VONOVIA SE	15,300	43.300	662,490.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	27,926	43.055	1,202,353.930	
NN GROUP NV	9,050	30.990	280,459.500	
ARCELORMITTAL	20,300	13.884	281,845.200	
HEINEKEN NV	7,600	98.020	744,952.000	
AEGON NV	53,644	3.578	191,938.230	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	34,533	21.775	751,956.070	
AKZO NOBEL N.V.	6,938	81.850	567,875.300	
KONINKLIJKE DSM NV	5,300	115.400	611,620.000	
WOLTERS KLUWER	8,300	66.560	552,448.000	
ING GROEP NV	117,550	9.083	1,067,706.650	

KONINKLIJKE KPN NV	100,950	2.817	284,376.150	
ASML HOLDING NV	12,560	217.300	2,729,288.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	11,700	16.605	194,278.500	
ADYEN NV	300	667.000	200,100.000	
UNILEVER NV	43,000	56.780	2,441,540.000	
VOPAK	1,900	43.850	83,315.000	
RANDSTAD NV	3,200	43.930	140,576.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,400	90.850	308,890.000	
JCDECAUX SA	1,900	24.220	46,018.000	
TOTAL SA	70,350	45.780	3,220,623.000	
MICHELIN (CGDE)	5,000	99.900	499,500.000	
AIR LIQUIDE SA	12,852	125.300	1,610,355.600	
KERING	2,280	453.750	1,034,550.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	16,550	77.160	1,276,998.000	
BOUYGUES SA	6,700	33.310	223,177.000	
BNP PARIBAS	33,750	42.450	1,432,687.500	
PEUGEOT SA	17,550	22.100	387,855.000	
NATIXIS	29,550	3.580	105,789.000	
THALES SA	3,230	109.700	354,331.000	
DANONE	18,500	81.720	1,511,820.000	
CARREFOUR SA	17,000	16.160	274,720.000	
SUEZ	9,925	14.095	139,892.870	
VIVENDI	26,891	25.300	680,342.300	
L'OREAL	7,420	251.200	1,863,904.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	14,550	33.490	487,279.500	
LEGRAND SA	8,017	65.540	525,434.180	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	41.020	63,581.000	
PERNOD RICARD SA	6,237	174.750	1,089,915.750	
SOCIETE BIC SA	700	58.100	40,670.000	
EURAZEO SE	1,254	62.100	77,873.400	
SOCIETE GENERALE SA	23,250	24.150	561,487.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	8,280	379.900	3,145,572.000	
ACCOR SA	5,350	39.970	213,839.500	
CAPGEMINI SE	4,770	113.600	541,872.000	
VALEO SA	7,150	28.750	205,562.500	
PUBLICIS GROUPE	6,400	43.750	280,000.000	
BUREAU VERITAS SA	8,800	22.130	194,744.000	
EIFFAGE	2,340	93.000	217,620.000	



SODEXO SA	2,700	101.300	273,510.000	
IPSEN	1,150	88.250	101,487.500	
INGENICO GROUP	1,800	90.600	163,080.000	
AMUNDI SA	1,700	59.450	101,065.000	
TELEPERFORMANCE	1,770	199.600	353,292.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,450	72.040	176,498.000	
FAURECIA	2,250	44.450	100,012.500	
EUROFINS SCIENTIFIC	320	420.400	134,528.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	800	136.200	108,960.000	
SEB SA	650	144.000	93,600.000	
ESSILORLUXOTTICA	8,300	135.200	1,122,160.000	
DASSAULT AVIATION SA	80	1,378.000	110,240.000	
WORLDLINE SA	2,364	63.150	149,286.600	
AXA SA	58,350	21.560	1,258,026.000	
EDENRED	6,900	44.110	304,359.000	
RENAULT SA	5,800	55.210	320,218.000	
HERMES INTERNATIONAL	950	655.200	622,440.000	
STMICROELECTRONICS NV	19,950	17.420	347,529.000	
REMY COINTREAU	630	138.100	87,003.000	
ATOS SE	2,960	69.740	206,430.400	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,980	129.400	515,012.000	
WENDEL	780	125.700	98,046.000	
ORANGE	58,300	13.690	798,127.000	
ALSTOM	4,450	39.510	175,819.500	
CNP ASSURANCES	4,850	16.980	82,353.000	
SANOFI	33,275	81.590	2,714,907.250	
VINCI SA	15,300	99.860	1,527,858.000	
AIRBUS SE	17,450	126.600	2,209,170.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	16,450	22.270	366,341.500	
CREDIT AGRICOLE SA	34,300	10.715	367,524.500	
BIOMERIEUX	1,150	70.200	80,730.000	
ENGIE	54,623	13.655	745,877.060	
IMERYS SA	900	36.480	32,832.000	
EDF	17,050	10.995	187,464.750	
SES	11,000	13.950	153,450.000	
SAFRAN SA	9,620	142.950	1,375,179.000	
ILIAD SA	740	81.180	60,073.200	
ARKEMA	1,920	82.040	157,516.800	
ADP	910	161.500	146,965.000	

EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,700	16.690	78,443.000	
SCOR SE	4,950	36.610	181,219.500	
GETLINK SE	12,400	13.290	164,796.000	
BOLLORE	24,100	3.896	93,893.600	
UCB SA	3,550	68.180	242,039.000	
KBC GROUP NV	7,450	54.500	406,025.000	
COLRUYT SA	1,600	48.050	76,880.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,200	86.440	190,168.000	
SOLVAY SA	2,200	93.200	205,040.000	
UMICORE	5,800	31.690	183,802.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	22,700	84.500	1,918,150.000	
AGEAS	5,540	49.850	276,169.000	
PROXIMUS	4,100	25.750	105,575.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	43.600	63,220.000	
PRYSMIAN SPA	6,850	20.240	138,644.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	33,343	17.105	570,332.010	
MEDIOBANCA SPA	17,065	9.466	161,537.290	
TENARIS SA	13,300	9.990	132,867.000	
UNICREDIT SPA	60,656	10.632	644,894.590	
TELECOM ITALIA SPA	313,982	0.496	155,923.460	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.477	82,054.540	
INTESA SANPAOLO	450,237	2.067	930,639.870	
ATLANTIA SPA	14,657	24.640	361,148.480	
POSTE ITALIANE SPA	16,000	10.075	161,200.000	
MONCLER SPA	5,150	35.960	185,194.000	
RECORDATI SPA	3,050	39.960	121,878.000	
ENI SPA	75,100	13.770	1,034,127.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	16,200	8.655	140,211.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	5.132	56,452.000	
LEONARDO SPA	10,975	11.310	124,127.250	
ENEL SPA	238,934	6.620	1,581,743.080	
SNAM SPA	61,600	4.590	282,744.000	
TERNA SPA	42,800	5.706	244,216.800	
EXOR NV	3,230	64.520	208,399.600	
CNH INDUSTRIAL NV	29,800	9.530	283,994.000	
FINECOBANK SPA	18,000	9.750	175,500.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	32,350	12.604	407,739.400	
FERRARI NV	3,645	148.500	541,282.500	

TELEFONICA SA	137,027	6.582	901,911.710	
ENDESA SA	9,250	23.600	218,300.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	202,012	4.490	907,033.880	
IBERDROLA SA	180,534	9.428	1,702,074.550	
BANCO DE SABADELL SA	160,109	0.799	127,927.090	
BANKINTER SA	18,300	5.502	100,686.600	
REPSOL SA	44,400	13.615	604,506.000	
GRIFOLS SA	8,500	28.010	238,085.000	
BANCO SANTANDER SA	477,250	3.531	1,685,169.750	
AMADEUS IT GROUP SA	12,900	68.520	883,908.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	23.190	217,986.000	
MAPFRE SA	30,650	2.464	75,521.600	
CAIXABANK SA	109,300	2.137	233,574.100	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	34.900	274,872.400	
AENA SME SA	2,000	167.200	334,400.000	
CELLNEX TELECOM SA	5,800	37.890	219,762.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	32,300	28.650	925,395.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	6,650	12.405	82,493.250	
ENAGAS SA	6,900	19.545	134,860.500	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	12,550	18.170	228,033.500	
FERROVIAL SA	14,200	26.430	375,306.000	
BANKIA SA	30,105	1.680	50,591.450	
UPM-KYMMENE OYJ	15,600	25.250	393,900.000	
NOKIA OYJ	166,000	4.535	752,810.000	
WARTSILA OYJ ABP	12,000	11.120	133,440.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	17,050	10.800	184,140.000	
METSO OYJ	2,800	35.800	100,240.000	
ELISA OYJ	4,150	46.240	191,896.000	
SAMPO OYJ-A SHS	13,600	36.890	501,704.000	
FORTUM OYJ	13,850	20.600	285,310.000	
KONE OYJ-B	9,900	55.440	548,856.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,650	25.600	93,440.000	
NESTE OYJ	12,950	28.670	371,276.500	
ORION OYJ-CLASS B	2,750	33.630	92,482.500	
VERBUND AG	2,000	53.100	106,200.000	
OMV AG	4,450	46.510	206,969.500	

	ERSTE GROUP BANK AG	9,500	29.820	283,290.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	21.280	60,648.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	20.280	68,952.000	
	ANDRITZ AG	2,100	34.200	71,820.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,800	29.020	197,336.000	
	AIB GROUP PLC	23,000	2.414	55,522.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	27,460	3.848	105,666.080	
	KINGSPAN GROUP PLC	4,400	43.000	189,200.000	
	JERONIMO MARTINS	6,000	15.865	95,190.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	74,700	3.545	264,811.500	
	GALP ENERGIA SGPS SA	13,950	13.000	181,350.000	
	KERRY GROUP PLC-A	4,570	109.000	498,130.000	
	CRH PLC	24,000	30.500	732,000.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,200	78.020	171,644.000	
ユーロ 小計				ユーロ 114,944,365.370 (13,539,296,797)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	40,500	52.300	2,118,150.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	53.000	3,445,000.000	
	MTR CORP	45,500	46.550	2,118,025.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	48,000	115.100	5,524,800.000	
	SINO LAND CO	90,000	11.720	1,054,800.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	82,169	70.450	5,788,806.050	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	17.300	553,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	15,500	76.950	1,192,725.000	
	CLP HOLDINGS LTD	50,000	81.000	4,050,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	43,507	37.800	1,644,564.600	
	HONG KONG & CHINA GAS	304,199	15.460	4,702,916.540	
	HANG SENG BANK LTD	22,500	168.600	3,793,500.000	
	WHEELOCK & CO LTD	24,000	47.550	1,141,200.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	183,000	10.240	1,873,920.000	
	WH GROUP LTD	295,000	6.970	2,056,150.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	36,100	249.400	9,003,340.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	18.280	1,041,960.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	9,300	99.000	920,700.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	19,000	21.900	416,100.000	

NWS HOLDINGS LTD	42,500	13.680	581,400.000	
KERRY PROPERTIES LTD	17,500	25.650	448,875.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	36,640	19.760	724,006.400	
HYSAN DEVELOPMENT CO	17,000	32.100	545,700.000	
SJM HOLDINGS LTD	58,000	7.830	454,140.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	32,600	26.400	860,640.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	78,669	55.850	4,393,663.650	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20,000	52.900	1,058,000.000	
PCCW LTD	117,000	4.340	507,780.000	
AIA GROUP LTD	357,000	79.700	28,452,900.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	36,000	44.900	1,616,400.000	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	22,000	37.850	832,700.000	
SANDS CHINA LTD	72,000	37.150	2,674,800.000	
SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	8.220	246,600.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	41,000	57.900	2,373,900.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	23,600	12.600	297,360.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	114,000	27.100	3,089,400.000	
WYNN MACAU LTD	42,000	16.760	703,920.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 102,302,442.240 (1,395,405,312)	
合計			115,283,567,339 [115,283,567,339]	

## (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	4,067	877,455.250	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	8,887	1,344,158.750	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,550	592,273.500	
		VORNADO REALTY TRUST	5,097	319,836.750	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,350	878,973.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	10,700	929,295.000	
		EQUINIX INC	2,488	1,378,575.920	
		AMERICAN TOWER CORP	12,850	2,988,781.500	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	21,943	365,570.380	
		KIMCO REALTY CORP	12,600	243,810.000	

	INVITATION HOMES INC	12,700	365,506.000	
	VENTAS INC	10,500	789,915.000	
	WEYERHAEUSER CO	21,164	565,290.440	
	AGNC INVESTMENT CORP	15,300	230,418.000	
	CROWN CASTLE INTL CORP	12,150	1,779,246.000	
	IRON MOUNTAIN INC	8,210	271,340.500	
	VEREIT INC	29,300	283,038.000	
	SUN COMMUNITIES INC	2,750	411,152.500	
	PROLOGIS INC	18,712	1,586,590.480	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,370	515,980.700	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,900	321,755.000	
	DUKE REALTY CORP	10,200	339,864.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,950	637,767.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,200	295,306.000	
	WELLTOWER INC	12,050	1,101,249.500	
	HCP INC	14,350	510,573.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	4,400	222,156.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,250	418,665.000	
	MACERICH CO/THE	2,900	87,580.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,400	324,576.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	43,700	363,147.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,550	254,345.000	
	REALTY INCOME CORP	9,400	713,930.000	
	PUBLIC STORAGE	4,670	1,202,525.000	
	REGENCY CENTERS CORP	4,950	331,254.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,400	194,160.000	
	UDR INC	8,100	396,333.000	
	WP CAREY INC	5,100	460,938.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	6,050	778,151.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,750	449,025.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 26,120,507.170 (2,793,588,242)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,662	168,053.790	
	SEGRO PLC	33,150	261,818.700	
	BRITISH LAND CO PLC	25,550	132,400.100	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 562,272.590	

			(73,837,637)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	17,000	287,470.000	
	TRANSURBAN GROUP	81,000	1,207,710.000	
	SYDNEY AIRPORT	33,300	274,392.000	
	APA GROUP	35,800	390,936.000	
	SCENTRE GROUP	153,922	612,609.560	
	DEXUS	33,150	418,684.500	
	GPT GROUP	56,160	352,684.800	
	MIRVAC GROUP	111,600	342,612.000	
	STOCKLAND	72,000	318,960.000	
	GOODMAN GROUP	50,100	685,368.000	
	VICINITY CENTRES	99,273	257,117.070	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 5,148,543.930 (376,615,988)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,100	67,158.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,700	83,731.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	121,918.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 272,807.000 (22,146,473)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	79,600	172,732.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	76,000	238,640.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	77,200	206,124.000	
	SUNTEC REIT	63,000	122,220.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 739,716.000 (57,246,621)	
ユーロ			ユーロ	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,200	503,790.000	
	ICADE	950	76,142.500	
	GECINA SA	1,400	196,280.000	
	KLEPIERRE	6,250	174,312.500	
	COVIVIO	1,270	122,237.500	
ユーロ 小計			ユーロ	

			1,072,762.500	
			(126,360,695)	
香港・ドル			香港・ドル	
	LINK REIT	62,500	5,584,375.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	75,000	566,250.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	107,000	1,369,600.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル	
			7,520,225.000	
			(102,575,869)	
投資証券 合計			3,552,371,525	
			[3,552,371,525]	
合計			3,552,371,525	
			[3,552,371,525]	

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 610銘柄 投資証券 40銘柄	96.6%	3.4%	68.9%
イギリス・ポンド	株式 94銘柄 投資証券 3銘柄	98.9%	1.1%	5.9%
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 投資証券 11銘柄	87.8%	12.2%	2.6%
カナダ・ドル	株式 87銘柄 投資証券 3銘柄	99.5%	0.5%	3.8%
シンガポール・ドル	株式 21銘柄 投資証券 4銘柄	89.7%	10.3%	0.5%
スイス・フラン	株式 39銘柄	100%	-%	3.5%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	100%	-%	0.9%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	100%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 238銘柄 投資証券 5銘柄	99.1%	0.9%	11.5%



香港・ドル	株式	37銘柄	93.2%	6.8%	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。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	68,262,420	60,092,275
金銭信託	983,417	3,297,002
コール・ローン	39,719,226	66,890,215
株式	4,975,961,569	7,236,096,701
投資証券	450,313,402	207,899,214
派生商品評価勘定	331,071	3,709,707
未収入金	438,074	27,360
未収配当金	15,618,459	14,572,223
差入委託証拠金	25,976,790	19,426,434
流動資産合計	5,577,604,428	7,612,011,131
資産合計	5,577,604,428	7,612,011,131
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,752,334	25
未払金	40,811,781	43,813,817
未払解約金	4,820,000	420,000
その他未払費用	69,768	43,154
流動負債合計	47,453,883	44,276,996
負債合計	47,453,883	44,276,996
純資産の部		
元本等		

元本	1	3,687,560,092	5,076,199,923
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,842,590,453	2,491,534,212
元本等合計		5,530,150,545	7,567,734,135
純資産合計		5,530,150,545	7,567,734,135
負債純資産合計		5,577,604,428	7,612,011,131

## 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9月8日 至 2019年9月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <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	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1. 1 期首	2017年9月8日	2018年9月8日
期首元本額	2,419,936,327円	3,687,560,092円
期中追加設定元本額	1,573,745,055円	1,684,523,074円
期中一部解約元本額	306,121,290円	295,883,243円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興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	10,054,295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)	215,019,194円	233,719,694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)	203,771,119円	231,269,037円
D-I's 新興国株式イン デックス	80,737,476円	109,213,035円
iFree 新興国株式イン デックス	1,152,779,835円	1,780,582,027円
iFree 8資産バランス	755,702,065円	1,317,325,324円
DCダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデックス ファンド	862,179,482円	945,942,382円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国株式	354,139,398円	380,133,311円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	63,231,523円	67,960,818円
計	3,687,560,092円	5,076,199,923円
2. 期末日における受益権の総数	3,687,560,092口	5,076,199,923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 2018年9月8日 至 2019年9月9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	2019年9月9日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2018年9月7日現在	2019年9月9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	24,487,656	267,979,995
投資証券	2,895,917	3,754,859
合計	21,591,739	264,225,136

(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(2018年7月6日から2018年9月7日まで、及び2019年7月6日から2019年9月9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	2018年9月7日 現在				2019年9月9日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数								
先物取引								
買 建	57,973,546	-	56,332,473	1,641,073	104,192,829	-	107,901,856	3,709,027
合計	57,973,546	-	56,332,473	1,641,073	104,192,829	-	107,901,856	3,709,027

(注) 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

### 2. 通貨関連

種 類	2018年9月7日 現在				2019年9月9日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち			(円)	うち		

		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	17,014,080	-	16,884,000	130,080	237,459	-	236,779	680
タイ・パーツ	-	-	-	-	237,459	-	236,779	680
香港・ドル	17,014,080	-	16,884,000	130,080	-	-	-	-
買 建	38,566,270	-	38,656,000	89,730	237,459	-	237,434	25
アメリカ・ドル	38,566,270	-	38,656,000	89,730	237,459	-	237,434	25
合計	55,580,350	-	55,540,000	219,810	474,918	-	474,213	655

(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)

