【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2019年8月29日提出
【計算期間】	第14計算期間 （自　2018年6月6日　至　2019年6月5日）
【ファンド名】	ダイワ・ライフ・バランス５０
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部　【ファンド情報】

第１　【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

（注1）商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

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

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

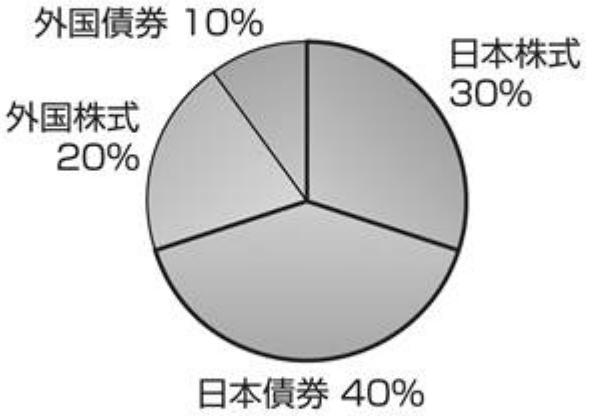
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国　内	海　外	合　計
株　式	30%	20%	50%
債　券	40%	10%	50%
合　計	70%	30%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

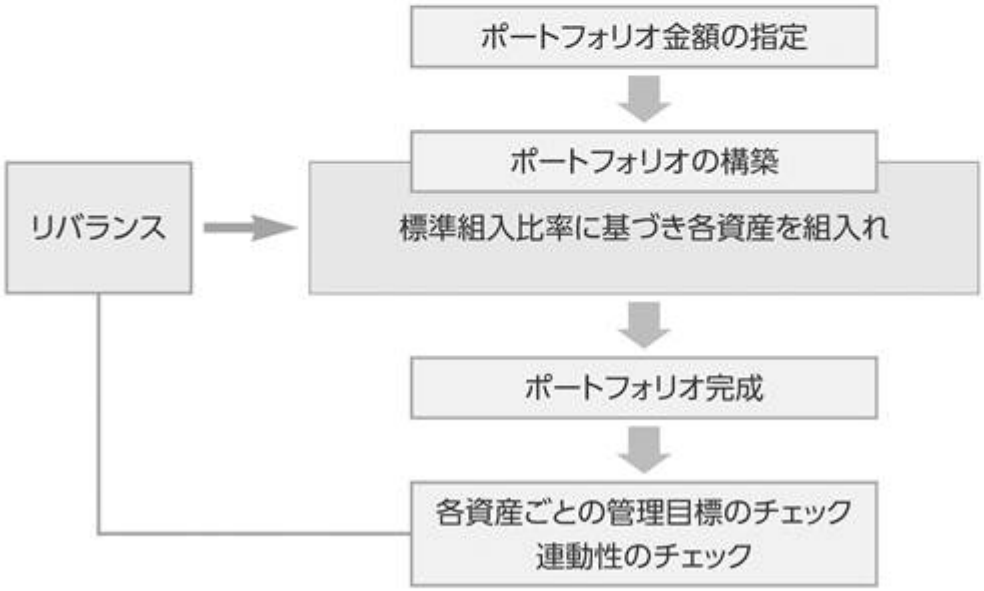
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

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

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

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

3 毎年6月5日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

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

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

各マザーファンドの運用プロセス

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

（注1）リスクモデルとは…
債券のリターンを、国債イールドカーブの変化、種別スプレッドの変化、個別銘柄独自の変化など、リターンに共通の影響を与える複数の要素に分解して説明可能とする計量モデルです。当ファンドでは、NOMURA-BPI総合指数に連動するポートフォリオの構築と、ポートフォリオのリスク特性の管理に用いています。

（注2）層化抽出法とは…
ポートフォリオを残存期間やセクターなどの特性値で分類し、各グループの構成比をベンチマークの構成比に近づけることをめざす手法です。

NOMURA-BPI総合指数とは
NOMURA-BPIは、野村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。

3．外国株式インデックスマザーファンド

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

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

MSCIコクサイ指数とは
MSCIコクサイ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。なお、MSCIコクサイ指数（円ベース）は、MSCIコクサイ指数（米ドルベース）をもとに、MSCI Inc.の承諾を得て委託会社が計算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

4．外国債券インデックスマザーファンド

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

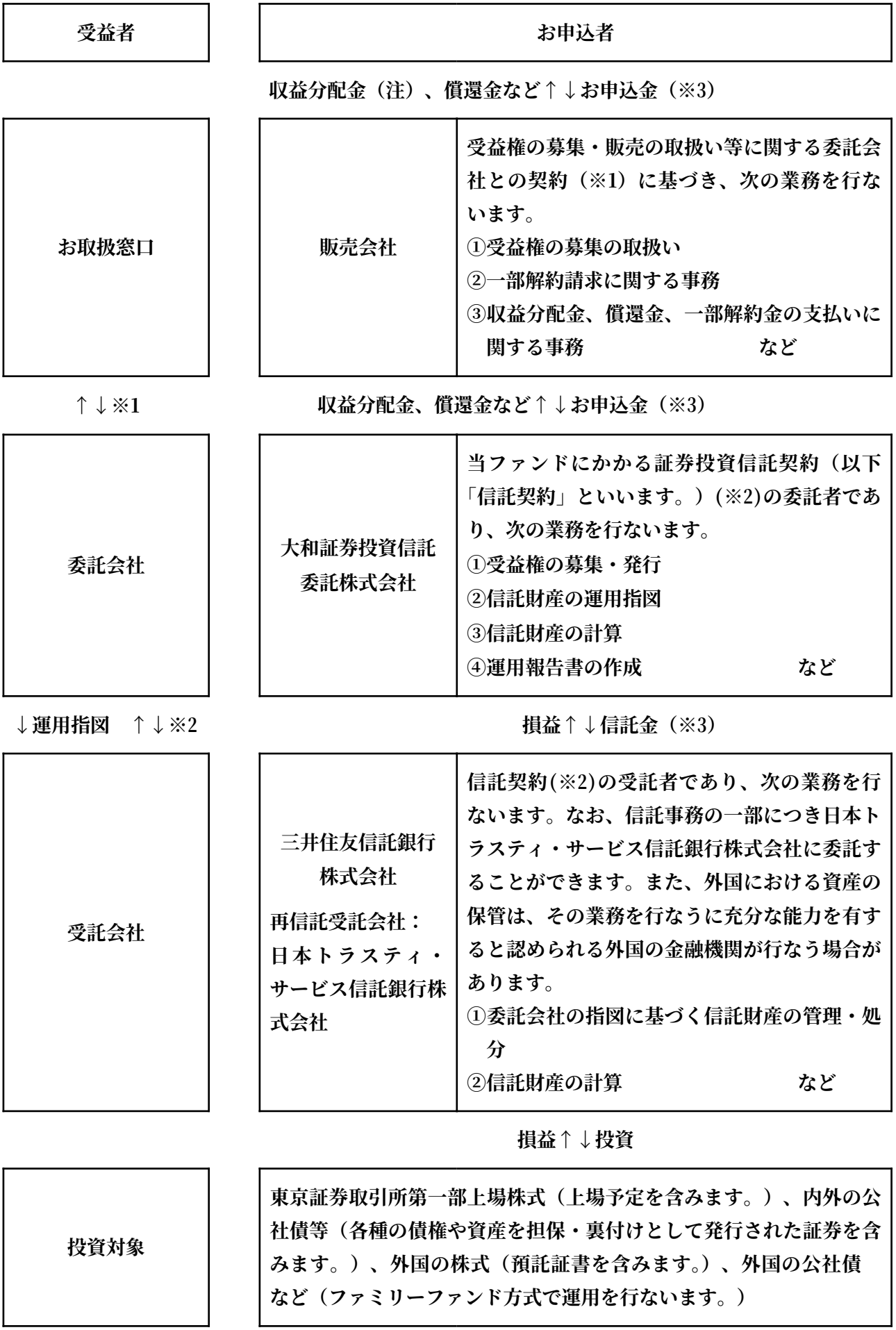
（注）リスクモデルでは、個別債券をキャッシュフロー（利金と償還金）ごとに分解し、ポートフォリオをキャッシュフローの集合体として分析するなどの手法を採用することで、イールドカーブの変化などの債券価格変動要因がポートフォリオの価値に与える影響の測定・管理やポートフォリオの効率的な複製を行なうことなどができます。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2005年6月6日　　信託契約締結、当初設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