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1口当たり純資産額	1.4997円	1.4908円
(1万口当たり純資産額)	(14,997円)	(14,908円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	16,400	5.290	86,756.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	4,100	176.690	724,429.000	
	BAIDU INC - SPON ADR	2,400	102.590	246,216.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	12,000	8.590	103,080.000	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	26,450	8.210	217,154.500	
	JD.COM INC-ADR	9,700	31.080	301,476.000	
	NETEASE INC-ADR	600	278.810	167,286.000	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	4,500	34.930	157,185.000	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	89,306	1.285	114,758.210	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	3,090	22.320	68,968.800	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,820	68.620	330,748.400	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	29,600	5.015	148,444.000	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	12,970	24.620	319,321.400	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	18,700	13.035	243,754.500	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	98,245	0.832	81,739.840	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	79,960	14.280	1,141,828.800	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,100	199.300	219,230.000	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	18,690	83.940	1,568,838.600	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	58,280	6.420	374,157.600	
GAZPROM PJSC-SPON ADR	226,870	7.066	1,603,063.420		
SEVERSTAL - GDR REG S	8,600	15.070	129,602.000		
TATNEFT PJSC - PREF	4,540	10.211	46,359.360		
ALROSA PJSC	79,160	1.149	90,966.950		
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	66,009	1.456	96,115.830		
AEROFLOT PJSC	58,060	1.592	92,452.130		
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 8,673,932.340 (927,677,063)	
インド・ルピー		株	インド・ルピー	インド・ルピー	
	TATA STEEL LTD	12,150	355.400	4,318,110.000	



AXIS BANK LTD	22,180	671.100	14,884,998.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,180	6,186.950	7,300,601.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	2,490	1,819.150	4,529,683.500	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	55,190	261.900	14,454,261.000	
STATE BANK OF INDIA	63,460	273.950	17,384,867.000	
NTPC LTD	81,800	127.000	10,388,600.000	
POWER FINANCE CORPORATION	30,580	108.500	3,317,930.000	
JSW STEEL LTD	30,560	217.950	6,660,552.000	
INDIAN OIL CORP LTD	130,490	126.950	16,565,705.500	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	53,235	379.000	20,176,065.000	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	23,790	37.700	896,883.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,050	994.900	3,034,445.000	
TECH MAHINDRA LTD	4,220	721.750	3,045,785.000	
YES BANK LTD	23,520	60.400	1,420,608.000	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	31,820	55.000	1,750,100.000	
REC LTD	45,870	150.650	6,910,315.500	
COAL INDIA LTD	47,000	198.600	9,334,200.000	
BHARTI INFRATEL LTD	11,440	250.350	2,864,004.000	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	7,900	425.700	3,363,030.000	
GAIL INDIA LTD	20,906	131.350	2,746,003.100	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	47,810	188.400	9,007,404.000	
GRASIM INDUSTRIES LTD	10,680	703.700	7,515,516.000	
WIPRO LTD	13,653	252.000	3,440,556.000	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	7,286	2,197.500	16,010,985.000	
INFOSYS LTD	43,360	840.150	36,428,904.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	5,572	1,328.650	7,403,237.800	
TATA MOTORS LTD	106,680	121.250	12,934,950.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	15,170	2,041.450	30,968,796.500	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	38,570	1,222.500	47,151,825.000	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	89,035	127.950	11,392,028.250	
ITC LTD	31,100	243.900	7,585,290.000	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	13,490	529.500	7,142,955.000	
HERO MOTOCORP LTD	2,240	2,659.950	5,958,288.000	
BHARTI AIRTEL LTD	38,622	349.250	13,488,733.500	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	15,240	425.100	6,478,524.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	7,570	1,100.400	8,330,028.000	
VEDANTA LTD	103,570	141.800	14,686,226.000	
インド・ルピー 小計			インド・ルピー	

				401,270,993.650 (601,906,490)	
インドネシア・ルピア		株	インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
	UNITED TRACTORS TBK PT	28,400	21,575.000	612,730,000.000	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	389,100	6,750.000	2,626,425,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	47,000	13,450.000	632,150,000.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	77,000	7,975.000	614,075,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	972,700	4,210.000	4,095,067,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	172,700	7,600.000	1,312,520,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	66,100	30,125.000	1,991,262,500.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	365,300	7,050.000	2,575,365,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	301,500	1,945.000	586,417,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	807,600	4,270.000	3,448,452,000.000	
	ADARO ENERGY TBK PT	472,900	1,335.000	631,321,500.000	
インドネシア・ルピア 小計				インドネシア・ルピア 19,125,785,500.000 (145,355,969)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	47,700	0.980	46,746.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 46,746.000 (3,617,672)	
タイ・パーツ		株	タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	10,200	168.000	1,713,600.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	20,200	418.000	8,443,600.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	16,000	159.500	2,552,000.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	7,800	158.500	1,236,300.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	68,800	116.000	7,980,800.000	
	THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	30,200	55.750	1,683,650.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	24,800	235.000	5,828,000.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	224,800	17.300	3,889,040.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	123,300	12.700	1,565,910.000	

	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	38,400	124.000	4,761,600.000	
	IRPC PCL - NVDR	284,300	3.840	1,091,712.000	
	PTT PCL-NVDR	465,100	44.500	20,696,950.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	47,100	69.000	3,249,900.000	
	CP ALL PCL-NVDR	52,700	84.500	4,453,150.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	131,600	29.250	3,849,300.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	76,800	52.750	4,051,200.000	
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 77,046,712.000 (268,893,025)	
チリ・ペソ		株	チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	ENEL CHILE SA	487,797	60.880	29,697,081.360	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	9,970	6,285.000	62,661,450.000	
	CENCOSUD SA	57,850	1,109.500	64,184,575.000	
	BANCO SANTANDER CHILE	983,090	50.790	49,931,141.100	
	ENEL AMERICAS SA	700,793	119.200	83,534,525.600	
	EMPRESAS CMPC SA	16,880	1,661.600	28,047,808.000	
	S.A.C.I. FALABELLA	13,150	4,045.000	53,191,750.000	
	EMPRESAS COPEC SA	4,630	6,700.200	31,021,926.000	
	BANCO DE CHILE	396,692	103.480	41,049,688.160	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ 443,319,945.220 (66,542,323)	
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	114,760	9.160	1,051,201.600	
	AKBANK T.A.S.	149,272	7.140	1,065,802.080	
	TURKIYE IS BANKASI-C	127,100	5.830	740,993.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	55,810	12.970	723,855.700	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	5,580	128.500	717,030.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	50,791	6.570	333,696.870	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	80,390	8.680	697,785.200	
	TURKIYE HALK BANKASI	100,250	6.080	609,520.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI	107,560	2.440	262,446.400	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T- D	79,510	4.830	384,033.300	
	KOC HOLDING AS	44,675	18.020	805,043.500	
	TURK HAVA YOLLARI AO	48,920	11.650	569,918.000	

	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	6,880	47.940	329,827.200	
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 8,291,152.850 (155,624,938)	
ブラジル・リアル		株	ブラジル・リアル	ブラジル・リアル	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	1,200	56.790	68,148.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	1,700	101.220	172,074.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	6,300	52.800	332,640.000	
	CIA DE SANEAMENTO DO PA-UNIT	1,600	87.710	140,336.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	17,700	28.340	501,618.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	102,400	26.520	2,715,648.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	94,360	34.600	3,264,856.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	128,636	35.170	4,524,128.120	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	30,400	14.070	427,728.000	
	VALE SA	96,890	46.450	4,500,540.500	
	GERDAU SA-PREF	41,800	12.430	519,574.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	78,100	29.190	2,279,739.000	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	47,897	14.710	704,564.870	
	ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	46,141	12.950	597,525.950	
	BRASKEM SA-PREF A	5,000	28.600	143,000.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	46.240	221,952.000	
	BANCO DO BRASIL S.A.	45,300	49.390	2,237,367.000	
	COSAN SA	4,000	51.710	206,840.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	9,400	45.000	423,000.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	7,800	51.670	403,026.000	
	EMBRAER SA	28,200	18.010	507,882.000	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	85,500	6.120	523,260.000		
CCR SA	31,100	16.600	516,260.000		
BRF SA	29,400	37.380	1,098,972.000		
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	9,600	51.600	495,360.000		
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	7,700	27.750	213,675.000		

	TIM PARTICIPACOES SA	28,826	11.800	340,146.800	
	TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	14,100	54.650	770,565.000	
	LOJAS RENNER S.A.	5,005	49.970	250,099.850	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	8,500	18.750	159,375.000	
	JBS SA	59,600	30.060	1,791,576.000	
	SUZANO SA	4,245	29.670	125,949.150	
	BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	7,000	22.910	160,370.000	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	7,900	19.710	155,709.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	18,900	45.900	867,510.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	14,108	13.580	191,586.640	
	CIELO SA	49,328	7.750	382,292.000	
	HYPERA SA	5,300	33.040	175,112.000	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	5,700	84.100	479,370.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,800	97.500	175,500.000	
	SUL AMERICA SA - UNITS	4,500	45.990	206,955.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER	3,200	16.980	54,336.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL- UNIT	10,700	44.000	470,800.000	
	KLABIN SA - UNIT	9,800	15.000	147,000.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	36,300	18.040	654,852.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	9,600	14.530	139,488.000	
	KROTON EDUCACIONAL SA	41,500	10.400	431,600.000	
	BANCO BRADESCO S.A.	24,465	31.300	765,754.500	
	AMBEV SA	78,600	18.720	1,471,392.000	
	ブラジル・リアル 小計			ブラジル・リアル 38,107,053.380 (1,003,358,716)	
マレーシア・リンギット		株	マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	MALAYAN BANKING BHD	77,600	8.750	679,000.000	
	GENTING BHD	63,300	5.870	371,571.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	41,500	20.200	838,300.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	54,200	7.000	379,400.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	67,500	3.170	213,975.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	95,500	5.030	480,365.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	54,200	13.820	749,044.000	
	PETRONAS GAS BHD	10,300	16.060	165,418.000	
	SAPURA ENERGY BHD	692,800	0.270	187,056.000	

マレーシア・リングット 小計				マレーシア・リングット	
				ト	
				4,064,129.000	
				(104,001,061)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	10,800	120.150	1,297,620.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	923,000	14.150	13,060,450.000	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	71,900	35.870	2,579,053.000	
	CEMEX SAB-CPO	879,319	7.470	6,568,512.930	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	37,100	182.770	6,780,767.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	29,623	38.090	1,128,340.070	
	ALFA S.A.B.-A	106,700	17.070	1,821,369.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	86,300	44.990	3,882,637.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	95,600	58.160	5,560,096.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	57,300	108.320	6,206,736.000	
メキシコ・ペソ 小計				メキシコ・ペソ	
				48,885,581.000	
				(267,892,983)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	119,000	9.310	1,107,890.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	206,000	5.250	1,081,500.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	12.360	296,640.000	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	16,000	20.250	324,000.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	64,000	12.760	816,640.000	
	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	41,000	6.290	257,890.000	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	20,000	43.150	863,000.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	60,000	9.230	553,800.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,557,800	4.640	7,228,192.000	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	15,500	37.800	585,900.000	
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	106,000	7.250	768,500.000	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	56,000	4.700	263,200.000	

CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	13,500	28.050	378,675.000	
FOSUN INTERNATIONAL LTD RIGHTS	40	163.280	6,531.200	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	82,500	10.400	858,000.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	15,200	343.400	5,219,680.000	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	558,000	3.560	1,986,480.000	
AIR CHINA LTD-H	42,000	7.160	300,720.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	260,000	7.990	2,077,400.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	50,500	23.000	1,161,500.000	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	192,000	4.710	904,320.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	80,000	10.340	827,200.000	
PETROCHINA CO LTD-H	828,000	3.990	3,303,720.000	
CNOOC LTD	480,000	12.000	5,760,000.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	64,000	4.560	291,840.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	236,000	4.290	1,012,440.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	21,500	47.200	1,014,800.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	84,000	4.560	383,040.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,719,000	6.030	22,425,570.000	
CHINA MOBILE LTD	157,500	66.100	10,410,750.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	43,600	18.640	812,704.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	408,000	4.210	1,717,680.000	
GF SECURITIES CO LTD-H	30,600	8.960	274,176.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	457,000	1.270	580,390.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	14,000	53.550	749,700.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	202,000	4.800	969,600.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	134,500	16.320	2,195,040.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	22,000	15.980	351,560.000	
SINOPHARM GROUP CO-H	35,200	26.950	948,640.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	64,000	33.350	2,134,400.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	19,000	21.700	412,300.000	
YANZHOU COAL MINING CO-H	58,000	8.190	475,020.000	
BYD CO LTD-H	8,000	41.300	330,400.000	

AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,199,000	3.080	3,692,920.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	21,000	33.300	699,300.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	249,000	3.230	804,270.000	
CITIC LTD	157,000	9.700	1,522,900.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	215,000	1.700	365,500.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	3,000,000	5.180	15,540,000.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	496,000	1.910	947,360.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	74,000	3.100	229,400.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	42,000	16.180	679,560.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	94,000	25.700	2,415,800.000	
CRRC CORP LTD - H	64,000	5.590	357,760.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	210,000	6.220	1,306,200.000	
CGN POWER CO LTD-H	185,000	2.050	379,250.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	77,000	93.800	7,222,600.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	27,000	32.900	888,300.000	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	68,000	4.630	314,840.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	312,080	5.360	1,672,748.800	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	149,000	10.360	1,543,640.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	8,000	63.750	510,000.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	32,700	28.100	918,870.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	92,000	2.350	216,200.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	38,000	7.830	297,540.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	4,000	112.400	449,600.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	248,000	9.330	2,313,840.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	142,000	5.310	754,020.000	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	59,000	12.840	757,560.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	188,000	2.470	464,360.000	



	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	58,400	32.950	1,924,280.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,400	15.080	367,952.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	152,000	19.020	2,891,040.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	10,000	80.000	800,000.000	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	38,000	6.660	253,080.000	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	98,000	6.900	676,200.000	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES -H	66,400	12.920	857,888.000	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	44,000	9.700	426,800.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	114,000	2.810	320,340.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	46,000	7.400	340,400.000	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	238,000	7.260	1,727,880.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	344,100	5.300	1,823,730.000	
	CHINA EVERGRANDE GROUP	49,000	17.220	843,780.000	
	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	72,000	9.670	696,240.000	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	465,000	0.320	148,800.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	91,500	38.450	3,518,175.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	3,621,000	3.090	11,188,890.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	30,500	15.680	478,240.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	114,000	3.400	387,600.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	96,800	8.690	841,192.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	67,000	4.290	287,430.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	36,500	29.050	1,060,325.000	
	香港・ドル 小計			香港・ドル 163,546,029.000 (2,230,767,835)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	16,000	88.000	1,408,000.000	
	TAIWAN CEMENT	126,232	39.850	5,030,345.200	
	ASIA CEMENT CORP	74,000	43.850	3,244,900.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	80,112	77.100	6,176,635.200	
	FORMOSA PLASTICS CORP	67,600	95.200	6,435,520.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	60,140	69.200	4,161,688.000	

FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	60,390	89.200	5,386,788.000	
WALSIN LIHWA CORP	93,000	14.250	1,325,250.000	
CHINA STEEL CORP	166,686	23.150	3,858,780.900	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	82,616	49.000	4,048,184.000	
DELTA ELECTRONICS INC	41,000	148.500	6,088,500.000	
ACER INC	93,000	17.700	1,646,100.000	
INVENTEC CORP	67,000	21.800	1,460,600.000	
TATUNG CO LTD	55,000	17.300	951,500.000	
QUANTA COMPUTER INC	74,000	56.400	4,173,600.000	
AU OPTRONICS CORP	378,000	8.160	3,084,480.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	80,400	110.000	8,844,000.000	
MEDIATEK INC	38,003	374.500	14,232,123.500	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	21,000	229.500	4,819,500.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	61,187	24.750	1,514,378.250	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	138,411	44.000	6,090,084.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	178,693	40.800	7,290,674.400	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	262,000	9.250	2,423,500.000	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	178,027	25.500	4,539,688.500	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	215,828	18.650	4,025,192.200	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	184,993	28.800	5,327,798.400	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	156,768	13.750	2,155,560.000	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	453,677	9.340	4,237,343.180	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	285,028	20.550	5,857,325.400	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	136,172	21.550	2,934,506.600	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,980.000	3,980,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	10,000	189.500	1,895,000.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	31,000	112.000	3,472,000.000	
WISTRON CORP	62,110	25.000	1,552,750.000	
INNOLUX CORP	336,000	7.160	2,405,760.000	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	23,000	73.000	1,679,000.000	
PEGATRON CORP	63,000	52.800	3,326,400.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	14,646	129.500	1,896,657.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	63,654	20.400	1,298,541.600	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	21,400	81.500	1,744,100.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	30,000	97.700	2,931,000.000	

	POU CHEN	37,440	39.700	1,486,368.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	312,000	263.500	82,212,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	262,902	75.000	19,717,650.000	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	11,000	296.000	3,256,000.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	14,760	207.000	3,055,320.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	104,000	29.300	3,047,200.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	531,000	13.550	7,195,050.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 278,923,342.330 (953,917,832)	
南アフリカ・ラ ンド		株	南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	GOLD FIELDS LTD	30,460	80.140	2,441,064.400	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	4,900	132.480	649,152.000	
	OLD MUTUAL LTD	91,530	18.360	1,680,490.800	
	VODACOM GROUP LTD	19,770	119.350	2,359,549.500	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,990	115.750	1,503,592.500	
	NEDBANK GROUP LTD	11,900	232.510	2,766,869.000	
	BIDVEST GROUP LTD	7,760	191.770	1,488,135.200	
	BID CORP LTD	6,450	321.750	2,075,287.500	
	NETCARE LTD	32,930	16.490	543,015.700	
	STANDARD BANK GROUP LTD	36,420	184.260	6,710,749.200	
	SASOL LTD	18,530	260.530	4,827,620.900	
	REMGRO LTD	9,930	176.660	1,754,233.800	
	EXXARO RESOURCES LTD	4,600	134.240	617,504.000	
	PICK N PAY STORES LTD	8,570	59.100	506,487.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	9,640	55.600	535,984.000	
	SANLAM LTD	38,490	74.960	2,885,210.400	
	TIGER BRANDS LTD	3,180	211.850	673,683.000	
	FIRSTRAND LTD	66,290	62.090	4,115,946.100	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	35,310	55.070	1,944,521.700	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	4,330	163.800	709,254.000	
	ABSA GROUP LTD	30,140	160.150	4,826,921.000	
	NASPERS LTD-N SHS	1,730	3,565.000	6,167,450.000	
	INVESTEC LTD	6,990	81.670	570,873.300	
	MTN GROUP LTD	65,880	103.130	6,794,204.400	

IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	19,330	86.970	1,681,130.100	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,030	82.580	580,537.400	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	7,080	318.900	2,257,812.000	
BARLOWORLD LTD	6,070	113.800	690,766.000	
SAPPI LIMITED	15,710	41.450	651,179.500	
TELKOM SA SOC LTD	15,630	81.960	1,281,034.800	
SPAR GROUP LIMITED/THE	6,930	182.000	1,261,260.000	
MR PRICE GROUP LTD	3,190	170.570	544,118.300	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	27,640	23.400	646,776.000	
SIBANYE GOLD LTD	76,230	18.570	1,415,591.100	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 70,158,004.600 (506,540,794)	
合計			7,236,096,701 [7,236,096,701]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	78,000	アメリカ・ドル 1,599,780.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 1,599,780.000 (171,096,471)	
	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	171,870	トルコ・リラ 209,681.400	
	トルコ・リラ 小計			トルコ・リラ 209,681.400 (3,935,720)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	88,400	メキシコ・ペソ 2,491,996.000	
	メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 2,491,996.000 (13,656,138)	
	南アフリカ・ランド	REDEFINE PROPERTIES LTD	105,000	南アフリカ・ランド 833,700.000	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	76,930	1,827,087.500	
	南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド	