＜委託会社の概況（2019年6月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

名　称	住　所	所有株式数	比率
		株	%
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	2,608,525	100.00

2　【投資方針】

(1)　【投資方針】

①　主要投資対象

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

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
（東証株価指数）
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）

3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

（ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース））

4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

② 投資態度

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

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

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の30%

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：信託財産の純資産総額の40%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の10%

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

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

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

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

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

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

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

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

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

(2) 【投資対象】

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑦、⑧および⑨に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　委託会社は、信託金を、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1.から4.までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の5.から24.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

3．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

11．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

12．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

13．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

14．コマーシャル・ペーパー

15．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

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

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

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

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

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

21．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

24．外国の者に対する権利で前23.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

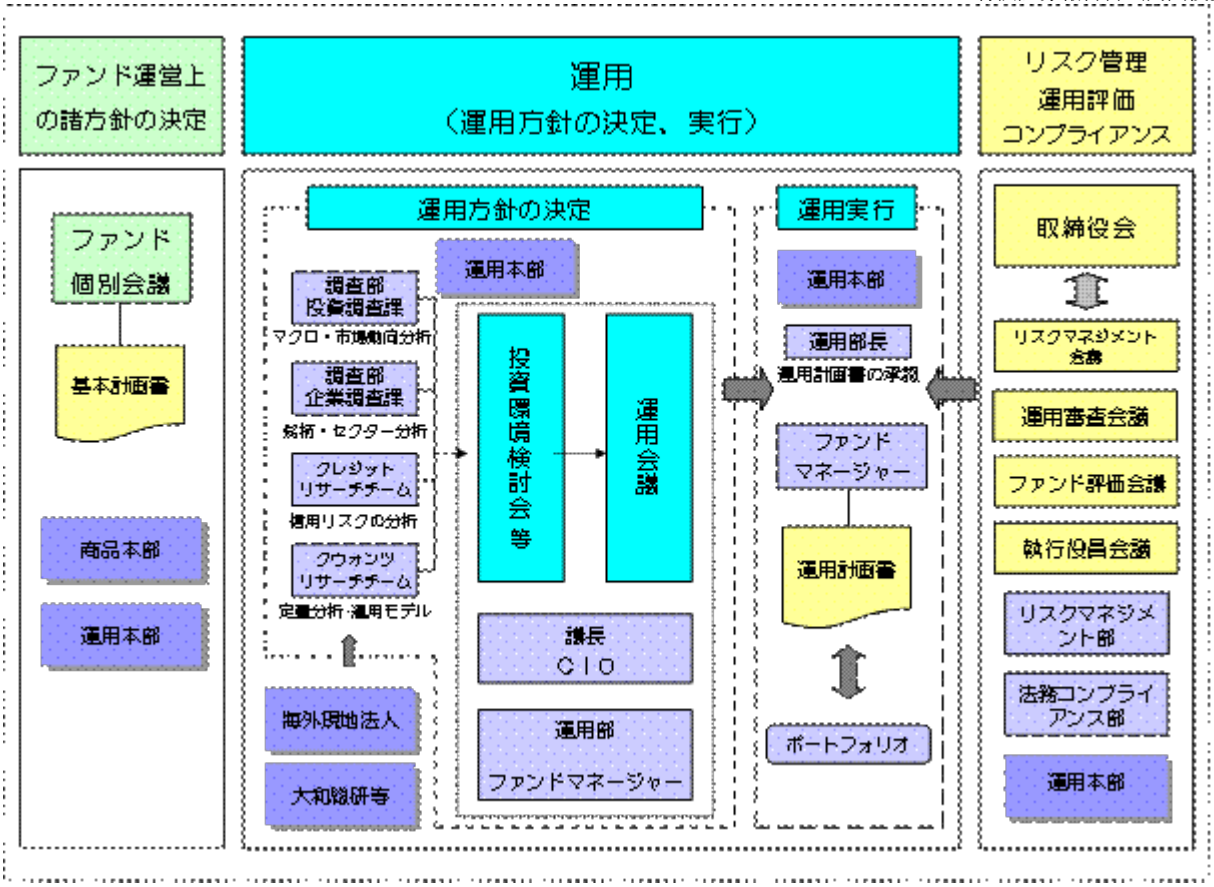
6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3) 【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・ファンド運用に関する組織運営

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）
CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）
CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）
ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー
ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

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

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

イ．ファンド評価会議
運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

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

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

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

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は2019年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
②　原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

① 株式（信託約款）

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

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

② 新株引受権証券等（信託約款）

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

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③ 投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑥　信用取引（信託約款）

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

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

6．信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑦　先物取引等（信託約款）

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

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑧　スワップ取引（信託約款）

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純

資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

⑨　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

⑩　デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑪　同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

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

⑫　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

⑬　外貨建資産（信託約款）

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

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

⑭　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑮　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑯　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。

⑰　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）で市場性のあるものに投資することを指図します。

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

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

(注）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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

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

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

２．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

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

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

⑤ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥ 金利先渡取引

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

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

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

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

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

(注）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数とは

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。

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．主として外国の株式（預託証書を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

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

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

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2．国債証券
3．地方債証券
4．特別の法律により法人の発行する債券
5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）ＭＳＣＩコクサイ指数とは

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

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

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

①　委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

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

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 主な投資制限

① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。
② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）FTSE世界国債インデックスとは

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、こ

れを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

②　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

④　その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3) その他の留意点

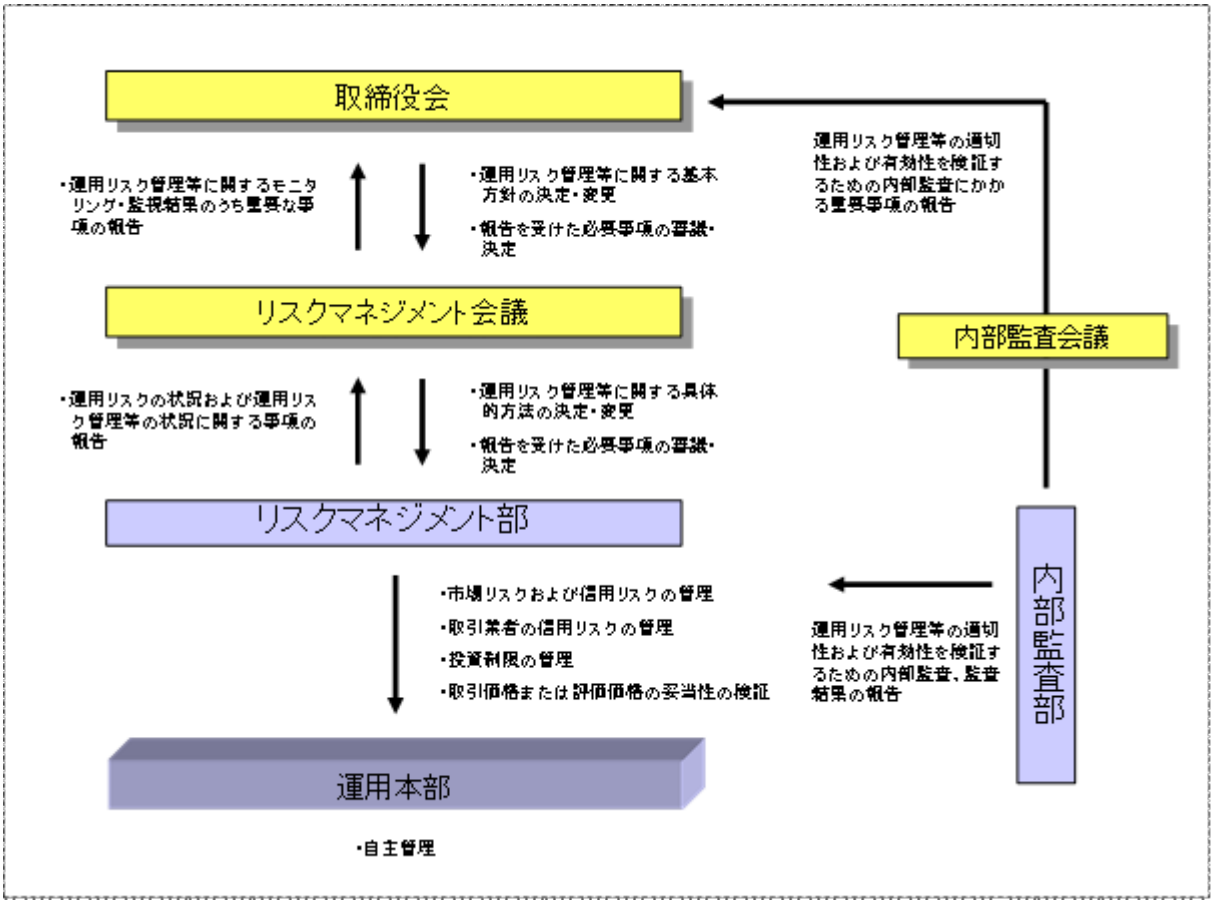
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

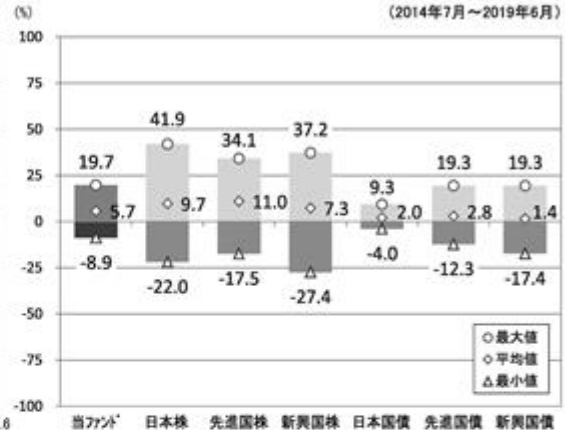
当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

※資産クラスについて
日 本 株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
日本国債：NOMURA-BPI国債
先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ 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、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●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― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

① 取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

② 申込手数料には、消費税等が課されます。

③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金(解約)手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.216%※（税抜0.2%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、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。

※消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.22%となります。

② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

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

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

④ 前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

※「つみたてＮＩＳＡ」をご利用の場合

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

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

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

②　法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

③　受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、前②にかかわらず所得税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

＜注1＞個別元本について

①　投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

②　投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

③　投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

＜注2＞収益分配金の課税について

①　追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

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

（※）上記は、2019年6月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】 (2019年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		10,642,283,414	99.60
	内 日本	10,642,283,414	99.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		42,598,452	0.40
純資産総額		10,684,881,866	100.00

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

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

(2) 【投資資産】 (2019年6月28日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	3,240,115,683	1.3065 4,233,281,727	1.3100 4,244,551,544	39.72
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,209,724,101	0.9835 3,156,915,941	0.9985 3,204,909,514	29.99
3	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	840,837,148	2.4317 2,044,668,997	2.5291 2,126,561,231	19.90
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	379,898,502	2.7707 1,052,590,618	2.8067 1,066,261,125	9.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第5計算期間末 (2010年6月7日)	201,138,572	201,138,572	0.9766	0.9766
第6計算期間末 (2011年6月6日)	675,031,030	675,031,030	1.0009	1.0009
第7計算期間末 (2012年6月5日)	2,513,582,182	2,513,582,182	0.9579	0.9579
第8計算期間末 (2013年6月5日)	3,768,631,160	3,768,631,160	1.2662	1.2662
第9計算期間末 (2014年6月5日)	4,783,424,672	4,783,424,672	1.4020	1.4020
第10計算期間末 (2015年6月5日)	6,170,909,855	6,170,909,855	1.6552	1.6552
第11計算期間末 (2016年6月6日)	6,343,341,340	6,343,341,340	1.5313	1.5313
第12計算期間末 (2017年6月5日)	7,577,368,811	7,577,368,811	1.6888	1.6888
第13計算期間末 (2018年6月5日)	9,369,920,286	9,369,920,286	1.7946	1.7946
2018年6月末日	9,429,976,430	－	1.7787	－
7月末日	9,678,489,050	－	1.7994	－
8月末日	9,974,142,176	－	1.7978	－
9月末日	10,253,849,664	－	1.8380	－
10月末日	9,986,300,645	－	1.7501	－
11月末日	10,226,198,912	－	1.7693	－
12月末日	9,827,618,673	－	1.6813	－

2019年1月末日	10,257,469,452	－	1.7279	－
2月末日	10,567,121,588	－	1.7655	－
3月末日	10,748,547,412	－	1.7754	－
4月末日	10,957,804,198	－	1.7970	－
5月末日	10,421,327,957	－	1.7415	－
第14計算期間末 (2019年6月5日)	10,459,930,523	10,459,930,523	1.7485	1.7485
6月末日	10,684,881,866	－	1.7742	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第5計算期間	0.5
第6計算期間	2.5
第7計算期間	△4.3
第8計算期間	32.2
第9計算期間	10.7
第10計算期間	18.1
第11計算期間	△7.5
第12計算期間	10.3
第13計算期間	6.3
第14計算期間	△2.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第5計算期間	191,357,494	9,608,596

第6計算期間	504,180,591	35,734,472
第7計算期間	2,048,718,597	99,116,492
第8計算期間	630,210,873	277,971,974
第9計算期間	766,679,623	331,047,078
第10計算期間	648,385,457	332,037,184
第11計算期間	781,918,053	367,727,208
第12計算期間	742,279,216	397,980,945
第13計算期間	1,197,236,585	462,712,216
第14計算期間	1,546,801,950	785,943,884