			2,660,787,500	
			(19,210,885)	
投資証券	合計		207,899,214	
			[207,899,214]	
合計			207,899,214	
			[207,899,214]	

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 25銘柄 投資証券 1銘柄	84.4%	15.6%	14.8%
インド・ルピー	株式 38銘柄	100%	-%	8.1%
インドネシア・ルピア	株式 11銘柄	100%	-%	2.0%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	0.0%
タイ・バーツ	株式 16銘柄	100%	-%	3.6%
チリ・ペソ	株式 9銘柄	100%	-%	0.9%
トルコ・リラ	株式 13銘柄 投資証券 1銘柄	97.5%	2.5%	2.1%
ブラジル・レアル	株式 49銘柄	100%	-%	13.5%
マレーシア・リンギット	株式 9銘柄	100%	-%	1.4%
メキシコ・ペソ	株式 10銘柄 投資証券 1銘柄	95.1%	4.9%	3.8%
香港・ドル	株式 92銘柄	100%	-%	29.9%
台湾・ドル	株式 48銘柄	100%	-%	12.8%
南アフリカ・ランド	株式 34銘柄 投資証券 2銘柄	96.3%	3.7%	7.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,318,383	4,831,732
コール・ローン	93,637,195	98,027,094
国債証券	13,379,556,270	15,914,984,650
地方債証券	1,137,489,400	1,142,973,100
特殊債券	917,293,700	837,702,600
社債券	1,140,593,000	942,445,100
未収利息	48,440,021	51,637,826
前払費用	2,253,566	1,477,533
流動資産合計	16,721,581,535	18,994,079,635
資産合計	16,721,581,535	18,994,079,635
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,674,000	23,664,512
その他未払費用	573	-
流動負債合計	2,674,573	23,664,512
負債合計	2,674,573	23,664,512
純資産の部		
元本等		
元本	13,184,411,625	14,329,790,025
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,534,495,337	4,640,625,098
元本等合計	16,718,906,962	18,970,415,123
純資産合計	16,718,906,962	18,970,415,123
負債純資産合計	16,721,581,535	18,994,079,635

#### 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9月8日 至 2019年9月9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	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1. 1 期首	2017年9月8日	2018年9月8日
期首元本額	11,905,512,687円	13,184,411,625円
期中追加設定元本額	2,913,930,966円	2,344,325,780円
期中一部解約元本額	1,635,032,028円	1,198,947,380円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	73,808,571円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	60,154円	291,049円
iFree 日本債券イン デックス	108,814,789円	124,730,662円
iFree 8資産バランス	912,587,846円	1,420,958,920円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	5,789,219,449円	6,023,850,370円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,119,932,887円	3,316,782,480円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,016,072,296円	1,004,425,513円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	682,372,511円	813,657,901円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	553,959,532円	634,676,503円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	175,340,920円	207,511,133円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	58,783,007円	51,154,325円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	49,481,303円	54,486,367円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	4,941,559円	6,169,702円
ダイワつみたてインデックス日本債券	787,607円	98,049,539円
ダイワつみたてインデックスバランス30	-円	419,453円
ダイワつみたてインデックスバランス50	-円	305,057円
ダイワつみたてインデックスバランス70	-円	155,916円
ダイワ世界バランスファンド40VA	455,354,017円	307,394,817円
ダイワ世界バランスファンド60VA	215,516,417円	188,704,674円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	19,618,786円	-円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	21,568,545円	2,257,073円
計	13,184,411,625円	14,329,790,025円
2. 期末日における受益権の総数	13,184,411,625口	14,329,790,025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 2018年9月8日 至 2019年9月9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	2019年9月9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	2018年9月7日現在	2019年9月9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	104,140,710	581,998,540
地方債証券	6,723,800	4,540,300
特殊債券	3,595,200	1,193,800
社債券	8,673,400	2,705,300
合計	123,133,110	590,437,940

(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(2017年12月1日から2018年9月7日まで、及び2018年12月1日から2019年9月9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

2018年9月7日現在	2019年9月9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)

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2681円 (12,681円)	1.3238円 (13,238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 9 5 2年国債	20,000,000	20,095,800	
	3 9 8 2年国債	100,000,000	100,598,000	
	4 0 1 2年国債	50,000,000	50,355,000	
	4 0 3 2年国債	160,000,000	161,262,400	
	1 2 6 5年国債	233,000,000	234,162,670	
	1 2 7 5年国債	140,000,000	140,866,600	
	1 2 8 5年国債	187,000,000	188,366,970	
	1 2 9 5年国債	182,000,000	183,559,740	
	1 3 0 5年国債	197,000,000	198,918,780	
	1 3 1 5年国債	190,000,000	192,053,900	
	1 3 2 5年国債	90,000,000	91,071,000	
	1 3 3 5年国債	200,000,000	202,690,000	
	1 3 4 5年国債	60,000,000	60,874,200	
	1 3 5 5年国債	200,000,000	203,210,000	
	1 3 6 5年国債	100,000,000	101,741,000	
	1 3 7 5年国債	130,000,000	132,389,400	
	1 3 8 5年国債	150,000,000	152,929,500	

1 3 9	5年国債	150,000,000	153,102,000	
1 4 0	5年国債	40,000,000	40,874,000	
1	40年国債	30,000,000	48,134,100	
2	40年国債	23,000,000	35,973,840	
3	40年国債	19,000,000	30,061,230	
4	40年国債	30,000,000	48,005,700	
5	40年国債	35,000,000	54,404,350	
6	40年国債	28,000,000	43,022,000	
7	40年国債	31,000,000	46,016,400	
8	40年国債	23,000,000	32,100,640	
9	40年国債	40,000,000	42,219,600	
1 0	40年国債	91,000,000	112,253,960	
1 1	40年国債	85,000,000	102,145,350	
1 2	40年国債	29,000,000	31,664,520	
3 1 2	10年国債	94,000,000	95,794,460	
3 1 3	10年国債	34,000,000	34,835,040	
3 1 4	10年国債	77,000,000	78,655,500	
3 1 5	10年国債	90,000,000	92,417,400	
3 1 6	10年国債	56,000,000	57,403,920	
3 1 7	10年国債	40,000,000	41,154,800	
3 1 8	10年国債	33,000,000	33,885,390	
3 1 9	10年国債	140,000,000	144,558,400	
3 2 0	10年国債	35,000,000	36,059,450	
3 2 1	10年国債	65,000,000	67,182,050	
3 2 2	10年国債	140,000,000	144,344,200	
3 2 3	10年国債	70,000,000	72,391,200	
3 2 4	10年国債	80,000,000	82,508,800	
3 2 5	10年国債	160,000,000	165,553,600	
3 2 6	10年国債	20,000,000	20,685,800	
3 2 7	10年国債	90,000,000	93,384,000	
3 2 8	10年国債	60,000,000	62,022,000	
3 2 9	10年国債	160,000,000	167,006,400	
3 3 0	10年国債	81,000,000	84,787,560	
3 3 1	10年国債	130,000,000	135,016,700	
3 3 2	10年国債	65,000,000	67,666,300	
3 3 3	10年国債	83,000,000	86,603,860	
3 3 4	10年国債	220,000,000	230,148,600	
3 3 5	10年国債	160,000,000	167,001,600	
3 3 7	10年国債	50,000,000	51,775,000	

338	10年国債	70,000,000	73,018,400
339	10年国債	25,000,000	26,128,250
340	10年国債	103,000,000	107,855,420
341	10年国債	15,000,000	15,645,750
343	10年国債	192,000,000	198,201,600
344	10年国債	38,000,000	39,274,140
345	10年国債	280,000,000	289,839,200
346	10年国債	200,000,000	207,194,000
347	10年国債	180,000,000	186,697,800
348	10年国債	170,000,000	176,463,400
349	10年国債	170,000,000	176,519,500
350	10年国債	185,000,000	192,059,600
351	10年国債	130,000,000	134,929,600
352	10年国債	160,000,000	166,014,400
353	10年国債	130,000,000	134,832,100
354	10年国債	60,000,000	62,200,200
355	10年国債	30,000,000	31,083,000
2	30年国債	9,000,000	11,508,930
3	30年国債	4,000,000	5,092,360
4	30年国債	8,000,000	10,808,800
5	30年国債	8,000,000	10,249,200
6	30年国債	9,000,000	11,836,080
7	30年国債	12,000,000	15,752,400
10	30年国債	15,000,000	17,455,500
11	30年国債	9,000,000	11,239,200
12	30年国債	11,000,000	14,391,630
13	30年国債	11,000,000	14,283,610
14	30年国債	22,000,000	29,907,020
15	30年国債	21,000,000	28,970,970
16	30年国債	26,000,000	35,984,000
17	30年国債	17,000,000	23,357,660
18	30年国債	20,000,000	27,246,400
19	30年国債	15,000,000	20,507,100
20	30年国債	16,000,000	22,446,880
21	30年国債	16,000,000	22,007,680
22	30年国債	17,000,000	24,002,470
23	30年国債	16,000,000	22,672,000
24	30年国債	15,000,000	21,330,750
25	30年国債	17,000,000	23,652,950

26	30年国債	32,000,000	45,180,480	
27	30年国債	32,000,000	46,007,040	
28	30年国債	34,000,000	49,198,000	
29	30年国債	43,000,000	61,812,930	
30	30年国債	56,000,000	79,821,280	
31	30年国債	55,000,000	77,753,500	
32	30年国債	59,000,000	85,103,370	
33	30年国債	65,000,000	90,247,950	
34	30年国債	70,000,000	100,654,400	
35	30年国債	68,000,000	95,331,920	
36	30年国債	64,000,000	90,188,800	
37	30年国債	67,000,000	93,409,390	
38	30年国債	39,000,000	53,743,170	
39	30年国債	37,000,000	51,983,520	
40	30年国債	44,000,000	60,907,440	
41	30年国債	34,000,000	46,344,040	
42	30年国債	33,000,000	45,098,460	
43	30年国債	37,000,000	50,638,940	
44	30年国債	42,000,000	57,633,660	
45	30年国債	43,000,000	56,998,220	
46	30年国債	55,000,000	73,072,450	
47	30年国債	44,000,000	59,684,240	
48	30年国債	50,000,000	65,410,000	
49	30年国債	68,000,000	89,150,040	
50	30年国債	44,000,000	50,905,800	
51	30年国債	45,000,000	46,260,900	
52	30年国債	57,000,000	61,542,330	
53	30年国債	55,000,000	60,847,600	
54	30年国債	45,000,000	52,179,300	
55	30年国債	46,000,000	53,402,780	
56	30年国債	50,000,000	58,038,500	
57	30年国債	50,000,000	58,028,500	
58	30年国債	55,000,000	63,904,500	
59	30年国債	45,000,000	51,052,500	
60	30年国債	37,000,000	44,044,800	
61	30年国債	50,000,000	56,757,000	
62	30年国債	46,000,000	49,639,060	
63	30年国債	50,000,000	52,515,000	
48	20年国債	9,000,000	9,322,380	

4 9	2 0 年国債	4,000,000	4,147,720	
5 0	2 0 年国債	30,000,000	31,015,800	
5 1	2 0 年国債	25,000,000	26,030,000	
5 2	2 0 年国債	19,000,000	19,937,460	
5 3	2 0 年国債	13,000,000	13,721,500	
5 4	2 0 年国債	14,000,000	14,809,060	
5 5	2 0 年国債	41,000,000	43,422,280	
5 6	2 0 年国債	12,000,000	12,779,520	
5 7	2 0 年国債	24,000,000	25,491,840	
5 8	2 0 年国債	35,000,000	37,392,250	
5 9	2 0 年国債	3,000,000	3,202,260	
6 1	2 0 年国債	40,000,000	41,918,800	
6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,700,640	
6 3	2 0 年国債	30,000,000	32,455,200	
6 4	2 0 年国債	35,000,000	38,201,100	
6 5	2 0 年国債	42,000,000	46,082,820	
6 6	2 0 年国債	30,000,000	32,786,100	
6 7	2 0 年国債	19,000,000	20,955,100	
6 8	2 0 年国債	25,000,000	27,917,000	
6 9	2 0 年国債	12,000,000	13,345,080	
7 0	2 0 年国債	18,000,000	20,398,860	
7 1	2 0 年国債	17,000,000	19,100,520	
7 2	2 0 年国債	53,000,000	59,629,240	
7 5	2 0 年国債	14,000,000	15,931,720	
7 6	2 0 年国債	25,000,000	28,168,000	
7 8	2 0 年国債	17,000,000	19,260,150	
7 9	2 0 年国債	14,000,000	15,943,900	
8 1	2 0 年国債	65,000,000	74,404,850	
8 2	2 0 年国債	28,000,000	32,223,800	
8 5	2 0 年国債	31,000,000	36,070,050	
8 6	2 0 年国債	6,000,000	7,061,400	
8 8	2 0 年国債	33,000,000	39,068,700	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	17,654,400	
9 2	2 0 年国債	45,000,000	53,231,850	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	21,260,160	
9 4	2 0 年国債	45,000,000	53,497,800	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	36,325,200	
9 6	2 0 年国債	23,000,000	27,481,780	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	30,227,750	

9 8	2 0 年国債	34,000,000	40,829,240	
9 9	2 0 年国債	53,000,000	63,931,250	
1 0 0	2 0 年国債	35,000,000	42,690,900	
1 0 1	2 0 年国債	18,000,000	22,270,320	
1 0 2	2 0 年国債	10,000,000	12,427,800	
1 0 3	2 0 年国債	21,000,000	25,909,170	
1 0 4	2 0 年国債	64,000,000	77,808,000	
1 0 5	2 0 年国債	38,000,000	46,375,960	
1 0 6	2 0 年国債	16,000,000	19,674,880	
1 0 7	2 0 年国債	20,000,000	24,510,000	
1 0 8	2 0 年国債	68,000,000	82,039,960	
1 0 9	2 0 年国債	60,000,000	72,619,800	
1 1 0	2 0 年国債	27,000,000	33,205,950	
1 1 1	2 0 年国債	35,000,000	43,548,400	
1 1 2	2 0 年国債	40,000,000	49,369,200	
1 1 3	2 0 年国債	100,000,000	123,915,000	
1 1 4	2 0 年国債	45,000,000	55,976,850	
1 1 5	2 0 年国債	42,000,000	52,686,480	
1 1 6	2 0 年国債	27,000,000	34,002,180	
1 1 7	2 0 年国債	47,000,000	58,683,260	
1 1 8	2 0 年国債	13,000,000	16,149,510	
1 1 9	2 0 年国債	23,000,000	28,065,750	
1 2 0	2 0 年国債	50,000,000	59,911,000	
1 2 3	2 0 年国債	42,000,000	53,022,060	
1 2 4	2 0 年国債	45,000,000	56,291,400	
1 2 5	2 0 年国債	25,000,000	31,963,750	
1 2 6	2 0 年国債	21,000,000	26,356,050	
1 2 7	2 0 年国債	23,000,000	28,595,670	
1 2 8	2 0 年国債	32,000,000	39,911,360	
1 2 9	2 0 年国債	45,000,000	55,584,900	
1 3 0	2 0 年国債	28,000,000	34,687,520	
1 3 1	2 0 年国債	70,000,000	85,861,300	
1 3 2	2 0 年国債	25,000,000	30,765,250	
1 3 3	2 0 年国債	57,000,000	70,856,700	
1 3 4	2 0 年国債	15,000,000	18,697,350	
1 3 5	2 0 年国債	20,000,000	24,675,000	
1 3 6	2 0 年国債	65,000,000	79,365,650	
1 3 7	2 0 年国債	18,000,000	22,264,740	
1 3 9	2 0 年国債	62,000,000	75,884,900	

141	20年国債	48,000,000	59,665,440		
142	20年国債	45,000,000	56,542,050		
143	20年国債	48,000,000	59,145,600		
144	20年国債	34,000,000	41,429,000		
145	20年国債	85,000,000	106,148,000		
146	20年国債	86,000,000	107,640,180		
147	20年国債	89,000,000	110,432,980		
148	20年国債	74,000,000	90,912,700		
149	20年国債	100,000,000	123,072,000		
150	20年国債	75,000,000	91,396,500		
151	20年国債	74,000,000	88,036,320		
152	20年国債	69,000,000	82,172,100		
153	20年国債	72,000,000	87,040,080		
154	20年国債	87,000,000	103,898,880		
155	20年国債	93,000,000	108,225,030		
156	20年国債	76,000,000	80,955,960		
157	20年国債	93,000,000	95,878,350		
158	20年国債	95,000,000	102,737,750		
159	20年国債	82,000,000	90,032,720		
160	20年国債	80,000,000	89,187,200		
161	20年国債	69,000,000	75,753,030		
162	20年国債	70,000,000	76,809,600		
163	20年国債	72,000,000	79,028,640		
164	20年国債	90,000,000	97,076,700		
165	20年国債	60,000,000	64,720,800		
166	20年国債	70,000,000	78,134,000		
167	20年国債	70,000,000	75,437,600		
168	20年国債	25,000,000	26,461,500		
169	20年国債	50,000,000	51,939,000		
国債証券 合計			15,914,984,650		
地方債証券	751	東京都公債	100,000,000	102,476,700	
	27-15	北海道公債	100,000,000	101,455,200	
	401	大阪府公債	100,000,000	103,003,100	
	3	兵庫県公債12年	100,000,000	103,292,100	
	11	兵庫県公債20年	100,000,000	119,206,600	
	28-1	静岡県公債	100,000,000	100,607,100	
	24-16	愛知県公債	100,000,000	102,677,600	
	29-6	千葉県公債	100,000,000	102,078,200	
	116	共同発行地方	100,000,000	102,658,700	



	1 1 7 共同発行地方	100,000,000	102,456,000	
	2 5 - 6 大阪市公債	100,000,000	103,061,800	
地方債証券	合計		1,142,973,100	
特殊債券	8 1 政保道路機構	100,000,000	120,759,400	
	1 2 2 政保道路機構	100,000,000	101,345,400	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	103,000,800	
	2 4 1 政保道路機構	100,000,000	103,582,200	
	2 6 1 政保道路機構	100,000,000	103,574,000	
	3 6 地方公共団体	100,000,000	102,502,800	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	102,878,800	
	い 7 8 9 利付商工債	100,000,000	100,059,200	
特殊債券	合計		837,702,600	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	100,429,400	
	3 3 中日本高速道	100,000,000	102,269,500	
	2 5 西日本高速道	100,000,000	102,804,400	
	1 7 パナソニック	100,000,000	101,849,200	
	5 NTTファイナンス	100,000,000	103,073,900	
	4 4 野村ホールディング	100,000,000	100,943,300	
	8 0 三菱地所	100,000,000	116,378,000	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	109,978,800	
	4 9 7 関西電力	100,000,000	104,718,600	
社債券	合計		942,445,100	
合計			18,838,105,450	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		