（参考）マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2019年6月28日現在）

投資状況

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

その他の資産の投資状況

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

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

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

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

(2) 投資資産（2019年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

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

1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	684,700	7,002.13 4,794,358,634	6,688.00 4,579,273,600	3.33
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	502,600	5,432.23 2,730,241,635	5,165.00 2,595,929,000	1.89
3	ソニー	日本	株式	電気機器	412,300	6,605.26 2,723,352,608	5,648.00 2,328,670,400	1.69
4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,172,000	694.17 2,896,112,059	512.00 2,136,064,000	1.55
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	412,400	5,132.86 2,116,793,830	5,017.00 2,069,010,800	1.50
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	536,400	4,556.67 2,444,200,308	3,823.00 2,050,657,200	1.49
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	30,200	63,227.90 1,909,482,653	66,130.00 1,997,126,000	1.45
8	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	427,100	4,506.32 1,924,650,475	3,806.00 1,625,542,600	1.18
9	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	420,600	3,643.31 1,532,380,234	3,594.00 1,511,636,400	1.10
10	本田技研	日本	株式	輸送用機器	518,400	3,360.02 1,741,839,491	2,785.00 1,443,744,000	1.05
11	任天堂	日本	株式	その他製品	35,200	39,807.41 1,401,221,162	39,490.00 1,390,048,000	1.01
12	KDDI	日本	株式	情報・通信業	494,300	3,066.57 1,515,807,494	2,743.50 1,356,112,050	0.99
13	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,233,500	196.65 1,619,139,859	156.10 1,285,249,350	0.93
14	花王	日本	株式	化学	149,200	9,005.24 1,343,583,051	8,210.00 1,224,932,000	0.89
15	三菱商事	日本	株式	卸売業	424,700	3,440.64 1,461,240,474	2,840.00 1,206,148,000	0.88
16	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	55,000	23,215.72 1,276,864,735	21,580.00 1,186,900,000	0.86
17	ダイキン工業	日本	株式	機械	83,800	15,440.65 1,293,927,266	14,065.00 1,178,647,000	0.86
18	東京海上HD	日本	株式	保険業	216,600	5,446.76 1,179,768,304	5,399.00 1,169,423,400	0.85
19	ファナック	日本	株式	電気機器	58,400	21,966.60 1,282,849,654	19,930.00 1,163,912,000	0.85
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	109,300	10,625.98 1,161,419,768	10,080.00 1,101,744,000	0.80

21	日 立	日本	株式	電 気 機 器	276,500	3,730.31 1,031,431,359	3,949.00 1,091,898,500	0.79
22	日本電産	日本	株式	電 気 機 器	74,000	16,358.09 1,210,498,675	14,725.00 1,089,650,000	0.79
23	信越化学	日本	株式	化学	106,000	9,825.51 1,041,504,206	10,035.00 1,063,710,000	0.77
24	キヤノン	日本	株式	電 気 機 器	330,800	3,520.44 1,164,564,730	3,146.00 1,040,696,800	0.76
25	HOYA	日本	株式	精 密 機 器	123,700	6,647.96 822,352,660	8,254.00 1,021,019,800	0.74
26	資 生 堂	日本	株式	化学	122,100	7,912.72 966,143,938	8,121.00 991,574,100	0.72
27	第一三共	日本	株式	医薬品	175,800	4,600.86 808,832,455	5,635.00 990,633,000	0.72
28	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	381,800	3,014.14 1,150,801,071	2,512.50 959,272,500	0.70
29	村田製作所	日本	株式	電 気 機 器	193,400	5,930.90 1,147,036,173	4,840.00 936,056,000	0.68
30	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	69,400	11,724.38 813,672,509	13,340.00 925,796,000	0.67

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.28%
合計	99.28%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.11%
鉱業	0.27%
建設業	2.78%
食料品	4.09%
繊維製品	0.65%
パルプ・紙	0.28%
化学	7.35%
医薬品	5.45%
石油・石炭製品	0.62%

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

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2019年9月	買建	78	1,198,049,120	1,209,780,000	0.88%

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

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

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（2019年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		15,271,636,270	83.25
	内 日本	15,271,636,270	83.25
地方債証券		1,141,520,400	6.22
	内 日本	1,141,520,400	6.22
特殊債券		716,361,000	3.90
	内 日本	716,361,000	3.90
社債券		1,044,095,200	5.69
	内 日本	1,044,095,200	5.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		171,243,245	0.93
純資産総額		18,344,856,115	100.00

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

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

(2) 投資資産（2019年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	125 5年国債	日本	国債証券	370,000,000	100.44 371,631,700	100.36 371,357,900	0.100000 2020/09/20	2.02
2	345 10年国債	日本	国債証券	280,000,000	101.90 285,325,300	102.74 287,677,600	0.100000 2026/12/20	1.57
3	126 5年国債	日本	国債証券	233,000,000	100.50 234,170,050	100.46 234,081,120	0.100000 2020/12/20	1.28
4	334 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	103.87 207,755,220	104.33 208,660,000	0.600000 2024/06/20	1.14

5	130 5年国債	日本	国債証券	197,000,000	100.70 198,384,910	100.80 198,589,790	0.100000 2021/12/20	1.08
6	343 10年国債	日本	国債証券	192,000,000	101.06 194,039,280	102.55 196,905,600	0.100000 2026/06/20	1.07
7	131 5年国債	日本	国債証券	190,000,000	100.81 191,543,000	100.90 191,713,800	0.100000 2022/03/20	1.05
8	350 10年国債	日本	国債証券	185,000,000	100.46 185,854,700	102.79 190,176,300	0.100000 2028/03/20	1.04
9	128 5年国債	日本	国債証券	187,000,000	100.59 188,112,600	100.63 188,183,710	0.100000 2021/06/20	1.03
10	347 10年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.89 181,615,150	102.84 185,122,800	0.100000 2027/06/20	1.01
11	129 5年国債	日本	国債証券	182,000,000	100.64 183,170,400	100.72 183,319,500	0.100000 2021/09/20	1.00
12	348 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.84 171,432,600	102.85 174,846,700	0.100000 2027/09/20	0.95
13	349 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.58 170,996,200	102.85 174,846,700	0.100000 2027/12/20	0.95
14	135 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.94 171,613,300	101.29 172,199,800	0.100000 2023/03/20	0.94
15	329 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	104.18 166,688,000	104.21 166,736,000	0.800000 2023/06/20	0.91
16	335 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.43 165,500,800	104.02 166,436,800	0.500000 2024/09/20	0.91
17	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.50 165,614,400	103.34 165,348,800	0.800000 2022/09/20	0.90
18	138 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	101.31 151,972,800	101.62 152,442,000	0.100000 2023/12/20	0.83
19	133 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.85 151,287,000	101.08 151,630,500	0.100000 2022/09/20	0.83
20	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	103.74 145,244,400	103.27 144,590,600	1.100000 2021/12/20	0.79
21	322 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	103.38 144,744,600	103.07 144,306,400	0.900000 2022/03/20	0.79
22	127 5年国債	日本	国債証券	140,000,000	100.54 140,760,050	100.54 140,760,200	0.100000 2021/03/20	0.77
23	331 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	103.42 134,451,200	103.62 134,713,800	0.600000 2023/09/20	0.73
24	351 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.65 130,854,000	102.74 133,562,000	0.100000 2028/06/20	0.73