預金		1,960,627,185	310,544,181
金銭信託		35,420,013	81,363,318
コール・ローン		1,430,579,440	1,650,714,540
国債証券		163,192,191,471	181,018,748,472
派生商品評価勘定		-	9,687,789
未収入金		291,791	-
未収利息		1,178,992,237	1,166,961,459
前払費用		31,517,554	33,597,855
流動資産合計		167,829,619,691	184,271,617,614
資産合計		167,829,619,691	184,271,617,614
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,436,470	-
未払金		1,576,170,100	-
未払解約金		172,225,797	49,790,998
その他未払費用		4,761	-
流動負債合計		1,754,837,128	49,790,998
負債合計		1,754,837,128	49,790,998
純資産の部			
元本等			
元本	1	61,016,797,302	64,884,126,052
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		105,057,985,261	119,337,700,564
元本等合計		166,074,782,563	184,221,826,616
純資産合計		166,074,782,563	184,221,826,616
負債純資産合計		167,829,619,691	184,271,617,614

## 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9月8日 至 2019年9月9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	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1. 1 期首	2017年9月8日	2018年9月8日
期首元本額	59,538,261,711円	61,016,797,302円
期中追加設定元本額	6,429,006,075円	7,317,086,630円
期中一部解約元本額	4,950,470,484円	3,449,757,880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	759,746,065円	665,066,981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)	29,270,371円	22,335,406円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	190,347,672円	136,671,225円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	54,329,016円	41,439,241円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	610,874,046円	452,115,338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	21,328,975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)	351,032,696円	396,024,112円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	963,925,458円	1,397,701,870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)	677,810,224円	772,381,006円
D-I's 外国債券インデッ クス	645,862円	2,319,541円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	27,829円	137,425円
iFree 外国債券イン デックス	461,979,837円	581,553,813円
iFree 8資産バランス	423,058,282円	669,429,376円
iFree 年金バランス	926,034円	11,605,239円
DCダイワ外国債券インデッ クス	41,909,419,082円	44,921,822,655円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	731,192,133円	770,420,650円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	360,834,521円	386,983,564円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	234,738,086円	236,055,342円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	316,085,048円	383,524,126円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	256,163,773円	296,847,629円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	81,043,185円	96,841,002円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	10,877,692円	9,553,624円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	17,944,093円	18,774,212円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,798,984円	2,335,799円
ダイワつみたてインデックス外国債券	368,228円	42,409,294円
ダイワつみたてインデックスバランス30	-円	53,558円
ダイワつみたてインデックスバランス50	-円	35,706円
ダイワつみたてインデックスバランス70	-円	36,799円
ダイワ世界バランスファンド40VA	296,321,092円	202,933,789円
ダイワ世界バランスファンド60VA	166,976,918円	148,305,974円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,906,013,260円	5,009,608,503円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	36,172,639円	-円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	15,000,359円	1,596,398円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	345,571,442円	300,947,657円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	143,352,192円	149,526,227円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	27,594,446円	29,980,661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)	27,731,702円	903,195,629円

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,491,720,971円	5,690,917,776円
ダイワライフスタイル25	35,377,865円	34,527,657円
ダイワライフスタイル50	62,694,949円	60,594,929円
ダイワライフスタイル75	17,831,250円	16,187,344円
計	61,016,797,302円	64,884,126,052円
2. 期末日における受益権の総数	61,016,797,302口	64,884,126,052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 2018年9月8日 至 2019年9月9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	2019年9月9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	2018年9月7日現在	2019年9月9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	3,356,792,152	14,670,452,446
合計	3,356,792,152	14,670,452,446

(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(2017年12月1日から2018年9月7日まで、及び2018年12月1日から2019年9月9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	2018年9月7日 現在				2019年9月9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	1,264,722,280	-	1,258,285,810	6,436,470	1,636,106,701	-	1,645,794,490	9,687,789
アメリカ・ドル	546,332,857	-	544,330,500	2,002,357	707,186,956	-	710,848,250	3,661,294

イギリス・ ポンド	101,885,991	-	101,003,280	882,711	68,908,890	-	69,803,720	894,830
オーストラリ ア・ドル	11,123,725	-	11,015,750	107,975	35,501,952	-	36,315,790	813,838
カナダ・ドル	-	-	-	-	72,101,631	-	73,116,120	1,014,489
シンガポー ル・ドル	14,383,646	-	14,284,500	99,146	8,875,920	-	8,964,480	88,560
スウェーデン・ クローナ	-	-	-	-	5,748,135	-	5,856,030	107,895
デンマーク・ クローネ	15,337,032	-	15,256,920	80,112	22,701,376	-	22,721,810	20,434
ノルウェー・ クローネ	-	-	-	-	17,236,448	-	17,546,760	310,312
ポーランド・ ズロチ	14,200,025	-	13,985,360	214,665	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	31,314,327	-	32,476,800	1,162,473
ユーロ	561,459,004	-	558,409,500	3,049,504	656,876,022	-	658,092,730	1,216,708
南アフリカ・ ランド	-	-	-	-	9,655,044	-	10,052,000	396,956
合計	1,264,722,280	-	1,258,285,810	6,436,470	1,636,106,701	-	1,645,794,490	9,687,789

## (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)



	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,7218円 (27,218円)	2,8392円 (28,392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	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,556,344.500	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,189,353.560	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,615,259.690	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,561,316.520	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,175,197.430	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,263,139.360	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,476,753.980	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,555,409.840	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,184,822.080	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,431,214.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,736,207.050	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,752,501.520	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	2,000,314.310			
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,890,146.050			

1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,345,820.750	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,285,757.330	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,509,578.430	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,023,472.260	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,523,131.250	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,656,898.470	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,742,791.380	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,847,094.250	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,147,972.480	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	7,907,000.000	7,986,307.210	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,750,222.440	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,518,456.000	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,396,143.620	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	774,067.860	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,090,920.150	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	844,445.700	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	960,695.000	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	931,546.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	972,425.700	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	773,000.000	1,024,882.050	

6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,407,584.600	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,591,000.000	2,221,433.750	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,326,000.000	1,854,212.100	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	747,000.000	1,118,161.890	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	771,951.160	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	743,545.350	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,591,001.180	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,569,915.660	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,532,357.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,725,944.000	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	2,710,000.000	3,990,258.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	2,115,609.200	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	2,141,135.980	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,075,417.890	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,640,576.840	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,965,163.200	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,814,145.700	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,761,402.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,972,951.260	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,613,344.260	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,557,439.920	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	3,012,165.300	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,326,000.000	2,832,253.900	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,398,000.000	3,980,417.200	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	4,034,644.560	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,810,536.350	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,772,993.200	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,649,217.240	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,869,623.380	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,435,407.940	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,629,000.000	4,441,242.780	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,312,279.670	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,667,448.750	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,183,937.840	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,157,366.320	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	4,435,458.720	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,908,193.340	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,213,302.620	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,427,169.890	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,904,493.160	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	4,138,697.920	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,820,161.530	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,910,629.890	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,996,425.880	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	4,612,776.350	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,630,153.400	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,856,464.280	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,872,567.880	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,212,186.170	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,915,290.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	5,073,000.000	5,973,457.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,474,413.350	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,857,560.480	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,493,432.240	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,865,646.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,104,610.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,104,065.720	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	4,467,601.770	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,590,972.620	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,092,594.400	

2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,393,564.650	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,045,586.550	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,100,026.880	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,112,808.280	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,409,142.640	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,586,200.240	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,774,262.280	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,283,388.340	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,269,969.940	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,984,408.280	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,126,481.720	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,029,000.000	7,084,458.810	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,440,028.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,082,771.900	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,770,092.200	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,689,875.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,516,975.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,479,475.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,992,020.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	6,900,000.000	6,901,035.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,649,893.600	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,669,623.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,669,327.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,759,567.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,394,552.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,498,912.850	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	3,016,568.880	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,688,155.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,982,180.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,518,350.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,959,800.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,558,649.300	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,412,000.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	2,022,180.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,583,975.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,620,723.800	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,036,096.700	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,565,436.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,292,746.850	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,037,270.600	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,368,264.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	5,550,000.000	5,717,332.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,927,840.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	6,061,551.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	4,237,730.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,029,760.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,075,930.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,021,300.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,800,000.000	5,951,322.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,023,430.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,462,424.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,225,857.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,932,828.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,097,260.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	4,397,588.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,214,240.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,042,020.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915	2,500,000.000	2,491,975.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,531,625.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,400,000.000	3,513,390.000	



1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015	1,000,000.000	998,780.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,541,400.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,809,375.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,100,000.000	3,589,676.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,639,720.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201115	3,600,000.000	3,600,972.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	2,004,140.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,309,472.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	1,300,000.000	1,353,313.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,309,062.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,606,365.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,909,777.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,520,800.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,430,449.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,739,542.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,882,250.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	4,367,808.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,234,624.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,005,328.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,079,655.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,529,000.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,900,000.000	4,844,190.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,208,370.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	3,049,080.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,614,625.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,045,160.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,824,273.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,616,775.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	5,089,250.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,608,975.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,213,270.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,362,502.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	4,550,000.000	4,773,223.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	7,200,000.000	7,999,848.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,200,000.000	5,106,276.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,556,325.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,697,050.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,500,000.000	2,520,975.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,780,252.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,862,116.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,584,595.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20200930	3,300,000.000	3,335,310.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,718,550.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,168,510.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,082,380.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,722,450.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,300,000.000	3,342,537.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,228,720.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,115,120.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	6,400,000.000	7,262,976.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,800,000.000	6,246,720.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,500,000.000	2,531,425.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,247,950.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	3,000,000.000	3,175,050.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,870,308.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20201231	1,000,000.000	1,010,420.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,602,525.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,622,850.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	2,000,000.000	2,045,380.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,221,324.000	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,070,890.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,000,000.000	3,034,080.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,179,040.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,672,650.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,600,000.000	5,604,410.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,000,000.000	3,036,900.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,653,900.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,434,046.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,577,770.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,616,775.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,771,225.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,456,950.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,550,000.000	5,421,962.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	6,300,000.000	6,763,617.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,627,960.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,955,288.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,000,000.000	2,017,560.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,526,915.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,120,690.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,551,660.000	

	1.625% United States Treasury Note/Bond 20210630	4,700,000.000	4,703,478.000	
	1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,000,000.000	4,098,720.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,031,080.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20210731	4,700,000.000	4,716,685.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,500,000.000	3,553,865.000	
	1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,000,000.000	2,049,520.000	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	2,500,000.000	2,517,175.000	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,503,675.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,000,000.000	2,102,500.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 809,984,395.190 (86,627,831,066)	
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 20250907	1,821,000.000	2,007,579.660	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,512,644.030	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,675,557.400	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,583,708.950	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	1,600,000.000	1,608,544.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,390,000.000	1,556,939.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,350,000.000	1,542,510.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,430,000.000	1,802,086.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,110,000.000	2,256,391.800	

0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,031,600.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,300,000.000	2,546,882.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	930,000.000	1,211,883.000	
1% United Kingdom Gilt 20240422	1,200,000.000	1,236,864.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	270,000.000	321,192.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	340,000.000	404,817.600	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	650,000.000	674,310.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	100,000.000	101,588.000	
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,248,070.100	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,432,411.110	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,935,228.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,846,933.120	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	3,113,633.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,462,184.300	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	3,432,396.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,703,067.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,624,084.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,746,000.000	3,029,833.800	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,330,000.000	1,947,253.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,812,981.000	

	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,330,807.400	
	4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,508,107.500	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,510,000.000	2,317,397.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,374,000.000	2,794,990.800	
	3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,853,337.500	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,583,283.700	
	3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	856,881.300	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,761,473.600	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,336,567.560	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,966,000.000	2,920,296.400	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,089,747.360	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,661,000.000	3,341,267.600	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,559,179.200	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,311,953.200	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 87,228,463.590 (11,454,841,839)	
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	2,616,649.200	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,461,307.280	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,412,053.160	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,296,496.030	

2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,688,175.730	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,757,404.160	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,698,000.000	3,046,392.740	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,358,000.000	1,919,112.020	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,446,450.240	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,518,977.880	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	807,000.000	970,554.690	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,217,323.150	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	842,000.000	1,094,852.600	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,029,513.600	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,078,000.000	2,280,334.860	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,615,242.760	
2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,847,034.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,206,252.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	900,000.000	940,590.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,400,000.000	2,782,272.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	1,770,000.000	2,018,915.100	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	290,000.000	352,297.800	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	350,000.000	364,269.500	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 48,882,470.500	



			(3,575,752,717)
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	425,000.000	601,455.750
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	575,224.920
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,379,571.690
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,739,118.780
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,720,341.840
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,988,303.510
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	984,001.240
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,813,265.560
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	2,231,043.640
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,258,588.380
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,479,830.300
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,197,000.000	1,550,833.200
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,215,372.160
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,831,000.000	1,814,978.750
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,143,112.500
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,837,000.000	1,814,937.630
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,480,000.000	2,444,932.800
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,214,642.000
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,406,793.600

	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,400,000.000	1,383,018.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,271,568.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,619,120.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,000,000.000	1,023,930.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	740,000.000	835,622.800	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,327,665.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20201101	2,200,000.000	2,209,306.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,247,268.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210201	300,000.000	302,757.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210501	1,050,000.000	1,053,864.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,000,000.000	1,008,500.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210801	400,000.000	400,100.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	250,000.000	248,732.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20211101	200,000.000	199,086.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 42,506,885.550 (3,450,708,968)	
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	706,850.640	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	871,340.960	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	457,127.460	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	664,118.000	

	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	399,387.500	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	500,341.050	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	454,388.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	511,091.720	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	618,000.000	733,195.200	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	138,250.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	544,687.520	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	787,932.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	257,260.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	456,563.800	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	501,570.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	300,000.000	314,061.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	200,000.000	200,816.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	592,031.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	190,000.000	193,184.400	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	150,000.000	160,558.500	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 9,444,754.750 (730,929,570)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,095,000.000	スウェーデン・クローナ スウェーデン・クローナ 9,723,919.250	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	6,773,065.500	

	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,425,184.950	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,651,489.500	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,989,631.050	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	6,275,832.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,987,573.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,150,000.000	3,470,481.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 54,297,176.750 (601,069,747)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,662,000.000	23,611,818.160	デンマーク・クローネ
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	8,198,318.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,339,080.500	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	7,363,000.000	8,574,876.170	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,724,207.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	1,500,000.000	1,519,455.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	2,700,000.000	3,018,195.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 58,985,950.330 (931,388,155)	
ノルウェー・クローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,310,670.640	ノルウェー・クローネ
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,370,736.160	

	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,433,697.450	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,515,692.250	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,428,610.200	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,611,529.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,756,375.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,100,000.000	2,224,593.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 33,651,903.700 (400,457,654)	
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	2,585,779.830	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,504,481.750	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,143,909.650	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,066,346.530	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,870,000.000	2,988,531.000	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,357,908.800	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,850,000.000	2,925,325.500	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,190,000.000	2,258,985.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	1,940,000.000	2,069,786.000	
	Poland Government Bond 20210525	800,000.000	779,440.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	1,300,000.000	1,326,351.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,105,616.300	

	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,006,000.000	2,094,885.860	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,178,817.480	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,424,271.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	2,750,000.000	2,923,387.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,787,864.180	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 38,521,687.380 (1,045,863,812)	
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	577,612.650	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	842,316.300	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,279,272.660	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,951,733.400	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,607,792.300	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,384,162.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	882,218.750	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	755,927.100	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	653,158.020	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,011,300.290	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,466,527.900	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,215,650.000	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	713,028.000	

4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,100,231.300	
4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	873,325.850	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	762,463.350	
3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	704,452.000	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,183,314.420	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	881,573.800	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	717,429.960	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,066,830.900	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	672,724.000	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	355,998.720	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	900,000.000	916,263.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	776,910.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	923,375.000	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,197,504.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,236,732.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	500,000.000	509,810.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	780,535.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	700,116.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	674,134.500	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	410,000.000	428,208.100	

	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,100,000.000	1,302,906.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	403,708.000	
マレーシア・リングット 小計			マレーシア・リングット 32,509,245.270 (831,911,586)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	15,290,000.000	14,383,608.800	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,300,000.000	12,073,598.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	10,058,100.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	6,800,000.000	7,140,272.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	20,633,000.000	21,498,348.020	
	10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	25,206,148.830	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	26,468,000.000	27,337,473.800	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,238,477.300	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	16,044,000.000	17,763,916.800	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	12,194,000.000	13,650,207.480	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	26,326,000.000	26,128,291.740	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,715,857.750	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	24,380,806.870	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	19,388,781.060	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	9,944,000.000	10,457,309.280	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 254,421,197.730 (1,394,228,164)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	436,989.600	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	464,172.660	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	304,732.170	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	440,953.680	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	206,058.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	300,000.000	401,289.000	



Finland Government Bond 20220415	770,000.000	786,000.600	
0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	324,270.000	
1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	440,877.200	
0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	542,840.000	
0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	543,720.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	973,168.020	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,232,373.220	
1.5% Austria Government Bond 20470220	534,000.000	712,671.060	
1.5% Austria Government Bond 20861102	200,000.000	297,634.000	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	926,118.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	626,075.200	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	1,038,479.400	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	409,380.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,104,920.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	759,115.000	
Austria Government Bond 20240715	600,000.000	620,604.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,513,704.010	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,124,000.000	1,279,190.680	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	990,592.300	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,417,458.400	

1.6% Belgium Government Bond 20470622	944,000.000	1,209,622.720	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	440,000.000	657,628.400	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	509,012.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,538,250.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,111,782.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	681,655.600	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	365,640.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,640,000.000	1,811,052.000	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	647,278.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	800,000.000	894,824.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	783,768.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,282,085.940	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,170,454.250	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,109,819.720	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,875,612.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,656,632.490	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,748,000.000	3,006,892.120	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	3,206,821.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,710,921.350	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,375,961.000	

4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,926,120.420	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	2,505,475.260	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,487,507.720	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,440,551.300	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,800,554.400	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,503,833.700	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	2,998,942.660	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,391,716.360	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,438,000.000	4,105,421.340	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,764,751.800	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,529,835.900	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,982,528.700	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,786,722.600	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,749,553.190	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,609,000.000	4,508,952.070	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,778,043.240	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,690,263.300	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,363,947.240	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,378,108.260	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,362,599.680	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	3,019,261.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,729,216.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,539,568.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,450,000.000	2,032,204.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,500,000.000	1,661,790.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,900,000.000	2,067,295.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,700,000.000	1,852,660.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	1,000,000.000	1,065,360.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200911	350,000.000	352,761.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20201211	700,000.000	707,420.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210312	400,000.000	405,204.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210611	100,000.000	101,516.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,465,187.760	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,599,618.600	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,426,404.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,187,457.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,160,186.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	730,000.000	754,710.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,973,188.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,250,000.000	1,302,787.500	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	200,000.000	209,258.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,323,495.250	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,280,042.250	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,769,931.240	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	5,018,326.530	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	3,159,000.000	5,517,667.350	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,364,000.000	2,858,398.400	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,471,313.300	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	4,548,966.400	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,966,301.460	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	5,882,483.280	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	2,562,055.140	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	4,025,244.080	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,227,060.320	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,512,959.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,998,844.300	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,199,000.000	4,063,689.700	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,956,099.260	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,438,000.000	4,169,296.940	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,669,182.220	

2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,527,760.900	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	4,087,000.000	5,328,140.160	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,840,564.090	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,514,736.720	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,601,000.000	2,868,018.660	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,219,469.510	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,420,000.000	5,319,646.800	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,737,000.000	4,013,575.370	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,269,000.000	2,711,137.340	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,087,000.000	1,529,800.320	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,808,309.100	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,963,324.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,090,200.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,870,000.000	2,436,236.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,796,275.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,250,000.000	3,185,505.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,469,552.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,529,926.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	2,400,000.000	2,427,768.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	2,150,000.000	2,556,414.500	

0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,250,000.000	2,490,097.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,400,000.000	2,480,568.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,427,888.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	1,350,000.000	1,723,585.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	2,200,000.000	2,383,040.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	1,200,000.000	1,243,512.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	704,629.360	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,885,696.050	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,733,223.500	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	916,144.110	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,549,000.000	2,934,673.440	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,574,992.650	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,568,139.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,628,343.840	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,526,727.050	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,249,000.000	2,236,396.950	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,724,294.600	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,366,471.860	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,449,214.560	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,224,108.000	

0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,331,064.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,450,358.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,286,758.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	752,934.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	400,000.000	453,136.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,509,778.480	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,626,394.200	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,496,912.640	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	2,018,238.260	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,845,524.920	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,692,091.170	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,791,307.210	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,873,406.300	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,070,418.080	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,572,883.200	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	783,094.500	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,702,843.200	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,433,756.710	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,916,681.620	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,696,180.500	



2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	1,040,109.840	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,646,666.560	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	850,000.000	869,779.500	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,376,183.620	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,131,611.360	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,700,000.000	1,960,814.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,010,000.000	2,247,762.900	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,399,008.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,293,487.500	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,933,270.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,700,000.000	1,883,787.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,748,824.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,200,000.000	1,271,352.000	
0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015	1,900,000.000	1,912,065.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,200,000.000	1,464,636.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,000,000.000	2,217,500.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	928,359.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,376,999.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	1,500,000.000	1,509,900.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,828,426.500	

2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	1,400,000.000	1,530,522.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,500,000.000	1,684,950.000	
2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	700,000.000	737,604.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,000,000.000	1,268,150.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	850,000.000	1,202,299.500	
1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,050,000.000	1,082,497.500	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,282,318.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	1,200,000.000	1,285,404.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,500,000.000	1,654,965.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	700,000.000	867,181.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,904,951.680	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,369,397.340	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,655,000.000	2,564,885.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,716,499.420	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,834,603.900	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,942,412.820	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	3,172,836.600	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,656,877.810	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,650,316.940	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	3,189,449.880	

4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,307,895.740	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,600,396.100	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,275,362.880	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,507,662.970	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,271,306.560	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,932,409.970	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,240,678.300	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,253,620.500	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,199,085.520	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,613,000.000	2,525,328.930	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,614,238.760	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,845,517.310	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,575,478.140	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,426,317.860	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,679,611.410	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,584,078.200	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	3,009,110.640	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	985,537.520	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	1,818,043.360	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	3,042,327.600	

4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,596,803.340	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,339,067.730	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,521,440.760	
4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	1,036,571.600	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,493,007.300	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	853,000.000	1,547,145.810	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,744,460.550	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,077,629.670	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,498,722.030	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	813,126.150	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	585,103.680	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	716,672.760	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	955,077.830	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	534,627.600	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	1,028,694.150	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,169,645.110	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	667,172.000	
IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	356,965.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	546,150.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	798,476.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	228,736.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	400,000.000	445,096.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	400,000.000	474,824.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,274,757.000	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,453,185.300	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	2,205,001.490	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,193,473.750	

3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	890,312.760	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	990,068.800	
3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	739,928.760	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,077,808.690	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,059,407.300	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,059,330.870	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,045,359.160	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	853,113.010	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	490,799.520	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	501,249.840	
1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	657,018.720	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	482,893.120	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	648,961.500	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	596,944.760	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,653,926.080	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,926,497.450	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,434,205.520	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	2,049,008.640	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,973,159.140	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,790,500.300	

2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,452,000.000	2,089,674.840	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	950,000.000	1,611,266.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,030,000.000	2,231,457.200	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,131,646.400	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	2,012,400.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,450,000.000	1,817,082.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,293,191.500	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	1,300,000.000	1,311,297.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,000,000.000	1,029,530.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,100,000.000	2,347,107.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	850,000.000	1,191,640.500	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	1,400,000.000	1,441,384.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,124,010.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,200,000.000	1,215,420.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,900,000.000	2,139,020.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,100,000.000	1,305,766.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	900,000.000	925,803.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	800,000.000	834,576.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,339,562.500	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,626,816.640	

	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,708,000.000	3,056,346.440	
	4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,067,615.320	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	3,312,681.450	
	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,819,059.870	
	4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,786,365.080	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,766,575.450	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,781,791.550	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,283,047.160	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,129,834.720	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,280,914.850	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,587,332.900	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,499,000.000	2,901,779.190	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,352,613.400	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,428,829.280	
	ユーロ 小計		ユーロ 585,679,043.970 (68,987,134,590)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	20,934,000.000	23,619,832.200	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,612,000.000	8,511,247.640	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,633,092.800	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,319,168.800	

	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	9,999,000.000	8,552,144.700	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	7,439,000.000	7,547,981.350	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	20,052,000.000	17,909,243.280	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	10,001,006.450	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	13,862,000.000	13,078,103.900	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	12,644,000.000	11,389,209.440	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	10,743,000.000	9,991,204.860	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	7,366,000.000	7,002,782.540	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	8,679,000.000	8,097,420.210	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 136,652,438.170 (986,630,604)	
国債証券 合計			181,018,748,472 [181,018,748,472]	
合計			181,018,748,472 [181,018,748,472]	

- (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 243銘柄	100%	47.9%
イギリス・ポンド	国債証券 43銘柄	100%	6.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	100%	2.0%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 17銘柄	100%	0.6%



マレーシア・リングgit	国債証券	35銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	307銘柄	100%	38.1%
南アフリカ・ランド	国債証券	13銘柄	100%	0.5%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

### 「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	104,826,684	179,782,730
金銭信託	1,502,922	5,562,269
コール・ローン	60,701,524	112,848,380
国債証券	9,020,136,867	13,293,383,939
派生商品評価勘定	21,867	3,173,630
未収利息	123,920,829	179,582,805
前払費用	22,672,966	17,909,951
流動資産合計	9,333,783,659	13,792,243,704
資産合計	9,333,783,659	13,792,243,704
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	723,381	-
未払金	20,385,000	92,941,055
未払解約金	6,319,491	1,153,226
その他未払費用	466	-
流動負債合計	27,428,338	94,094,281
負債合計	27,428,338	94,094,281
純資産の部		
元本等		

元本	1	7,543,379,126	10,015,179,396
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,762,976,195	3,682,970,027
元本等合計		9,306,355,321	13,698,149,423
純資産合計		9,306,355,321	13,698,149,423
負債純資産合計		9,333,783,659	13,792,243,704

## 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9月8日 至 2019年9月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1. 1 期首	2017年9月8日	2018年9月8日
期首元本額	4,669,291,401円	7,543,379,126円
期中追加設定元本額	3,373,618,783円	2,912,481,879円
期中一部解約元本額	499,531,058円	440,681,609円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国債券インデックスファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)	- 円	17,127,669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)	190,640,540円	208,931,970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)	366,615,948円	407,678,668円
D-I's 新興国債券インデックス	49,787,554円	56,456,104円
iFree 新興国債券インデックス	1,524,145,810円	2,328,868,726円
iFree 8資産バランス	925,602,549円	1,410,629,846円
DCダイワ新興国債券インデックスファンド	4,271,046,476円	5,371,446,714円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	185,588,639円	179,795,307円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	29,951,610円	34,244,392円

計	7,543,379,126円	10,015,179,396円
2. 期末日における受益権の総数	7,543,379,126口	10,015,179,396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 2018年9月8日 至 2019年9月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年9月9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	2018年9月7日現在	2019年9月9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	179,522,411	143,130,090
合計	179,522,411	143,130,090

(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(2018年7月6日から2018年9月7日まで、及び2019年7月6日から2019年9月9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	2018年9月7日 現在				2019年9月9日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	2,638,542	-	2,626,610	11,932	-	-	-	-
トルコ・リラ	2,638,542	-	2,626,610	11,932	-	-	-	-
買 建	106,403,957	-	105,690,511	713,446	99,423,370	-	102,597,000	3,173,630
インドネシア・ルピア	-	-	-	-	15,160,000	-	15,200,000	40,000
チェコ・コルナ	37,725,768	-	37,519,320	206,448	-	-	-	-
トルコ・リラ	-	-	-	-	16,257,770	-	16,677,000	419,230

ハンガリー・ フォロント	23,508,179	-	23,432,531	75,648	-	-	-	-
ポーランド・ ズロチ	24,974,027	-	24,673,460	300,567	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	68,005,600	-	70,720,000	2,714,400
ルーマニア・ レイ	20,195,983	-	20,065,200	130,783	-	-	-	-
合計	109,042,499	-	108,317,121	701,514	99,423,370	-	102,597,000	3,173,630

## (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)

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1口当たり純資産額	1.2337円	1.3677円
(1万口当たり純資産額)	(12,337円)	(13,677円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

国債証券	アルゼンチン・ペソ	18.2% REPUBLIC OF ARGENTINA 20211003	アルゼンチン・ペソ 4,700,000.000	アルゼンチン・ペソ 1,318,914.000	
		16% REPUBLIC OF ARGENTINA 20231017	1,400,000.000	436,016.000	
		15.5% REPUBLIC OF ARGENTINA 20261017	16,800,000.000	5,097,624.000	
	アルゼンチン・ペソ 小計			アルゼンチン・ペソ 6,852,554.000 (13,156,903)	
インドネシア・ルピア	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	インドネシア・ルピア 8,250,000,000.000	インドネシア・ルピア 8,573,730,000.000		
	8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	6,000,000,000.000	6,521,820,000.000		
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	5,500,000,000.000	5,415,685,000.000		
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	7,107,280,000.000		
	8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	10,000,000,000.000	10,556,800,000.000		
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	5,000,000,000.000	5,264,200,000.000		
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	9,000,000,000.000	9,587,700,000.000		
	11% Indonesia Treasury Bond 20201115	2,400,000,000.000	2,531,568,000.000		
	12.8% Indonesia Treasury Bond 20210615	1,600,000,000.000	1,769,616,000.000		
	11% Indonesia Treasury Bond 20250915	4,700,000,000.000	5,586,326,000.000		
	10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	4,180,000,000.000	5,101,857,200.000		
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20210715	9,210,000,000.000	9,512,640,600.000		
	9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,393,640,800.000		
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	10,224,000,000.000	10,882,936,800.000			

	8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	4,958,952,500.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20270515	10,330,000,000.000	10,173,293,900.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20220515	8,660,000,000.000	8,759,330,200.000	
	5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515	10,910,000,000.000	10,529,350,100.000	
	6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	8,700,000,000.000	8,010,438,000.000	
	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	6,975,000,000.000	6,336,508,500.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	12,020,000,000.000	12,688,552,400.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	13,150,000,000.000	13,968,719,000.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	7,820,000,000.000	8,595,978,600.000	
	インドネシア・ルピア 小計		インドネシア・ルピア 175,826,923,600.000 (1,336,284,619)	
ウルグアイ・ペ ソ	9.875% Uruguay Government International Bond 20220620	5,300,000.000	5,167,500.000	
	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,390,108.000	
	ウルグアイ・ペソ 小計		ウルグアイ・ペソ 7,557,608.000 (22,219,368)	
コロンビア・ペ ソ	9.85% Colombia Government International Bond 20270628	90,000,000.000	114,192,900.000	
	7.75% Colombia Government International Bond 20210414	95,000,000.000	99,185,700.000	
	4.375% Colombia Government International Bond 20230321	45,000,000.000	44,045,100.000	
	7% Colombian TES 20220504	4,335,000,000.000	4,572,774,750.000	
	10% Colombian TES 20240724	4,550,000,000.000	5,498,356,500.000	
	6% Colombian TES 20280428	3,590,000,000.000	3,633,223,600.000	



	7.5% Colombian TES 20260826	3,310,000,000.000	3,678,734,000.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	2,700,000,000.000	3,084,561,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	2,200,000,000.000	2,363,394,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	2,300,000,000.000	2,405,110,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	1,700,000,000.000	1,861,517,000.000	
コロンビア・ペソ 小計			コロンビア・ペソ 27,355,094,550.000 (872,627,516)	
タイ・パーツ		タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	4.875% Thailand Government Bond 20290622	23,050,000.000	30,030,462.000	
	3.625% Thailand Government Bond 20230616	19,300,000.000	20,862,528.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	20,610,000.000	23,519,307.600	
	3.65% Thailand Government Bond 20211217	30,600,000.000	32,150,502.000	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	22,700,000.000	27,891,263.000	
	1.875% Thailand Government Bond 20220617	21,200,000.000	21,477,084.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	21,100,000.000	26,713,233.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	23,400,000.000	24,387,948.000	
	2% Thailand Government Bond 20221217	26,000,000.000	26,497,380.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	29,000,000.000	36,354,980.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	21,000,000.000	25,617,900.000	
	2.4% Thailand Government Bond 20231217	22,000,000.000	22,890,120.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	19,000,000.000	21,201,150.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	13,000,000.000	16,403,660.000	
タイ・パーツ 小計			タイ・パーツ 355,997,517.600 (1,242,431,337)	

チェコ・コルナ	3.85% Czech Republic Government Bond 20210929	チェコ・コルナ 8,200,000.000	チェコ・コルナ 8,662,562.000	
	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	12,600,000.000	14,017,500.000	
	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	8,600,000.000	10,524,250.000	
	4.7% Czech Republic Government Bond 20220912	10,200,000.000	11,273,550.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	16,100,000.000	17,368,680.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	10,900,000.000	10,833,946.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	12,000,000.000	11,613,840.000	
	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	9,900,000.000	9,682,299.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	8,000,000.000	7,500,480.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	12,000,000.000	13,800,360.000	
チェコ・コルナ 小計		チェコ・コルナ 115,277,467.000 (525,665,250)		
チリ・ペソ	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20210301	チリ・ペソ 425,000,000.000	チリ・ペソ 441,060,750.000	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	550,000,000.000	620,680,500.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	570,000,000.000	740,589,600.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	410,000,000.000	636,131,400.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	320,000,000.000	384,441,600.000	
	4% BONOS TESORERIA PESOS 20230301	250,000,000.000	266,415,000.000	
チリ・ペソ 小計		チリ・ペソ 3,089,318,850.000 (463,706,759)		
トルコ・リラ		トルコ・リラ	トルコ・リラ	

	9.5% Turkey Government Bond 20220112	1,660,000.000	1,472,918.000	
	8.5% Turkey Government Bond 20220914	790,000.000	666,317.600	
	7.1% Turkey Government Bond 20230308	2,780,000.000	2,187,165.000	
	10.4% Turkey Government Bond 20240320	680,000.000	573,654.800	
	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,305,646.300	
	8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000	1,988,179.000	
	10.7% Turkey Government Bond 20210217	1,610,000.000	1,520,081.500	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000	2,103,724.900	
	9.2% Turkey Government Bond 20210922	2,010,000.000	1,802,970.000	
	11% Turkey Government Bond 20220302	2,400,000.000	2,192,304.000	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,428,064.100	
	10.7% Turkey Government Bond 20220817	1,900,000.000	1,698,163.000	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	1,700,000.000	1,342,915.000	
	12.2% Turkey Government Bond 20230118	1,400,000.000	1,293,096.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	2,000,000.000	1,741,040.000	
	16.2% Turkey Government Bond 20230614	1,400,000.000	1,433,516.000	
	トルコ・リラ 小計		トルコ・リラ 25,749,755.200 (483,322,905)	
	ドミニカ・ペソ 9.75% Dominican Republic International Bond 20260605	ドミニカ・ペソ 11,000,000.000	ドミニカ・ペソ 11,523,930.000	
	ドミニカ・ペソ 小計		ドミニカ・ペソ 11,523,930.000 (23,624,057)	

ハンガリー・ フォリント		ハンガリー・フォリント	ハンガリー・フォリント	
	3% Hungary Government Bond 20240626	98,500,000.000	107,628,980.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	170,000,000.000	187,137,700.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20211027	89,000,000.000	93,828,250.000	
	1.75% Hungary Government Bond 20221026	140,000,000.000	145,399,800.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	139,928,100.000	
	0.5% Hungary Government Bond 20210421	60,000,000.000	60,505,200.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	88,000,000.000	124,066,800.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20241024	110,000,000.000	117,791,300.000	
	7.5% Hungary Government Bond 20201112	99,500,000.000	108,350,525.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	131,800,000.000	160,242,440.000	
	7% Hungary Government Bond 20220624	125,000,000.000	148,440,000.000	
5.5% Hungary Government Bond 20250624	142,500,000.000	175,951,875.000		
ハンガリー・フォリント 小計			ハンガリー・フォリント 1,569,270,970.000 (560,229,737)	
フィリピン・ペ ソ	4.95% Philippine Government International Bond 20210115	フィリピン・ペソ 15,000,000.000	フィリピン・ペソ 15,225,000.000	
フィリピン・ペソ 小計			フィリピン・ペソ 15,225,000.000 (31,363,500)	
ブラジル・レア ル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20210101	ブラジル・リアル 5,030,000.000	ブラジル・リアル 5,307,806.900	

	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101	9,910,000.000	10,930,531.800	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	5,990,000.000	6,790,982.800	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	5,550,000.000	6,417,021.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	1,900,000.000	2,230,524.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20210701	5,030,000.000	4,555,369.200	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220101	7,200,000.000	6,298,344.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220701	4,200,000.000	3,546,942.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701	7,600,000.000	5,951,484.000	
	ブラジル・リアル 小計		ブラジル・リアル 52,029,005.700 (1,369,923,719)	
ペルー・ソル		ペルー・ソル	ペルー・ソル	
	5.7% Peru Government Bond 20240812	1,730,000.000	1,928,690.500	
	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,970,000.000	2,300,664.500	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	1,850,000.000	2,132,791.000	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	1,900,000.000	2,162,124.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	1,000,000.000	1,065,960.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	1,565,000.000	1,984,263.500	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	2,065,000.000	2,560,785.850	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	1,920,000.000	2,354,188.800	
	ペルー・ソル 小計		ペルー・ソル 16,489,468.150 (527,662,980)	
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	2,210,000.000	2,474,912.700	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,640,000.000	3,777,410.000	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,260,000.000	2,277,967.000	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	4,230,000.000	4,251,276.900	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,640,000.000	3,790,332.000	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	3,200,000.000	3,252,288.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,000,000.000	3,079,290.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	3,500,000.000	3,610,250.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	500,000.000	533,450.000	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	1,720,000.000	1,796,213.200	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,820,000.000	1,979,195.400	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,530,000.000	2,756,586.800	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	5,700,000.000	6,059,385.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	3,550,000.000	3,819,729.000	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 43,458,286.000 (1,179,892,466)	
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	
	3.948% Malaysia Government Investment Issue 20220414	2,000,000.000	2,040,360.000	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,200,000.000	1,273,608.000	
	4.094% Malaysia Government Investment Issue 20231130	2,000,000.000	2,067,840.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	1,000,000.000	1,077,970.000	