25	352 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.28 130,367,100	102.67 133,474,900	0.100000 2028/09/20	0.73
26	353 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	101.35 131,761,100	102.64 133,442,400	0.100000 2028/12/20	0.73
27	137 5年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.98 131,283,400	101.53 131,996,800	0.100000 2023/09/20	0.72
28	113 20年国債	日本	国債証券	100,000,000	121.34 121,347,200	123.16 123,165,000	2.100000 2029/09/20	0.67
29	11兵庫県公債20年	日本	地方債証券	100,000,000	117.02 117,023,600	119.18 119,186,500	1.840000 2030/08/16	0.65
30	49 30年国債	日本	国債証券	93,000,000	122.69 114,105,790	127.28 118,377,840	1.400000 2045/12/20	0.65

(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	83.25%
地方債証券	6.22%
特殊債券	3.90%
社債券	5.69%
合計	99.07%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2019年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

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

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		1,816,611,818	1.59
	内 アメリカ	1,816,611,818	1.59

為替予約取引(買建)		527,779,000	0.46
	内 日本	527,779,000	0.46

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

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

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

(注4) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（2019年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	199,600	11,902.06 2,375,657,926	14,460.02 2,886,221,689	2.53
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	129,000	19,311.65 2,491,211,684	21,529.97 2,777,366,723	2.43
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	11,430	180,800.26 2,066,547,297	205,262.34 2,346,148,560	2.06
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	65,150	15,002.85 977,436,260	20,426.20 1,330,767,256	1.17
5	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	73,000	15,672.66 1,144,109,576	15,164.97 1,107,043,182	0.97
6	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	89,870	11,832.00 1,063,342,357	11,731.86 1,054,342,582	0.92
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	8,627	117,298.47 1,011,934,223	115,983.11 1,000,586,358	0.88
8	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	8,200	117,980.68 967,442,316	116,049.94 951,609,571	0.83

9	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	85,550	9,434.63 807,136,278	11,106.85 950,191,189	0.83
10	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	116,055	8,490.51 985,371,533	8,172.63 948,475,480	0.83
11	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	48,050	15,031.74 722,277,373	18,456.88 886,853,166	0.78
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	35,800	23,396.46 837,597,232	22,853.63 818,160,162	0.72
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	68,667	10,045.70 689,814,225	11,833.18 812,549,397	0.71
14	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	251,101	3,020.81 758,529,732	3,040.75 763,536,847	0.67
15	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	49,412	12,384.74 611,955,791	15,015.14 741,928,444	0.65
16	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	121,050	5,096.95 616,994,078	6,007.13 727,163,898	0.64
17	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	155,313	4,900.34 761,095,859	4,681.31 727,069,807	0.64
18	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	199,991	3,296.11 659,200,646	3,554.91 710,950,846	0.62
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	25,050	21,245.51 532,201,861	28,143.96 705,006,423	0.62
20	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	113,504	6,390.00 725,294,528	6,170.97 700,430,630	0.61
21	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	26,326	30,365.73 799,408,992	26,552.98 699,033,978	0.61
22	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	52,068	12,800.17 666,483,479	13,270.02 690,943,761	0.61
23	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	30,950	18,973.19 587,222,868	22,314.68 690,639,526	0.61
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	70,771	8,393.93 594,048,940	9,036.03 639,489,283	0.56

25	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	123,550	5,140.18 635,069,453	5,115.71 632,046,391	0.55
26	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	111,550	5,276.96 588,646,957	5,505.91 614,184,617	0.54
27	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	120,222	5,805.89 697,997,010	4,989.59 599,859,583	0.53
28	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	19,640	28,152.71 552,920,798	30,213.59 593,395,055	0.52
29	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	60,200	8,773.37 528,161,041	9,853.24 593,165,319	0.52
30	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・サービス	14,740	36,956.12 544,734,664	39,237.71 578,363,931	0.51

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.77%
投資証券	2.76%
合計	98.54%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	5.93%
素材	4.46%
資本財・サービス	10.06%
一般消費財・サービス	9.65%
生活必需品	8.45%
ヘルスケア	12.72%
金融	15.93%
情報技術	16.51%
コミュニケーション・サービス	8.10%
公益事業	3.43%
不動産	0.54%
合計	95.77%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

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

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2019年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		173,863,649,431	98.33
	内 ユーロ	67,306,863,651	38.07
	内 シンガポール	691,971,343	0.39
	内 マレーシア	812,827,646	0.46
	内 ノルウェー	422,431,250	0.24
	内 スウェーデン	619,169,833	0.35
	内 デンマーク	887,294,456	0.50
	内 イギリス	11,083,093,002	6.27
	内 ポーランド	1,042,043,221	0.59
	内 カナダ	3,370,347,903	1.91
	内 アメリカ	81,713,704,513	46.22
	内 メキシコ	1,420,336,583	0.80
	内 南アフリカ	986,127,716	0.56
	内 オーストラリア	3,507,438,314	1.98

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,944,189,285	1.67
純資産総額	176,807,838,716	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		1,657,486,540	0.94
	内 日本	1,657,486,540	0.94

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

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

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

(2) 投資資産（2019年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,907,000	99.98 852,164,622	100.83 859,386,628	2.250000 2021/04/30	0.49
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	102.66 708,251,520	109.62 756,254,640	3.125000 2028/11/15	0.43
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	99.39 696,384,705	107.32 751,921,482	2.875000 2028/05/15	0.43
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	100.58 715,580,406	105.39 749,759,214	2.625000 2029/02/15	0.42
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,029,000	91.63 694,276,204	98.35 745,162,164	1.625000 2026/05/15	0.42
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	97.75 663,845,302	106.25 721,566,847	2.750000 2028/02/15	0.41
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,000,000	98.64 637,944,336	107.42 694,734,575	2.875000 2028/08/15	0.39
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	96.78 655,861,348	100.89 683,707,043	2.000000 2022/11/30	0.39
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,084,000	159.73 603,394,706	179.44 677,873,702	4.500000 2041/04/25	0.38
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	96.38 615,133,624	102.29 652,878,226	2.250000 2024/11/15	0.37

11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	94.14 598,744,562	102.34 650,861,566	2.250000 2027/08/15	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	95.58 601,701,457	102.36 644,393,713	2.250000 2025/11/15	0.36
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	95.35 585,839,404	103.32 634,850,331	2.375000 2027/05/15	0.36
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	95.23 594,153,993	101.63 634,070,380	2.125000 2025/05/15	0.36
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,087,000	118.72 594,351,180	126.38 632,694,315	2.500000 2030/05/25	0.36
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,420,000	107.50 582,013,257	115.81 627,012,885	1.500000 2031/05/25	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.71 586,340,384	100.97 625,079,780	2.000000 2025/02/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.26 583,536,142	100.91 624,695,977	2.000000 2025/08/15	0.35
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,097,000	121.43 609,409,647	121.21 608,307,210	4.250000 2023/10/25	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,550,000	97.88 585,567,773	101.64 608,045,545	2.125000 2024/03/31	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	93.94 556,948,235	102.31 606,551,576	2.250000 2027/11/15	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	93.00 551,387,349	100.68 596,917,845	2.000000 2026/11/15	0.34
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,807,000	162.41 558,423,692	173.13 595,282,207	5.750000 2032/10/25	0.34
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,340,000	94.56 544,297,548	102.41 589,493,550	2.250000 2027/02/15	0.33
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	99.33 559,885,744	104.41 588,512,710	2.750000 2024/02/15	0.33
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	89.91 542,742,483	97.38 587,821,123	1.500000 2026/08/15	0.33
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,023,000	148.58 550,191,340	154.78 573,149,150	5.500000 2029/04/25	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,162,000	97.23 541,021,624	102.89 572,536,799	2.375000 2024/08/15	0.32
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	91.36 528,467,769	98.47 569,586,306	1.625000 2026/02/15	0.32
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	99.46 538,334,333	104.20 563,960,797	2.750000 2023/11/15	0.32

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.33%
合計	98.33%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2019年7月	買建	233,000	17,541,638	17,584,510	0.01%
		南アフリカ・ランド買/円売 2019年8月	買建	1,100,000	8,303,779	8,294,000	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2019年8月	買建	639,000	52,483,127	52,474,680	0.03%
		デンマーク・クローネ買/円売 2019年8月	買建	477,000	7,828,953	7,827,570	0.00%
		ユーロ買/円売 2019年8月	買建	3,133,000	383,704,489	383,635,850	0.22%
		ユーロ買/円売 2019年7月	買建	1,592,000	194,916,201	194,988,160	0.11%
		英ポンド買/円売 2019年8月	買建	481,000	65,599,020	65,589,160	0.04%
		英ポンド買/円売 2019年7月	買建	326,000	44,566,808	44,515,300	0.03%
		メキシコ・ペソ買/円売 2019年8月	買建	3,611,000	20,129,487	20,077,160	0.01%
		マレーシア・リンギット買/円売 2019年7月	買建	522,000	13,587,660	13,572,000	0.01%

		ノルウェー・クローネ買/円売 2019年8月	買建	972,000	12,282,481	12,276,360	0.01%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2019年7月	買建	837,000	23,728,799	24,105,600	0.01%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2019年7月	買建	188,000	2,156,276	2,182,680	0.00%
		シンガポール・ドル買/円売 2019年8月	買建	300,000	23,839,500	23,835,000	0.01%
		米ドル買/円売 2019年8月	買建	4,740,000	509,423,918	509,218,200	0.29%
		米ドル買/円売 2019年7月	買建	2,538,000	273,311,128	273,469,500	0.15%
		豪ドル買/円売 2019年8月	買建	51,000	3,844,074	3,840,810	0.00%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワ・ライフ・バランス50

2019年6月28日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	17,742円
純資産総額	106億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.9%
3カ月間	−0.1%
6カ月間	5.5%
1年間	−0.3%
3年間	19.3%
5年間	25.4%
設定来	77.4%

※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3期 08年6月	第4期 09年6月	第5期 10年6月	第6期 11年6月	第7期 12年6月	第8期 13年6月	第9期 14年6月	第10期 15年6月	第11期 16年6月	第12期 17年6月	第13期 18年6月	第14期 19年6月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内債券	266	39.4%
国内株式・先物	2,127	30.0%
外国株式・先物	1,264	19.4%
外国債券	772	9.8%
外国リート	63	0.5%
外国投資証券	6	0.0%
コール・ローン、その他		1.4%
合計	4,498	−

通貨別構成	比率
日本円	70.1%
米ドル	18.3%
ユーロ	6.2%
英ポンド	1.9%
カナダ・ドル	0.9%
豪ドル	0.7%
スイス・フラン	0.7%
香港ドル	0.3%
スウェーデン・クローネ	0.2%
その他	0.7%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.1
最終利回り(%)	0.2
修正デュレーション	9.1
残存年数	10.2

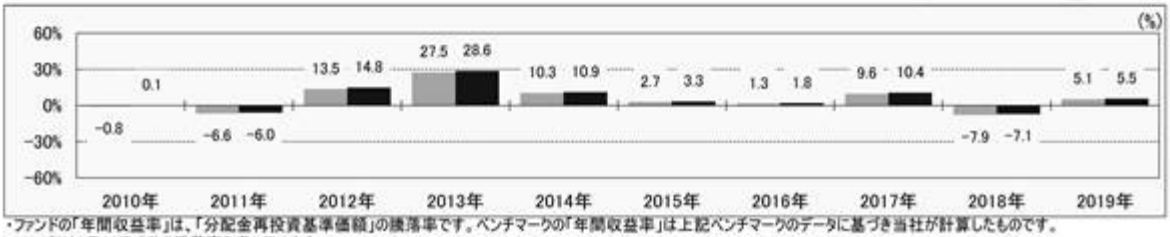
債券格付別構成	比率
AAA	86.5%
AA	6.5%
A	3.6%
BBB	0.1%
BB以下・無格付	3.2%
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
トヨタ自動車	日本	1.0%
ソフトバンクグループ	日本	0.6%
ソニー	日本	0.5%
MICROSOFT CORP	アメリカ	0.5%
APPLE INC	アメリカ	0.5%
三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
日本電信電話	日本	0.5%
武田薬品	日本	0.4%
キーエンス	日本	0.4%
AMAZON.COM INC	アメリカ	0.4%
合計		5.3%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を3.2%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2019年は6月28日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

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

第２ 【管理及び運営】

１ 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

２ 【換金(解約)手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、委託会社または販売会社に問合わせる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があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、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（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
　・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。

・わが国および外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

1.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3.価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　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)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年6月6日から翌年6月5日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

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

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

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

6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

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

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

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

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

6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

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

④　運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス　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。

⑤　公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

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。

⑥　関係法人との契約の更改

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

4　【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

①　収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社

の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

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

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

② 換金請求権

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

第３ 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間（2018年6月6日から2019年6月5日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ・ライフ・バランス５０

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 2018年6月5日現在	第14期 2019年6月5日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	23,494,132	－
コール・ローン	34,935,960	59,145,017
親投資信託受益証券	9,333,057,052	10,418,160,138
未収入金	4,700,000	－
流動資産合計	9,396,187,144	10,477,305,155
資産合計	9,396,187,144	10,477,305,155
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,356,841	5,683,733
未払受託者報酬	1,432,607	1,690,204
未払委託者報酬	8,118,346	9,578,068
その他未払費用	359,064	422,627
流動負債合計	26,266,858	17,374,632
負債合計	26,266,858	17,374,632
純資産の部		
元本等		
元本	※1 5,221,242,775	※1 5,982,100,841
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,148,677,511	4,477,829,682
（分配準備積立金）	2,089,970,607	1,827,562,680
元本等合計	9,369,920,286	10,459,930,523
純資産合計	9,369,920,286	10,459,930,523
負債純資産合計	9,396,187,144	10,477,305,155

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自　2017年6月6日 至　2018年6月5日	第14期 自　2018年6月6日 至　2019年6月5日
営業収益		
受取利息	―	9
有価証券売買等損益	512,421,926	△ 234,455,914
その他収益	―	21
営業収益合計	512,421,926	△ 234,455,884
営業費用		
支払利息	24,726	35,798
受託者報酬	2,723,114	3,285,260
委託者報酬	15,431,422	18,616,881
その他費用	681,947	825,911
営業費用合計	18,861,209	22,763,850
営業利益又は営業損失（△）	493,560,717	△ 257,219,734
経常利益又は経常損失（△）	493,560,717	△ 257,219,734
当期純利益又は当期純損失（△）	493,560,717	△ 257,219,734
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	29,212,405	△ 21,927,852
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,090,650,405	4,148,677,511
剰余金増加額又は欠損金減少額	915,097,754	1,185,751,776
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	915,097,754	1,185,751,776
剰余金減少額又は欠損金増加額	321,418,960	621,307,723
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	321,418,960	621,307,723
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,148,677,511	4,477,829,682