4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	1,500,000.000	1,594,620.000	
4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,350,000.000	1,375,177.500	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	2,500,000.000	2,562,500.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,811,166.000	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,850,000.000	1,913,917.500	
3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	1,740,000.000	1,751,066.400	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,400,000.000	1,430,772.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,300,000.000	1,345,448.000	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	1,200,000.000	1,213,632.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,420,000.000	1,470,949.600	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,120,000.000	2,199,500.000	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,700,000.000	1,938,816.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,400,000.000	1,427,468.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	2,000,000.000	2,074,260.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,400,000.000	1,462,174.000	
マレーシア・リングgit 小計		マレーシア・リングgit 32,031,245.000 (819,679,560)	
メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
5.75% Mexican Bonos 20260305	10,400,000.000	9,783,488.000	
8% Mexican Bonos 20471107	9,500,000.000	10,150,370.000	
7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	10,058,100.000	
8% Mexican Bonos 20240905	10,000,000.000	10,500,400.000	
8% Mexican Bonos 20231207	16,250,000.000	16,931,525.000	
10% Mexican Bonos 20241205	20,350,000.000	23,190,249.500	

	7.5% Mexican Bonos 20270603	23,230,000.000	23,993,105.500	
	10% Mexican Bonos 20361120	7,390,000.000	9,359,065.500	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	11,230,000.000	12,433,856.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	14,100,000.000	15,783,822.000	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	21,950,000.000	21,785,155.500	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,950,000.000	24,185,857.500	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	19,450,000.000	19,277,478.500	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	17,820,000.000	18,521,929.800	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,130,000.000	7,498,050.600	
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 233,452,453.400 (1,279,319,445)	
ルーマニア・レイ		ルーマニア・レイ	ルーマニア・レイ	
	5.85% Romania Government Bond 20230426	1,430,000.000	1,537,221.400	
	5.95% Romania Government Bond 20210611	940,000.000	980,899.400	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	1,150,000.000	1,196,977.500	
	3.25% Romania Government Bond 20210322	1,130,000.000	1,128,689.200	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	1,200,000.000	1,335,660.000	
	3.5% Romania Government Bond 20221219	1,090,000.000	1,090,196.200	
	3.25% Romania Government Bond 20240429	1,600,000.000	1,566,992.000	
	3.4% Romania Government Bond 20220308	1,700,000.000	1,700,561.000	
	4.25% Romania Government Bond 20230628	1,500,000.000	1,530,135.000	
	4% Romania Government Bond 20211027	1,000,000.000	1,012,660.000	
ルーマニア・レイ	小計		ルーマニア・レイ 13,079,991.700 (325,822,593)	
ロシア・ルーブル		ロシア・ルーブル	ロシア・ルーブル	
	7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20210414	14,880,000.000	15,106,920.000	



8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203	41,760,000.000	44,893,670.400	
7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20220720	32,910,000.000	33,754,470.600	
7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	14,400,000.000	14,562,720.000	
7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	46,160,000.000	46,795,161.600	
7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	24,300,000.000	24,627,321.000	
7.5% Russian Federal Bond - OFZ 20210818	29,300,000.000	29,798,393.000	
8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	31,000,000.000	34,672,260.000	
7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	56,100,000.000	59,157,450.000	
7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	39,000,000.000	39,973,050.000	
7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	47,000,000.000	49,311,460.000	
7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	35,600,000.000	36,280,672.000	
7% Russian Federal Bond - OFZ 20211215	49,000,000.000	49,430,710.000	
6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	38,000,000.000	37,822,540.000	
7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	25,000,000.000	25,228,000.000	
6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	39,000,000.000	38,960,610.000	
7.95% Russian Federal Bond - OFZ 20261007	36,000,000.000	38,430,360.000	
7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20240717	38,000,000.000	39,185,220.000	
ロシア・ルーブル 小計		ロシア・ルーブル 657,990,988.600 (1,072,525,311)	
南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	

	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	30,050,000.000	33,905,415.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	10,220,000.000	7,490,953.400	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	9,880,000.000	7,011,836.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	11,440,000.000	9,784,632.000	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	9,880,000.000	10,024,742.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	21,020,000.000	18,773,802.800	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	14,500,000.000	13,158,025.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	15,100,000.000	14,246,095.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	13,100,000.000	11,799,956.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	10,300,000.000	9,579,206.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	10,100,000.000	9,601,969.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	14,000,000.000	13,061,860.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 158,438,492.200 (1,143,925,914)	
国債証券	合計		13,293,383,939 [13,293,383,939]	
合計			13,293,383,939 [13,293,383,939]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アルゼンチン・ペソ	国債証券 3銘柄	100%	0.1%
インドネシア・ルピア	国債証券 23銘柄	100%	10.1%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 2銘柄	100%	0.2%

コロンビア・ペソ	国債証券	11銘柄	100%	6.6%
タイ・バーツ	国債証券	14銘柄	100%	9.3%
チェコ・コルナ	国債証券	10銘柄	100%	4.0%
チリ・ペソ	国債証券	6銘柄	100%	3.5%
トルコ・リラ	国債証券	16銘柄	100%	3.6%
ドミニカ・ペソ	国債証券	1銘柄	100%	0.2%
ハンガリー・フォリント	国債証券	12銘柄	100%	4.2%
フィリピン・ペソ	国債証券	1銘柄	100%	0.2%
ブラジル・レアル	国債証券	9銘柄	100%	10.1%
ペルー・ソル	国債証券	8銘柄	100%	4.0%
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	100%	8.9%
マレーシア・リングgit	国債証券	19銘柄	100%	6.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	9.6%
ルーマニア・レイ	国債証券	10銘柄	100%	2.5%
ロシア・ルーブル	国債証券	18銘柄	100%	8.1%
南アフリカ・ランド	国債証券	12銘柄	100%	8.6%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

### 「ダイワ」- REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	31,433,221	70,019,279
コール・ローン	1,269,556,853	1,420,564,515
投資証券	211,120,283,560	335,680,895,490
派生商品評価勘定	60,285,600	475,184,000
未収配当金	2,565,948,292	3,568,936,872
流動資産合計	215,047,507,526	341,215,600,156
資産合計	215,047,507,526	341,215,600,156

負債の部		
流動負債		
前受金	72,180,000	435,400,000
未払金	95,618,232	652,682,110
未払解約金	88,714,000	151,273,000
その他未払費用	12,455	-
流動負債合計	256,524,687	1,239,355,110
負債合計	256,524,687	1,239,355,110
純資産の部		
元本等		
元本	1 84,070,307,149	104,354,428,940
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	130,720,675,690	235,621,816,106
元本等合計	214,790,982,839	339,976,245,046
純資産合計	214,790,982,839	339,976,245,046
負債純資産合計	215,047,507,526	341,215,600,156

## 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9月8日 至 2019年9月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	<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>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
----------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1. 1 期首	2017年9月8日	2018年9月8日
期首元本額	104,098,531,305円	84,070,307,149円
期中追加設定元本額	6,062,089,203円	26,476,296,710円
期中一部解約元本額	26,090,313,359円	6,192,174,919円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	8,235,513,016円	6,467,868,523円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	67,928,505,128円	88,304,145,289円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	408,772,189円	319,750,593円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	30,010円	147,017円
iFree J-REITイ ンデックス	134,289,664円	106,103,863円
iFree 8資産バランス	451,203,721円	609,288,680円
DC・ダイワJ-REIT オープン	3,694,470,466円	4,847,475,470円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,917,015円	2,194,356円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,244,205円	4,628,999円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,396,903円	1,391,836円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	50,917,209円	60,130,254円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	958,089,363円	1,230,384,800円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	361,884,475円	804,740,012円

	ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	368,976,313円	359,689,776円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,468,097,472円	1,236,489,472円
計		84,070,307,149円	104,354,428,940円
2.	期末日における受益権の総数	84,070,307,149口	104,354,428,940口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 386,400,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 478,800,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2018年9月8日 至 2019年9月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年9月9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	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資証券	6,490,336,661	38,568,584,401
合計	6,490,336,661	38,568,584,401

(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(2018年3月16日から2018年9月7日まで、及び2019年3月16日から2019年9月9日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種 類	2018年9月7日 現在			2019年9月9日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)

		1年超				1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	3,079,620,000	-	3,140,100,000	60,480,000	3,803,600,000	-	4,279,000,000	475,400,000
合計	3,079,620,000	-	3,140,100,000	60,480,000	3,803,600,000	-	4,279,000,000	475,400,000

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1口当たり純資産額	2.5549円	3.2579円
(1万口当たり純資産額)	(25,549円)	(32,579円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	3,184	369,344,000	
	サンケイリアルエステート	4,495	543,895,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	10,308	7,081,596,000	
	MCUBS Mid City投資法人	36,796	4,194,744,000	
	森ヒルズリート	35,689	6,038,578,800	
	産業ファンド	38,166	5,835,581,400	



アドバンス・レジデンス	28,720	10,238,680,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	19,305	4,011,579,000	
A P I 投資法人	15,544	8,269,408,000	
G L P 投資法人	77,261	10,615,661,400	
コンフォリア・レジデンシャル	12,916	4,514,142,000	
日本プロロジスリート	44,568	12,978,201,600	
星野リゾート・リート	4,720	2,657,360,000	
ONE リート投資法人	4,835	1,481,927,500	
イオンリート投資	33,479	4,653,581,000	
ヒューリックリート投資法	25,213	4,861,066,400	
日本リート投資法人	10,076	4,483,820,000	
インベスコ・オフィス・Jリート	199,289	4,107,346,290	
日本ヘルスケア投資法	1,504	278,691,200	
積水ハウス・リート投資	90,700	8,444,170,000	
トーセイ・リート投資法人	5,704	747,224,000	
ケネディクス商業リート	11,369	3,311,789,700	
ヘルスケア&メディカル投資	6,616	907,053,600	
サムティ・レジデンシャル	6,209	776,125,000	
野村不動産マスターF	96,740	18,477,340,000	
いちごホテルリート投資	5,139	665,500,500	
ラサールロジポート投資	25,742	3,938,526,000	
スターアジア不動産投	10,294	1,177,633,600	
マリモ地方創生リート	2,667	324,040,500	
三井不ロジパーク	7,639	3,330,604,000	
大江戸温泉リート	5,270	466,922,000	
さくら総合リート	6,711	639,558,300	
投資法人みらい	33,648	2,018,880,000	
森トラスト・ホテルリート投	7,278	1,018,920,000	
三菱地所物流REIT	4,954	1,590,234,000	
CREロジスティクスファンド	4,354	563,843,000	
ザイマックス・リート	4,503	598,899,000	
タカラレーベン不動産投	8,804	1,015,981,600	
伊藤忠アドバンスロジ	4,799	533,168,900	
日本ビルファンド	30,039	23,971,122,000	
ジャパンリアルエステイト	31,020	22,427,460,000	
日本リテールファンド	58,627	12,610,667,700	
オリックス不動産投資	61,807	14,487,560,800	
日本プライムリアルティ	19,636	9,798,364,000	
プレミアム投資法人	28,018	4,362,402,600	

東急リアル・エステート	20,798	4,307,265,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	21,540	3,315,006,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	69,650	14,278,250,000	
森トラスト総合リート	22,170	4,478,340,000	
インヴィンシブル投資法人	136,068	9,130,162,800	
フロンティア不動産投資	11,018	5,051,753,000	
平和不動産リート	19,317	2,632,907,100	
日本ロジスティクスファンド投資法人	20,268	5,608,155,600	
福岡リート投資法人	16,043	2,894,157,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	9,596	7,945,488,000	
いちごオフィスリート投資法人	24,020	2,572,542,000	
大和証券オフィス投資法人	7,160	5,985,760,000	
阪急阪神リート投資法人	14,011	2,230,551,200	
スタートアップリート投資法人	4,831	965,233,800	
大和ハウスリート投資法人	41,821	12,270,281,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	99,929	8,264,128,300	
日本賃貸住宅投資法人	34,891	3,534,458,300	
ジャパンエクセレント投資法人	27,778	4,797,260,600	
投資証券 合計		335,680,895,490	
合計		335,680,895,490	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド

600口

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
--	-------------	-------------

	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	495,936,765	33,874,213
金銭信託	16,968,965	13,143,036
コール・ローン	685,359,770	266,648,425
出資証券	1,057,006	-
投資信託受益証券	222,178,145	177,901,699
投資証券	18,188,431,705	24,277,172,699
派生商品評価勘定	2,340,602	17,716,516
未収入金	111,004,335	1,748,342
未収配当金	14,700,220	20,654,985
差入委託証拠金	53,983,590	72,396,468
流動資産合計	19,791,961,103	24,881,256,383
資産合計	19,791,961,103	24,881,256,383
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,778,350	332,757
未払金	886,822,111	24,932,719
未払株式払込金	-	701,386
未払解約金	654,000	12,567,200
その他未払費用	522	-
流動負債合計	890,254,983	38,534,062
負債合計	890,254,983	38,534,062
純資産の部		
元本等		
元本	1 8,231,121,083	10,095,442,480
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	10,670,585,037	14,747,279,841
元本等合計	18,901,706,120	24,842,722,321
純資産合計	18,901,706,120	24,842,722,321
負債純資産合計	19,791,961,103	24,881,256,383

## 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9月8日 至 2019年9月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)出資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1. 1 期首	2017年9月8日	2018年9月8日
期首元本額	5,412,642,039円	8,231,121,083円
期中追加設定元本額	3,412,686,057円	2,835,957,978円
期中一部解約元本額	594,207,013円	971,636,581円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国	4,130,870,595円	4,757,864,319円
REITインデックス（為替		
ヘッジあり）		

ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	566,222,806円	744,491,511円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	329,680,925円	337,120,998円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	235,672,616円	230,353,697円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,220,713円	1,218,540円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	35,023円	162,858円
iFree 外国REITイ ンデックス	74,036,398円	88,594,922円
iFree 8資産バランス	499,504,519円	784,640,527円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	1,662,020,791円	2,079,374,904円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,255,863円	2,785,747円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,817,250円	6,019,823円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,354,288円	1,604,642円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	277,810,112円	250,529,311円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	24,787,457円	33,216,198円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)(ダ イワSMA専用)	198,053,967円	564,064,704円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)(ダ イワSMA専用)	220,777,760円	213,399,779円
計	8,231,121,083円	10,095,442,480円
2. 期末日における受益権の総数	8,231,121,083口	10,095,442,480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 2018年9月8日 至 2019年9月9日
----	----------------------------

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年9月9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	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
出資証券	165,512	-
投資信託受益証券	26,522	6,580,740
投資証券	427,296,548	2,180,917,198
合計	427,104,514	2,187,497,938

（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（2017年12月1日から2018年9月7日まで、及び2018年12月1日から2019年9月9日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	2018年9月7日 現在				2019年9月9日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	405,239,788	-	406,892,918	1,653,130	365,176,630	-	380,125,718	14,949,088
合計	405,239,788	-	406,892,918	1,653,130	365,176,630	-	380,125,718	14,949,088

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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



## 2. 通貨関連

種 類	2018年9月7日 現在				2019年9月9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	675,270,868	-	673,179,990	2,090,878	250,013,229	-	252,447,900	2,434,671
アメリカ・ドル	470,766,400	-	469,112,500	1,653,900	121,722,775	-	122,751,000	1,028,225
イギリス・ポンド	46,319,914	-	46,249,080	70,834	2,560,520	-	2,624,000	63,480
オーストラリア・ドル	9,510,360	-	9,508,800	1,560	-	-	-	-
カナダ・ドル	4,240,625	-	4,192,000	48,625	7,936,247	-	8,105,000	168,753
シンガポール・ドル	42,629,465	-	42,581,200	48,265	-	-	-	-
ユーロ	82,797,319	-	82,541,910	255,409	117,793,687	-	118,967,900	1,174,213
香港・ドル	19,006,785	-	18,994,500	12,285	-	-	-	-
合計	675,270,868	-	673,179,990	2,090,878	250,013,229	-	252,447,900	2,434,671

## (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)

	2018年9月7日現在	2019年9月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,2964円 (22,964円)	2,4608円 (24,608円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	17,800.000	アメリカ・ドル 1,663,410.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 1,663,410.000 (177,901,699)	
投資信託受益証券 合計				177,901,699 [177,901,699]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23,500	649,540.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,700	86,036.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	21,682	410,223.440	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,100	392,314.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,100	5,415,325.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	55,647	8,416,608.750	
		BOSTON PROPERTIES INC	27,800	3,618,726.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	26,867	1,391,710.600	
		VORNADO REALTY TRUST	31,264	1,961,816.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	13,600	285,736.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,200	345,270.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,700	171,125.000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,000	495,300.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	66,800	5,801,580.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	36,200	583,544.000	
		EPR PROPERTIES	13,600	1,080,520.000	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	42,490.000			
CITY OFFICE REIT INC	5,300	71,179.000			

GLOBAL NET LEASE INC	15,133	294,185.520	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,829	342,804.420	
CHATHAM LODGING TRUST	7,400	127,132.000	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	10,000	261,400.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,700	187,530.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,300	740,745.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19,700	356,373.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,900	123,946.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	37,921.860	
HOST HOTELS & RESORTS INC	133,500	2,224,110.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	46,908	1,184,427.000	
CORESITE REALTY CORP	6,400	762,368.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	27,800	957,710.000	
RLJ LODGING TRUST	31,271	520,349.440	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	18,647.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,900	550,275.000	
CYRUSONE INC	20,400	1,510,212.000	
KIMCO REALTY CORP	76,000	1,470,600.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,700	40,330.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	36,950	1,061,204.000	
WHITESTONE REIT	5,800	73,196.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	36,400	1,423,968.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,600	449,062.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	36,300	878,460.000	
COLONY CAPITAL INC	83,511	438,432.750	
INVITATION HOMES INC	75,697	2,178,559.660	
JBG SMITH PROPERTIES	21,732	854,067.600	
CLIPPER REALTY INC	1,400	14,826.000	
GLADSTONE LAND CORP	2,500	29,275.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	34,500	1,270,980.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10,500	227,430.000	
VICI PROPERTIES INC	73,900	1,648,709.000	
SPIRIT MTA REIT	5,870	49,542.800	
RETAIL VALUE INC	2,709	101,912.580	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	16,600	321,874.000	
BRT APARTMENTS CORP	1,300	18,603.000	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7,300	80,519.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,900	158,270.000	
SAFEHOLD INC	1,300	35,971.000	

WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,960	103,362.000	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	8,300	97,981.500	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	12,500	283,000.000	
CORECIVIC INC	21,424	370,635.200	
STORE CAPITAL CORP	36,400	1,371,552.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17,800	201,852.000	
LIFE STORAGE INC	8,400	874,860.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,900	377,383.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	16,182	221,531.580	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6,600	93,390.000	
PARAMOUNT GROUP INC	36,300	479,886.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25,700	365,197.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	19,800	871,398.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	21,100	454,916.000	
STAG INDUSTRIAL INC	22,600	657,434.000	
VENTAS INC	66,579	5,008,738.170	
CARETRUST REIT INC	17,203	416,656.660	
GEO GROUP INC/THE	20,900	370,766.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	53,700	1,033,725.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,700	217,987.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,887	720,883.040	
UMH PROPERTIES INC	5,600	73,920.000	
IRON MOUNTAIN INC	51,700	1,708,685.000	
TERRENO REALTY CORP	11,400	580,944.000	
VEREIT INC	175,408	1,694,441.280	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	15,720	749,844.000	
SUN COMMUNITIES INC	16,300	2,437,013.000	
ACADIA REALTY TRUST	14,911	422,577.740	
ALEXANDER'S INC	700	271,047.000	
PROLOGIS INC	113,702	9,640,792.580	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,400	3,123,444.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	30,300	440,259.000	
SAUL CENTERS INC	1,700	87,499.000	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	23,174.450	
MACK-CALI REALTY CORP	15,600	328,692.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	17,400	1,930,530.000	
COUSINS PROPERTIES INC	26,206	915,899.700	
SITE CENTERS CORP	24,078	343,593.060	
DUKE REALTY CORP	64,800	2,159,136.000	

EASTGROUP PROPERTIES INC	6,600	828,498.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,867	3,881,221.020	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22,800	884,868.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	13,500	1,812,105.000	
GETTY REALTY CORP	5,703	181,640.550	
WELLTOWER INC	73,000	6,671,470.000	
HCP INC	86,100	3,063,438.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	18,700	815,133.000	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	29,600	737,040.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,300	782,880.000	
EQUITY COMMONWEALTH	21,975	742,755.000	
KILROY REALTY CORP	18,200	1,416,324.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	26,700	1,348,083.000	
LTC PROPERTIES INC	7,200	359,568.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	37,700	375,115.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,528	2,644,416.960	
MACERICH CO/THE	19,100	576,820.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,200	2,190,888.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,800	652,860.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	29,300	1,637,870.000	
REALTY INCOME CORP	56,717	4,307,656.150	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,300	564,139.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	44,118.000	
PUBLIC STORAGE	27,000	6,952,500.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,600	650,376.000	
REGENCY CENTERS CORP	30,120	2,015,630.400	
RPT REALTY	13,800	176,088.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,100	228,463.000	
SL GREEN REALTY CORP	15,200	1,229,680.000	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	41,000	357,520.000	
TAUBMAN CENTERS INC	10,500	421,365.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,400	98,604.000	
UDR INC	50,800	2,485,644.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,200	212,212.000	
WP CAREY INC	30,700	2,774,666.000	
WASHINGTON REIT	13,800	373,428.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	21,600	586,656.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,300	33,561.000	
AGREE REALTY CORP	7,400	551,448.000	

	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	38,648	1,603,892.000	
	CUBESMART	34,000	1,223,320.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	41,226	547,481.280	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	37,578	4,833,282.360	
	CEDAR REALTY TRUST INC	10,800	26,244.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	23,000	2,754,020.000	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,275	74,588.500	
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,060	148,031.600	
	KITE REALTY GROUP TRUST	13,350	202,119.000	
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	17,000	227,800.000	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	58,740.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	24,700	1,169,792.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,700	106,361.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	36,342	355,788.180	
	NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	8,049	136,591.530	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	79,200	1,522,224.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,300	124,695.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	29,100	1,232,385.000	
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	36,800	430,928.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	229,527	208,869.570	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 168,423,499.480 (18,012,893,270)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	413,930	296,787.810	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	59,270	9,151.280	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	86,570	80,077.250	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,170	93,618.830	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	88,110	76,479.480	
	REGIONAL REIT LTD	81,310	84,399.780	
	NEWRIVER REIT PLC	46,330	79,316.960	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	100,490	83,406.700	
	LXI REIT PLC	94,038	123,942.080	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54,330	48,353.700	
	RDI REIT PLC	41,036	43,498.160	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	134,401	1,042,682.950	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	90,790	86,795.240	
	SEGRO PLC	194,010	1,532,290.980	

	HAMMERSON PLC	133,920	327,568.320	
	UNITE GROUP PLC	50,520	525,408.000	
	BRITISH LAND CO PLC	172,640	894,620.480	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	48,331	338,800.310	
	INTU PROPERTIES PLC	145,670	53,169.550	
	DERWENT LONDON PLC	19,520	610,195.200	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	192,040	262,326.640	
	WORKSPACE GROUP PLC	24,460	215,614.900	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	36,390	241,993.500	
	SHAFTESBURY PLC	41,230	349,011.950	
	BIG YELLOW GROUP PLC	27,810	295,898.400	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	141,340	294,552.560	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	76,600	42,896.000	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	296,770	419,929.550	
イギリス・ボンド 小計			イギリス・ボンド 8,552,786.560 (1,123,151,931)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	28,840	イスラエル・シュケル 582,568.000	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 582,568.000 (17,680,938)	
オーストラリ ア・ドル			オーストラリア・ドル	
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	47,520	177,249.600	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	338,284	421,163.580	
	RURAL FUNDS GROUP	50,595	100,178.100	
	VIVA ENERGY REIT	76,330	219,067.100	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	58,995	343,350.900	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	165,160	426,112.800	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	45,547	198,584.920	
	NATIONAL STORAGE REIT	135,195	244,702.950	
	APN INDUSTRIA REIT	11,760	34,339.200	
	GDI PROPERTY GROUP	83,310	128,297.400	
	SCENTRE GROUP	980,790	3,903,544.200	
	ARENA REIT	42,890	121,378.700	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,300	75,402.000	
	BWP TRUST	90,550	354,050.500	
	DEXUS	199,600	2,520,948.000	

	GPT GROUP	354,900	2,228,772.000	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	59,400	254,232.000	
	MIRVAC GROUP	729,040	2,238,152.800	
	STOCKLAND	448,450	1,986,633.500	
	ABACUS PROPERTY GROUP	64,120	253,274.000	
	GOODMAN GROUP	295,230	4,038,746.400	
	VICINITY CENTRES	591,950	1,533,150.500	
	CHARTER HALL GROUP	82,960	1,002,156.800	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	40,460	158,603.200	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 22,962,091.150 (1,679,676,968)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13,100	163,357.000	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	18,400	265,880.000	
	SLATE RETAIL REIT - U	3,100	39,525.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,700	154,924.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	29,682.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,200	27,840.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	10,200	118,932.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	10,700	138,565.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,200	27,762.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,600	296,010.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	9,400	119,098.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,400	164,008.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	27,400	386,340.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	82,236.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,000	118,480.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,600	402,948.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,100	755,055.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16,790	209,371.300	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	25,866	585,347.580	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	27,100	702,974.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	149,310.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,700	162,726.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4,900	144,403.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,500	102,570.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,200	534,990.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル	



			5,882,333.880 (477,527,864)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	178,628	317,957.840	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	81,200	86,072.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	400,100	536,134.000	
	AIMS APAC REIT	89,000	129,940.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	121,800	86,478.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	271,650	334,129.500	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	514,575	1,116,627.750	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	473,100	1,485,534.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	509,000	1,359,030.000	
	SUNTEC REIT	419,400	813,636.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	414,700	646,932.000	
	KEPPEL REIT	343,400	429,250.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	129,960	213,134.400	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	213,600	279,816.000	
	ESR-REIT	364,337	187,633.550	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	130,600	212,878.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	114,968	317,311.680	
	STARHILL GLOBAL REIT	243,800	186,507.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	117,396	184,311.720	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,300	212,751.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	267,200	61,456.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	247,980	580,273.200	
	CACHE LOGISTICS TRUST	174,500	128,257.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	336,400	753,536.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182,100	124,738.500	
	SPH REIT	124,600	137,060.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	112,100	60,534.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	124,400	55,980.000	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	148,900	160,812.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	226,663	118,998.070	
シンガポール・ドル	小計		シンガポール・ドル 11,317,709.710 (875,877,555)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	71,480	169,407.600	

	ARGOSY PROPERTY LTD	158,520	239,365.200	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	273,920	462,924.800	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	56,800	160,176.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	188,250	417,915.000	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	190,240	358,602.400	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 1,808,391.000 (124,326,881)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26,600	405,118.000	
	HAMBORNER REIT AG	11,980	112,600.020	
	WERELDHAVE NV	6,470	119,953.800	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,710	2,844,014.500	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	6,530	153,585.600	
	NSI NV	3,231	127,462.950	
	VASTNED RETAIL NV	2,450	67,865.000	
	ICADE	7,690	616,353.500	
	ALTAREA	540	99,900.000	
	GECINA SA	9,351	1,311,010.200	
	KLEPIERRE	34,830	971,408.700	
	COVIVIO	11,252	1,083,005.000	
	MERCIALYS	8,070	88,124.400	
	AEDIFICA	4,144	445,065.600	
	COFINIMMO	4,070	522,588.000	
	BEFIMMO	3,720	200,508.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,310	86,722.000	
	RETAIL ESTATES	1,140	95,760.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,920	499,320.000	
	MONTEA	1,650	125,235.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	34,382.400	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	71,604.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	46,773	495,793.800	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	61,780	743,831.200	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	58,050	98,917.200	
	GREEN REIT PLC	111,570	212,429.280	
	HIBERNIA REIT PLC	116,240	173,430.080	
ユーロ 小計			ユーロ 11,805,988.230 (1,390,627,354)	
韓国・ウォン			韓国・ウォン	

	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	48,060,000.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 48,060,000.000 (4,310,981)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	227,000	1,200,830.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193,000	1,040,270.000	
	FORTUNE REIT	265,000	2,472,450.000	
	PROSPERITY REIT	195,000	575,250.000	
	LINK REIT	387,500	34,623,125.000	
	CHAMPION REIT	375,000	1,957,500.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 41,869,425.000 (571,098,957)	
投資証券 合計			24,277,172,699 [24,277,172,699]	
合計			24,455,074,398 [24,455,074,398]	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 1銘柄 受益証券 投資証券 155銘柄	1.0%	99.0%	74.3%
イギリス・ポンド	投資証券 28銘柄	-%	100%	4.6%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 24銘柄	-%	100%	6.9%
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	2.0%
シンガポール・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	3.6%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	100%	5.7%
韓国・ウォン	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.0%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	2.3%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

(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（2019年9月10日から2020年3月9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】

## iFree 8資産バランス

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2020年3月9日現在
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	235,303,063
親投資信託受益証券	18,161,594,018
流動資産合計	18,396,897,081
資産合計	18,396,897,081
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	19,249,653
未払受託者報酬	1,982,783
未払委託者報酬	19,828,170
その他未払費用	744,841
流動負債合計	41,805,447
負債合計	41,805,447
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	15,981,955,306
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,373,136,328
（分配準備積立金）	661,568,023
元本等合計	18,355,091,634
純資産合計	18,355,091,634
負債純資産合計	18,396,897,081

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年9月10日 至 2020年3月9日
<b>営業収益</b>	
受取利息	287
有価証券売買等損益	1,147,634,414
営業収益合計	1,147,634,127
<b>営業費用</b>	
支払利息	40,568
受託者報酬	1,982,783
委託者報酬	19,828,170
その他費用	744,986
営業費用合計	22,596,507
営業利益又は営業損失（ ）	1,170,230,634
経常利益又は経常損失（ ）	1,170,230,634
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,170,230,634
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	64,486,284
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,721,726,160
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,241,272,361
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,241,272,361
剰余金減少額又は欠損金増加額	355,145,275
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	355,145,275
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,373,136,328

## (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 2019年9月10日 至 2020年3月9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 2020年3月9日現在
1. 1 期首元本額	12,911,568,998円
期中追加設定元本額	4,701,859,263円
期中一部解約元本額	1,631,472,955円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	15,981,955,306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 2019年9月10日 至 2020年3月9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 2020年3月9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 2020年3月9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 2020年3月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1485円 (11,485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、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券及び「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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

	2020年3月9日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	20,387,888,587

株式	3 4	125,623,418,367
未収配当金		241,490,306
未収利息		1,700,581
前払金		626,472,400
その他未収収益	5	40,503,085
差入委託証拠金		38,475,000
流動資産合計		146,959,948,326
資産合計		146,959,948,326
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		966,251,400
未払解約金		4,423,400
受入担保金		15,166,713,817
流動負債合計		16,137,388,617
負債合計		16,137,388,617
純資産の部		
元本等		
元本	1	144,531,505,625
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	13,708,945,916
元本等合計		130,822,559,709
純資産合計		130,822,559,709
負債純資産合計		146,959,948,326

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年3月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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、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	2020年3月9日現在
1. 1 期首	2019年9月10日
期首元本額	144,845,005,615円
期中追加設定元本額	20,423,772,903円
期中一部解約元本額	20,737,272,893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	3,506,958,157円
ファンド	
ダイワ・トピックス・イン	7,269,241,393円
デックスファンドVA	
適格機関投資家専用・ダイ	2,683,766円
ワ・トピックスインデックス	
ファンドVA2	
ダイワ国内重視バランスファ	55,171,187円
ンド30VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国内重視バランスファ	733,017,407円
ンド50VA(一般投資家私	
募)	

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	39,854,351円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	1,080,957,277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)	77,167,811円
D-I's TOPIXイン デックス	55,624,140円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	15,866,733円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	15,911,256円
iFree TOPIXイン デックス	1,531,630,846円
iFree 8資産バランス	2,356,246,820円
iFree 年金バランス	79,054,554円
DCダイワ日本株式インデッ クス	64,612,864,359円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,808,667,732円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,363,259,042円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,128,157,727円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,827,523,250円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	14,659,767円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	59,002,657円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	32,932,875円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	494,571,307円
ダイワつみたてインデックス バランス30	10,425,143円
ダイワつみたてインデックス バランス50	7,108,288円

	ダイワつみたてインデックス バランス70	9,623,869円
	ダイワ世界バランスファンド 40VA	164,825,308円
	ダイワ世界バランスファンド 60VA	171,203,604円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	8,309,136,430円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	717,530,306円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	111,646,037円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	204,115,303円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	163,822,948円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,942,364,144円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	9,819,435,353円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,625,649,297円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX	1,315,799,757円
	ダイワライフスタイル25	183,296,162円
	ダイワライフスタイル50	655,481,281円
	ダイワライフスタイル75	532,620,086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)	12,426,397,895円
	計	144,531,505,625円
2.	期末日における受益権の総数	144,531,505,625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13,708,945,916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 13,353,978,610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 470,560,000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37,701,328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	2020年3月9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	2020年3月9日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	6,218,317,400	-	5,252,275,000	966,042,400

合計	6,218,317,400	-	5,252,275,000	966,042,400
----	---------------	---	---------------	-------------

## (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)

	2020年3月9日現在
1口当たり純資産額	0.9051円
(1万口当たり純資産額)	(9,051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

	2020年3月9日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	412,076,045
コール・ローン	4,861,360,790
株式	112,131,146,920
投資証券	3,577,849,175
未収入金	5,478,040
未収配当金	244,560,141
差入委託証拠金	1,752,437,916
流動資産合計	122,984,909,027
資産合計	122,984,909,027
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	946,019,735
未払金	9,044,730

未払解約金		9,641,100
流動負債合計		964,705,565
負債合計		964,705,565
純資産の部		
元本等		
元本	1	50,713,684,066
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		71,306,519,396
元本等合計		122,020,203,462
純資産合計		122,020,203,462
負債純資産合計		122,984,909,027

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年3月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p>



	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年3月9日現在
1. 1 期首	2019年9月10日
期首元本額	47,561,732,616円
期中追加設定元本額	9,157,288,825円
期中一部解約元本額	6,005,337,375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	444,561,956円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	10,592,212円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	118,413,041円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	14,936,622円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	409,549,480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)	13,424,117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)	558,708,188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)	2,119,731,079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 エマーシングプラス(為替 ヘッジなし)	542,272,466円
D-I's 外国株式インデッ クス	4,820,000円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	4,127,927円

i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	1,334,216,728円
i F r e e 8資産バランス	883,839,879円
i F r e e 年金バランス	29,293,219円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	30,396,470,017円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	539,160,562円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	865,493,279円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	665,517,040円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,496,751,433円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,045,880円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	14,031,995円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	7,046,239円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	253,328,702円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	1,982,578円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	1,774,103円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	2,001,519円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	184,484,718円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	319,060,960円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	2,399,105,741円
ダイワ・バランスファンド2 5 V A(適格機関投資家専 用)	117,767,403円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	720,382,272円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	138,719,104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)	3,277,180,209円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,689,923,697円
ダイワライフスタイル25	17,195,365円
ダイワライフスタイル50	63,834,390円
ダイワライフスタイル75	50,939,946円
計	50,713,684,066円
2. 期末日における受益権の総数	50,713,684,066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	2020年3月9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	2020年3月9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	7,228,214,570	-	6,513,322,510	714,892,060
合計	7,228,214,570	-	6,513,322,510	714,892,060

## (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	2020年3月9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	5,043,361,775	-	4,812,234,100	231,127,675
アメリカ・ドル	3,729,805,490	-	3,544,728,000	185,077,490
イギリス・ポンド	181,856,105	-	175,731,600	6,124,505
オーストラリア・ドル	108,559,865	-	104,392,500	4,167,365
カナダ・ドル	204,235,015	-	190,918,500	13,316,515
スイス・フラン	156,678,915	-	153,496,000	3,182,915
ユーロ	662,226,385	-	642,967,500	19,258,885
合計	5,043,361,775	-	4,812,234,100	231,127,675

## (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)

	2020年3月9日現在
1口当たり純資産額	2.4061円
(1万口当たり純資産額)	(24,061円)

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年3月9日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	47,890,377
コール・ローン	176,284,772
株式	6,507,624,433
投資証券	825,200,347
未収配当金	13,457,633
差入委託証拠金	46,133,587
流動資産合計	7,616,591,149
資産合計	7,616,591,149
負債の部	
流動負債	

派生商品評価勘定		25,620,535
未払解約金		600,000
流動負債合計		26,220,535
負債合計		26,220,535
純資産の部		
元本等		
元本	1	5,613,563,956
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,976,806,658
元本等合計		7,590,370,614
純資産合計		7,590,370,614
負債純資産合計		7,616,591,149

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年3月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>



## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年3月9日現在
1. 1 期首	2019年9月10日
期首元本額	5,076,199,923円
期中追加設定元本額	813,248,539円
期中一部解約元本額	275,884,506円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
新興国株式インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投 資家専用）	15,720,580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）	244,203,425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）	237,021,626円
D - I ' s 新興国株式イン デ ッ ク ス	99,653,776円
i F r e e 新興国株式イン デ ッ ク ス	2,035,758,020円
i F r e e 8 資産バランス	1,578,446,572円
D C ダイワ新興国株式ファン ダ メ ン タ ル ・ イン デ ッ ク ス ファン ド	966,177,570円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国株式	364,962,952円
ダイワ・ノーロード 新興 国 株 式 ファン ド	71,619,435円
計	5,613,563,956円
2. 期末日における受益権の総数	5,613,563,956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	2020年3月9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	2020年3月9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	267,660,468	-	249,299,688	18,360,780
合計	267,660,468	-	249,299,688	18,360,780

#### (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	2020年3月9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	149,877,755	-	142,618,000	7,259,755
アメリカ・ドル	149,877,755	-	142,618,000	7,259,755
合計	149,877,755	-	142,618,000	7,259,755

## (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)

	2020年3月9日現在
1口当たり純資産額	1.3521円
(1万口当たり純資産額)	(13,521円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