(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14期 自　2018年6月6日 至　2019年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第13期 2018年6月5日現在	第14期 2019年6月5日現在
1.　※1　期首元本額	4,486,718,406円	5,221,242,775円
期中追加設定元本額	1,197,236,585円	1,546,801,950円
期中一部解約元本額	462,712,216円	785,943,884円
2.　計算期間末日における受益権の総数	5,221,242,775口	5,982,100,841口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第13期 自　2017年6月6日 至　2018年6月5日	第14期 自　2018年6月6日 至　2019年6月5日

※1　分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（464,357,211円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,420,552,317円）及び分配準備積立金（1,625,613,396円）より分配可能額は5,510,522,924円（1万口当たり10,554.04円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,485,968,772円）及び分配準備積立金（1,827,562,680円）より分配可能額は6,313,531,452円（1万口当たり10,554.04円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第14期 自　2018年6月6日 至　2019年6月5日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第14期 2019年6月5日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第13期 2018年6月5日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第14期 2019年6月5日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	501,396,511	△236,202,977
合計	501,396,511	△236,202,977

（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13期 2018年6月5日現在	第14期 2019年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第14期 自　2018年6月6日 至　2019年6月5日

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

（1口当たり情報）

	第13期 2018年6月5日現在	第14期 2019年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7946円 (17,946円)	1.7485円 (17,485円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	3,166,199,673	3,113,640,758	
	外国株式インデックスマザーファンド	846,468,072	2,058,356,410	
	外国債券インデックスマザーファンド	377,147,861	1,044,888,148	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	3,215,671,506	4,201,274,822	
親投資信託受益証券　合計			10,418,160,138	
合計			10,418,160,138	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,901,628,923	―
コール・ローン	5,801,752,917	13,816,984,423
株式　※3※4	142,963,744,470	132,659,243,740
派生商品評価勘定	38,441,820	2,235,680
未収配当金	1,047,473,250	1,177,332,110
未収利息	942,016	2,494,689
前払金	―	123,503,300
その他未収収益　※5	20,828,650	49,747,628
流動資産合計	153,774,812,046	147,831,541,570
資産合計	153,774,812,046	147,831,541,570
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,527,280	76,274,840
前受金	40,445,000	―
未払解約金	16,478,700	88,964,000
受入担保金	8,128,865,010	12,706,116,012
その他未払費用	200,293	69,069
流動負債合計	8,188,516,283	12,871,423,921
負債合計	8,188,516,283	12,871,423,921
純資産の部		
元本等		
元本　※1	130,544,614,080	137,233,315,554
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）　※2	15,041,681,683	△2,273,197,905

元本等合計	145,586,295,763	134,960,117,649
純資産合計	145,586,295,763	134,960,117,649
負債純資産合計	153,774,812,046	147,831,541,570

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6月6日 至　2019年6月5日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)新株予約権証券 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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金

	原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
1. ※1　期首	2017年6月6日	2018年6月6日
期首元本額	134,619,084,916円	130,544,614,080円
期中追加設定元本額	16,350,943,105円	19,206,602,114円
期中一部解約元本額	20,425,413,941円	12,517,900,640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	4,162,592,447円	4,078,415,082円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	9,720,485,226円	7,837,093,397円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	61,533,489円	28,823,749円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	71,040,156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)	1,185,083,183円	976,873,994円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	58,786,280円	49,591,649円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,629,722,011円	1,345,790,812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	16,262,184円
Ｄ－Ｉ's　ＴＯＰＩＸインデックス	27,080,146円	40,212,628円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	21,745,004円	19,956,909円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	637,974円	1,615,386円
ｉＦｒｅｅ　ＴＯＰＩＸインデックス	500,181,562円	1,079,173,827円

ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	870,549,977円	1,684,446,800円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	－円	41,227,884円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	62,916,207,863円	65,423,316,922円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,334,266,744円	2,828,018,505円
ダイワ・ライフ・バランス５０	2,511,161,219円	3,166,199,673円
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,431,889,390円	2,906,547,954円
年金ダイワ日本株式インデックス	4,410,452,878円	4,922,116,815円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	15,008,044円	15,526,759円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	49,058,874円	51,737,113円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	14,593,445円	18,075,776円
ダイワつみたてインデックス日本株式	－円	110,064,150円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	330,547円	358,303円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	338,072円	367,695円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	676,615円	726,124円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	2,160,411円	4,245,918円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	4,779,668円	4,248,105円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	10,239,884円	8,201,794円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	234,954,399円	168,271,660円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	162,509,645円	165,937,499円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	9,996,448,139円	9,582,707,612円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	58,004,356円	534,691円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	53,103,500円	2,894,230円

	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	859,818,096円	825,721,462円
	ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	129,181,252円	127,351,633円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	225,110,840円	223,926,223円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	103,353,224円	163,870,546円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	7,527,101,920円	8,790,239,350円
	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	89,520,884円	1,952,601,712円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	1,713,359,066円	2,511,606,129円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,352,677,991円	1,424,632,811円
	ダイワライフスタイル２５	174,970,735円	193,069,689円
	ダイワライフスタイル５０	616,175,702円	678,512,244円
	ダイワライフスタイル７５	522,270,600円	558,569,318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）	13,715,452,622円	13,142,886,177円
計		130,544,614,080円	137,233,315,554円
2.	期末日における受益権の総数	130,544,614,080口	137,233,315,554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2,273,197,905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 7,846,685,150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 12,389,784,010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　734,500,000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　466,760,000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18,774,762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45,630,413円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2018年6月6日 至　2019年6月5日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2019年6月5日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2018年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	8,260,803,646	△20,777,613,092
合計	8,260,803,646	△20,777,613,092

（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6月5日まで、及び2018年9月20日から2019年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種　類	2018年6月5日 現在				2019年6月5日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買　建	2,607,870,000	－	2,643,865,000	35,995,000	2,501,088,300	－	2,427,135,000	△73,953,300
合計	2,607,870,000	－	2,643,865,000	35,995,000	2,501,088,300	－	2,427,135,000	△73,953,300

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
1口当たり純資産額	1.1152円	0.9834円
（1万口当たり純資産額）	(11,152円)	(9,834円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

銘　柄	株　式　数	評価額（円）		備考	
		単　価	金　額		
極　洋	2,600	2,686.00	6,983,600		
日本水産	82,000	651.00	53,382,000		
マルハニチロ	11,900	3,285.00	39,091,500		
ホウスイ	500	835.00	417,500	貸付株式数	200株
カネコ種苗	2,400	1,284.00	3,081,600		
サカタのタネ	10,000	3,285.00	32,850,000	貸付株式数	3,900株
ホクト	6,900	1,794.00	12,378,600	貸付株式数	2,500株
ホクリヨウ	1,100	607.00	667,700	貸付株式数	200株
ヒノキヤグループ	2,300	2,118.00	4,871,400		
ショーボンドＨＤ	5,900	7,670.00	45,253,000	貸付株式数	2,300株 (1,600株)
ミライト・ホールディングス	23,100	1,705.00	39,385,500	貸付株式数	9,100株 (5,500株)
タマホーム	4,400	983.00	4,325,200	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	1,400	643.00	900,200		
日本アクア	2,500	473.00	1,182,500		
ファーストコーポレーション	2,300	765.00	1,759,500	貸付株式数	900株
ベステラ	1,600	1,279.00	2,046,400	貸付株式数	600株