	2020年3月9日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		156,963,215
国債証券		18,564,605,060
地方債証券		1,475,810,500
特殊債券		635,609,600
社債券		842,847,900
未収利息		54,366,342
前払費用		1,958,747
流動資産合計		21,732,161,364
資産合計		21,732,161,364
負債の部		
流動負債		
未払解約金		17,992,911
流動負債合計		17,992,911
負債合計		17,992,911
純資産の部		
元本等		
元本	1	16,444,508,551
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,269,659,902
元本等合計		21,714,168,453
純資産合計		21,714,168,453
負債純資産合計		21,732,161,364

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年3月9日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

個別法に基づき、時価で評価しております。

時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年3月9日現在
1. 1 期首	2019年9月10日
期首元本額	14,329,790,025円
期中追加設定元本額	2,413,727,280円
期中一部解約元本額	299,008,754円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
日本債券インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	176,914,400円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,258,905円
i F r e e 日本債券イン デックス	123,023,830円
i F r e e 8 資産バランス	1,949,479,094円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	6,450,841,002円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,738,472,894円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,152,363,445円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 安定コース）	956,895,352円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 6 分散コー ス）	741,452,500円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 成長コース）	236,866,352円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	55,938,570円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	60,133,674円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	10,729,355円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	265,811,955円
ダイワつみたてインデックス バランス30	21,375,124円
ダイワつみたてインデックス バランス50	7,113,549円
ダイワつみたてインデックス バランス70	3,209,202円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	303,393,298円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	189,236,050円
計	16,444,508,551円
2. 期末日における受益権の総数	16,444,508,551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	2020年3月9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

2020年3月9日現在
該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

2020年3月9日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3205円 (13,205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

	2020年3月9日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		293,296,190
コール・ローン		2,297,342,259
国債証券		191,969,053,445
未収入金		50,813
未収利息		1,213,927,125
前払費用		48,684,361
流動資産合計		195,822,354,193
資産合計		195,822,354,193
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		110,545,605
未払金		278,037,089
未払解約金		43,460,930
流動負債合計		432,043,624
負債合計		432,043,624
純資産の部		
元本等		
元本	1	68,420,350,659
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		126,969,959,910
元本等合計		195,390,310,569
純資産合計		195,390,310,569
負債純資産合計		195,822,354,193

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年3月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年3月9日現在
1. 1 期首	2019年9月10日



期首元本額	64,884,126,052円
期中追加設定元本額	6,070,317,875円
期中一部解約元本額	2,534,093,268円

期末元本額の内訳

ファンド名

ダイワ外国債券インデックス V A	643,995,821円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	20,970,536円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	118,474,097円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	35,101,840円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	404,579,002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)	46,822,182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)	487,325,065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)	1,762,930,342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)	810,017,022円
D-I's 外国債券インデッ クス	908,327円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	563,068円
iFree 外国債券イン デックス	631,235,355円
iFree 8資産バランス	872,832,778円
iFree 年金バランス	16,841,910円

DCダイワ外国債券インデックス	46,439,749,670円
ダイワ・ライフ・バランス30	787,394,111円
ダイワ・ライフ・バランス50	419,657,888円
ダイワ・ライフ・バランス70	257,839,377円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	428,161,811円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	331,721,818円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	105,900,537円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	9,971,614円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	19,669,274円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,797,868円
ダイワつみたてインデックス外国債券	106,346,689円
ダイワつみたてインデックスバランス30	2,604,970円
ダイワつみたてインデックスバランス50	792,329円
ダイワつみたてインデックスバランス70	714,989円
ダイワ世界バランスファンド40VA	189,878,728円
ダイワ世界バランスファンド60VA	140,997,039円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,738,003,992円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	274,899,534円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	144,750,306円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	32,947,539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)	2,271,913,444円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,747,327,092円
ダイワライフスタイル25	33,730,529円
ダイワライフスタイル50	62,176,291円
ダイワライフスタイル75	16,805,875円
計	68,420,350,659円
2. 期末日における受益権の総数	68,420,350,659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	2020年3月9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	2020年3月9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	2,561,163,365	-	2,450,617,760	110,545,605

アメリカ・ドル	1,128,283,191	-	1,072,537,580	55,745,611
イギリス・ポンド	88,463,080	-	84,439,440	4,023,640
オーストラリア・ドル	28,021,851	-	26,966,600	1,055,251
カナダ・ドル	31,348,958	-	29,973,600	1,375,358
ノルウェー・クローネ	39,580,891	-	36,628,200	2,952,691
ポーランド・ズロチ	34,764,494	-	33,710,970	1,053,524
メキシコ・ペソ	13,898,299	-	12,332,120	1,566,179
ユーロ	1,156,186,361	-	1,117,373,250	38,813,111
南アフリカ・ランド	40,616,240	-	36,656,000	3,960,240
合計	2,561,163,365	-	2,450,617,760	110,545,605

## (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)

	2020年3月9日現在
1口当たり純資産額	2.8557円
(1万口当たり純資産額)	(28,557円)

## 「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年3月9日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		127,235,078
コール・ローン		224,080,122
国債証券		14,309,623,987
派生商品評価勘定		312,000
未収入金		689,535
未収利息		200,189,099
前払費用		17,266,829
流動資産合計		14,879,396,650
資産合計		14,879,396,650
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		13,115,699
未払金		62,978,988
その他未払費用		18,123
流動負債合計		76,112,810
負債合計		76,112,810
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,322,749,601
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,480,534,239
元本等合計		14,803,283,840
純資産合計		14,803,283,840
負債純資産合計		14,879,396,650

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年3月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年3月9日現在
1. 1 期首	2019年9月10日
期首元本額	10,015,179,396円
期中追加設定元本額	1,663,504,919円
期中一部解約元本額	355,934,714円

期末元本額の内訳	
ファンド名	
新興国債券インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	37,274,454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）	254,877,121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）	416,760,202円
D - I ' s 新興国債券インデックス	50,920,537円
i F r e e 新興国債券インデックス	2,751,125,109円
i F r e e 8資産バランスDCダイワ新興国債券インデックスファンド	1,754,135,721円
5,851,583,405円	
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	168,881,604円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	37,191,448円
計	11,322,749,601円
2. 期末日における受益権の総数	11,322,749,601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	2020年3月9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	2020年3月9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	251,096,319	-	238,292,620	12,803,699
インドネシア ・ルピア	28,488,000	-	28,800,000	312,000
チェコ・コル ナ	22,658,880	-	21,840,000	818,880
トルコ・リラ	33,865,800	-	33,060,000	805,800
ハンガリー・ フォリント	17,500,119	-	17,020,690	479,429
ポーランド・ ズロチ	46,048,932	-	44,434,400	1,614,532
メキシコ・ペ ソ	88,865,700	-	79,860,000	9,005,700
ルーマニア・ レイ	13,668,888	-	13,277,530	391,358
合計	251,096,319	-	238,292,620	12,803,699

(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)

	2020年3月9日現在
1口当たり純資産額	1.3074円
(1万口当たり純資産額)	(13,074円)

「ダイワ」- REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年3月9日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,907,985,879
投資証券	2	354,478,905,660
派生商品評価勘定		25,069,400
未収配当金		4,788,983,359
前払金		400,632,000
差入委託証拠金		9,565,000
流動資産合計		365,611,141,298
資産合計		365,611,141,298
負債の部		
流動負債		
未払金		4,609,797,313
未払解約金		34,732,000
流動負債合計		4,644,529,313

負債合計		4,644,529,313
純資産の部		
元本等		
元本	1	121,717,973,065
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		239,248,638,920
元本等合計		360,966,611,985
純資産合計		360,966,611,985
負債純資産合計		365,611,141,298

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年3月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年3月9日現在
-----	-------------

1.	1 期首	2019年9月10日
	期首元本額	104,354,428,940円
	期中追加設定元本額	24,499,689,889円
	期中一部解約元本額	7,136,145,764円
	期末元本額の内訳	
	ファンド名	
	ダイワJ-REITオープン	5,687,050,861円
	ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	105,369,779,076円
	ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	291,819,607円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	622,653円
	iFree J-REITイ ンデックス	128,190,164円
	iFree 8資産バランス	746,007,633円
	DC・ダイワJ-REIT オープン	5,051,994,892円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,156,646円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,004,313円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	2,217,240円
	ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	84,083,731円
	ダイワファンドラップ J- REITインデックス	1,432,844,675円
	ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	1,435,725,550円
	ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	356,505,977円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,123,970,047円
	計	121,717,973,065円
2.	期末日における受益権の総数	121,717,973,065口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。

## （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	2020年3月9日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種 類	2020年3月9日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	6,168,572,000	-	6,194,000,000	25,428,000
合計	6,168,572,000	-	6,194,000,000	25,428,000

## （注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2020年3月9日現在
1口当たり純資産額	2.9656円
(1万口当たり純資産額)	(29,656円)

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年3月9日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	81,409,151
コール・ローン	616,818,716
投資信託受益証券	328,348,257
投資証券	26,391,586,871
未収入金	1,809,626
未収配当金	25,608,415
差入委託証拠金	119,103,639
流動資産合計	27,564,684,675
資産合計	27,564,684,675
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	54,466,261
未払金	102,923,743
未払解約金	210,360
流動負債合計	157,600,364
負債合計	157,600,364
純資産の部	
元本等	
元本	1 11,935,306,984
剰余金	

期末剰余金又は期末欠損金( )	15,471,777,327
元本等合計	27,407,084,311
純資産合計	27,407,084,311
負債純資産合計	27,564,684,675

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年3月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年3月9日現在
1. 1 期首	2019年9月10日
期首元本額	10,095,442,480円
期中追加設定元本額	2,704,882,359円
期中一部解約元本額	865,017,855円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	5,314,986,232円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	884,316,365円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	340,341,359円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	237,669,160円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,616,935円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	683,542円
iFree 外国REITイ ンデックス	99,145,310円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	956,136,958円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	386,177円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	2,334,794,634円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,782,494円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,473,307円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	2,499,495円



ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	242,495,825円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	36,524,728円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	1,261,134,143円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	212,934,143円
計	11,935,306,984円
2. 期末日における受益権の総数	11,935,306,984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	2020年3月9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. 不動産投信関連

種 類	2020年3月9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				

不動産投信 指数先物取引				
買 建	745,902,973	-	718,821,790	27,081,183
合計	745,902,973	-	718,821,790	27,081,183

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2020年3月9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	650,261,478	-	622,876,400	27,385,078
アメリカ・ドル	438,150,107	-	416,663,400	21,486,707
ユーロ	212,111,371	-	206,213,000	5,898,371
合計	650,261,478	-	622,876,400	27,385,078

(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)

	2020年3月9日現在
1口当たり純資産額	2.2963円
(1万口当たり純資産額)	(22,963円)

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2020年2月28日

資産総額	19,553,022,120円
負債総額	88,110,073円
純資産総額（ - ）	19,464,912,047円
発行済数量	15,951,054,523口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.2203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

2020年2月28日

資産総額	155,481,596,434円
負債総額	14,786,069,867円
純資産総額（ - ）	140,695,526,567円
発行済数量	142,921,933,446口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9844円

## (参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

2020年2月28日

資産総額	378,702,355,995円
負債総額	3,112,692,600円
純資産総額（ - ）	375,589,663,395円
発行済数量	120,087,868,676口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.1276円

## (参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

## 純資産額計算書

2020年2月28日

資産総額	21,730,893,057円
負債総額	1,764,551円
純資産総額（ - ）	21,729,128,506円
発行済数量	16,492,752,888口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3175円

## (参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2020年2月28日

資産総額	8,396,789,827円
負債総額	17,712,112円
純資産総額（ - ）	8,379,077,715円
発行済数量	5,561,245,048口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.5067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

2020年2月28日

資産総額	133,112,141,757円
負債総額	2,241,253,559円
純資産総額（ - ）	130,870,888,198円
発行済数量	50,125,688,154口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.6109円

## (参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2020年2月28日

資産総額	28,636,048,559円
負債総額	82,847,222円
純資産総額（ - ）	28,553,201,337円
発行済数量	11,620,281,512口

1 単位当たり純資産額 ( / ) 2.4572円

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2020年2月28日

資産総額	15,936,443,987円
負債総額	63,154,904円
純資産総額 ( - )	15,873,289,083円
発行済数量	11,228,446,121口
1 単位当たり純資産額 ( / )	1.4137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

2020年2月28日

資産総額	201,358,364,760円
負債総額	598,170,578円
純資産総額 ( - )	200,760,194,182円
発行済数量	68,115,125,291口
1 単位当たり純資産額 ( / )	2.9474円

#### 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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



## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2020年2月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 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。

##### ハ. 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。

##### ニ. 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

###### ・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。

2020年2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	61	108,088
追加型株式投資信託	695	15,402,833
株式投資信託 合計	756	15,510,921
単位型公社債投資信託	31	107,612
追加型公社債投資信託	14	1,458,225
公社債投資信託 合計	45	1,565,837
総合計	801	17,076,758

## 3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（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。

また、第61期事業年度に係る中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

## (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)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>固定資産</b>		
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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	利益剰余金 合計	
				剰余金 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	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(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、記載を省略していません。

## 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、記載を省略していません。

## (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、記載を省略していません。

## 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。

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (2019年9月30日)	
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		19,529
有価証券		724
未収委託者報酬		11,175
その他		383
流動資産合計		31,812
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	211
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		2,380
その他		403
無形固定資産合計		2,784
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		7,928
関係会社株式		2,664
繰延税金資産		1,205
その他		1,280
投資その他の資産合計		13,078
固定資産合計		16,073
資産合計		47,886

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2019年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	6,021
未払費用	3,486
未払法人税等	754
賞与引当金	506
その他	2 474
流動負債合計	11,243
固定負債	
退職給付引当金	2,483
役員退職慰労引当金	128
その他	7
固定負債合計	2,619
負債合計	13,862
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,968
利益剰余金合計	7,343
株主資本合計	34,013
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	10
評価・換算差額等合計	10
純資産合計	34,023
負債・純資産合計	47,886

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

当中間会計期間

(自 2019年4月1日

至 2019年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		35,076
その他営業収益		309
営業収益合計		35,385
営業費用		
支払手数料		15,895
その他営業費用		6,272
営業費用合計		22,167
一般管理費	1	5,954
営業利益		7,263
営業外収益	2	968
営業外費用	3	148
経常利益		8,083
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		8,083
法人税、住民税及び事業税		2,313
法人税等調整額		15
中間純利益		5,785

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868



中間純利益	-	-	-	5,785	5,785	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	6,083	6,083	6,083
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,968	7,343	34,013

	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	46	46	40,142
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
中間純利益	-	-	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	35	35	35
当中間期変動額合計	35	35	6,118
当中間期末残高	10	10	34,023

## 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）子会社及び関連会社株式

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

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

###### 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

### (2) 無形固定資産

定額法によっております。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、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (中間貸借対照表関係)

### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2019年9月30日現在)
有形固定資産	310百万円

### 2 消費税等の取扱い

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

### 3 保証債務

当中間会計期間（2019年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,639百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
有形固定資産	14百万円
無形固定資産	472百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
受取配当金	901百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
有価証券償還損	71百万円
為替差損	68百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

2019年6月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年3月31 日	2019年6月24日
----------------------	------	--------	-------	----------------	------------

(金融商品関係)

当中間会計期間(2019年9月30日)

#### 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金・預金	19,529	19,529	-
(2)未収委託者報酬	11,175	11,175	-
(3)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,986	7,986	-
資産合計	38,691	38,691	-
(1)未払金	(5,965)	(5,965)	-
(2)未払費用(*2)	(2,867)	(2,867)	-
負債合計	(8,833)	(8,833)	-

(\*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・預金及び(2)未収委託者報酬

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

(3)有価証券及び投資有価証券

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

#### 負 債

(1)未払金及び(2)未払費用

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,836
関連会社株式	827
差入保証金	1,068

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（2019年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,836百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 827百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	66	55	11
（2）その他			
証券投資信託	3,971	3,628	343
小計	4,038	3,683	354
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,947	4,292	344
小計	3,947	4,292	344
合計	7,986	7,975	10

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

[ 関連情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,043.35円
1株当たり中間純利益	2,217.93円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,785
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,785
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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。）。

通常の実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

2020年2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

##### 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	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
岩井コスモ証券株式会社	13,500	
S M B C 日興証券株式会社	10,000	
株式会社 S B I 証券	48,323	
岡三オンライン証券株式会社	2,500	
O K B 証券株式会社	1,500	
auカブコム証券株式会社	7,196	
京銀証券株式会社	3,000	
G M O クリック証券株式会社	4,346	
静岡東海証券株式会社	600	
株式会社証券ジャパン	3,000	
第四北越証券株式会社	600	
立花証券株式会社	6,695	
東海東京証券株式会社	6,000	
西日本シティ T T 証券株式会社	3,000	
百五証券株式会社	3,000	
ほくほく T T 証券株式会社	1,250	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
むさし証券株式会社	5,000	
楽天証券株式会社	7,495	
ワイエム証券株式会社	1,270	
株式会社愛知銀行	18,000	銀行法に基づき銀行業を
株式会社イオン銀行	51,250	
株式会社大垣共立銀行	46,773	

株式会社沖縄銀行	22,725	営んでいます。	
株式会社香川銀行	12,014		
株式会社関西みらい銀行	( ) 38,900		
株式会社北九州銀行	10,000		
株式会社きらやか銀行	22,700		
株式会社高知銀行	19,544		
株式会社佐賀共栄銀行	2,679		
株式会社静岡銀行	90,845		
株式会社静岡中央銀行	2,000		
株式会社島根銀行	6,636		
株式会社清水銀行	10,816		
信金中央金庫	690,998		(注1)
スルガ銀行株式会社	30,043		(注2)
全国信用協同組合連合会	67,275	(注3)	
株式会社大東銀行	14,743	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。	
株式会社但馬銀行	5,481		
株式会社中京銀行	31,844		
株式会社筑波銀行	48,868		
株式会社徳島大正銀行	11,036		
株式会社鳥取銀行	9,061		
株式会社トマト銀行	17,810		
株式会社富山第一銀行	10,182		
株式会社長野銀行	13,017		
株式会社名古屋銀行	25,090		
株式会社西日本シティ銀行	85,745		
株式会社百五銀行	20,000		
株式会社福井銀行	17,965		
株式会社福島銀行	18,127		
株式会社豊和銀行	12,495		
株式会社みちのく銀行	36,986		
株式会社武蔵野銀行	45,743		
株式会社もみじ銀行	10,000		
株式会社山口銀行	10,005		

( ) 資本金の額は、2019年4月1日現在のものです。

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

(注2) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

## 2 【関係業務の概要】

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

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

## 3 【資本関係】

委託会社は、むさし証券株式会社の株式を41,500株所有しております。

### <再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（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。

\*再信託受託会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

## 第3 【その他】

### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

## 独立監査人の監査報告書

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

2019年10月11日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているiFree 8資産バランスの2018年9月8日から2019年9月9日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、iFree 8資産バランスの2019年9月9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11月22日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

(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。



## 独立監査人の中間監査報告書

2020年4月10日

大和アセットマネジメント株式会社

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	深井 康治	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林 英之	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているiFree 8資産バランスの2019年9月10日から2020年3月9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、iFree 8資産バランスの2020年3月9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（2019年9月10日から2020年3月9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

大和アセットマネジメント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。