スペースバリューＨＤ	9,900	546.00	5,405,400	貸付株式数	400株
住石ホールディングス	18,100	115.00	2,081,500	貸付株式数	6,800株
日鉄鉱業	1,900	4,245.00	8,065,500	貸付株式数	700株
三井松島ＨＬＤＧＳ	3,400	1,262.00	4,290,800		
国際石油開発帝石	329,200	895.30	294,732,760		
石油資源開発	11,800	2,314.00	27,305,200	貸付株式数	4,600株
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,000	1,667.00	6,668,000		
ダイセキ環境ソリューション	1,500	635.00	952,500	貸付株式数	400株
第一カッター興業	1,000	1,738.00	1,738,000		
安藤・間	52,600	728.00	38,292,800		
東急建設	24,100	781.00	18,822,100		
コムシスホールディングス	29,100	2,660.00	77,406,000		
ミサワホーム	6,800	990.00	6,732,000		
ビーアールホールディングス	8,800	340.00	2,992,000		
高松コンストラクショングループ	5,100	2,289.00	11,673,900		
東建コーポレーション	2,500	6,580.00	16,450,000	貸付株式数	1,000株
ソネック	800	747.00	597,600		
ヤマウラ	3,000	840.00	2,520,000	貸付株式数	1,200株
大成建設	67,400	4,130.00	278,362,000		
大　林　組	203,100	1,056.00	214,473,600		
清水建設	207,100	927.00	191,981,700		
飛島建設	5,800	1,310.00	7,598,000		
長谷工コーポレーシヨン	84,600	1,113.00	94,159,800	貸付株式数	500株
松井建設	7,300	641.00	4,679,300	貸付株式数	2,800株
錢　高　組	800	4,580.00	3,664,000		
鹿島建設	158,700	1,526.00	242,176,200		
不動テトラ	5,000	1,365.00	6,825,000		
大末建設	2,300	936.00	2,152,800		
鉄建建設	4,100	2,945.00	12,074,500	貸付株式数	1,600株
西松建設	14,600	2,141.00	31,258,600	貸付株式数	5,800株
三井住友建設	48,800	617.00	30,109,600	貸付株式数	16,300株
大豊建設	4,600	2,780.00	12,788,000		
前田建設	48,300	917.00	44,291,100		
佐田建設	4,600	365.00	1,679,000		
ナカノフドー建設	4,900	448.00	2,195,200		
奥　村　組	11,100	3,315.00	36,796,500		
東鉄工業	8,100	3,030.00	24,543,000	貸付株式数	2,800株

イチケン	1,200	1,697.00	2,036,400		
富士ピー・エス	2,700	446.00	1,204,200	貸付株式数	800株
淺沼組	2,400	3,605.00	8,652,000		
戸田建設	78,600	610.00	47,946,000	貸付株式数	31,100株
熊　谷　組	9,700	2,961.00	28,721,700	貸付株式数	3,200株
青木あすなろ建設	3,600	834.00	3,002,400	貸付株式数	1,300株
北野建設	1,400	2,674.00	3,743,600		
植　木　組	800	2,094.00	1,675,200		
矢作建設	9,100	735.00	6,688,500	貸付株式数	3,400株
ピーエス三菱	7,000	607.00	4,249,000		
日本ハウスＨＬＤＧＳ	12,900	417.00	5,379,300	貸付株式数	4,900株
大東建託	24,100	14,295.00	344,509,500	貸付株式数	4,300株
新日本建設	8,200	928.00	7,609,600	貸付株式数	2,200株
ＮＩＰＰＯ	17,900	2,200.00	39,380,000	貸付株式数	1,300株
東亜道路	1,200	2,998.00	3,597,600		
前田道路	21,200	2,268.00	48,081,600		
日本道路	1,800	6,190.00	11,142,000		
東亜建設	5,900	1,523.00	8,985,700	貸付株式数	2,300株
日本国土開発	11,000	558.00	6,138,000		
若築建設	3,400	1,373.00	4,668,200		
東洋建設	24,700	410.00	10,127,000	貸付株式数	9,400株
五洋建設	80,500	502.00	40,411,000		
世紀東急	9,900	620.00	6,138,000	貸付株式数	1,200株
福　田　組	2,200	4,315.00	9,493,000	貸付株式数	200株
日本ドライケミカル	1,500	1,098.00	1,647,000	貸付株式数	400株
住友林業	48,000	1,272.00	61,056,000		
日本基礎技術	6,600	369.00	2,435,400	貸付株式数	2,600株
巴コーポレーション	8,300	367.00	3,046,100	貸付株式数	3,000株
大和ハウス	187,500	3,284.00	615,750,000		
ライト工業	13,000	1,348.00	17,524,000	貸付株式数	4,600株
積水ハウス	207,200	1,752.50	363,118,000		
日特建設	5,600	596.00	3,337,600		
北陸電気工事	3,300	851.00	2,808,300	貸付株式数	1,100株
ユアテック	10,800	754.00	8,143,200	貸付株式数	4,000株
四電工	1,000	2,685.00	2,685,000	貸付株式数	200株
中電工	8,700	2,253.00	19,601,100		
関　電　工	30,900	895.00	27,655,500	貸付株式数	12,200株
きんでん	45,100	1,690.00	76,219,000	貸付株式数	15,000株
東京エネシス	6,900	936.00	6,458,400	貸付株式数	2,400株
トーエネック	1,900	2,980.00	5,662,000	貸付株式数	600株

住友電設	4,700	1,758.00	8,262,600	貸付株式数	1,200株
日本電設工業	11,600	2,351.00	27,271,600	貸付株式数	4,400株
協和エクシオ	26,500	2,595.00	68,767,500		
新日本空調	5,700	1,780.00	10,146,000		
日本工営	3,900	2,407.00	9,387,300		
九電工	13,400	3,110.00	41,674,000	貸付株式数	5,000株
三機工業	15,200	1,230.00	18,696,000	貸付株式数	6,000株
日　揮	58,300	1,506.00	87,799,800	貸付株式数	23,100株
中外炉工業	1,900	1,630.00	3,097,000		
ヤマト	6,000	558.00	3,348,000	貸付株式数	2,100株
太平電業	4,600	2,177.00	10,014,200	貸付株式数	400株
高砂熱学	16,500	1,696.00	27,984,000	貸付株式数	3,700株
三晃金属	800	2,517.00	2,013,600		
ＮＥＣネッツエスアイ	6,500	2,704.00	17,576,000		
朝日工業社	1,400	2,508.00	3,511,200		
明星工業	12,200	663.00	8,088,600	貸付株式数	2,700株
大　氣　社	9,200	3,280.00	30,176,000	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ダイダン	4,500	2,234.00	10,053,000	貸付株式数	900株
日比谷総合設備	6,100	1,863.00	11,364,300	貸付株式数	2,400株
東芝プラントシステム	14,700	1,966.00	28,900,200	貸付株式数	5,000株 (3,700株)
日本製粉	19,200	1,791.00	34,387,200	貸付株式数	7,600株
日清製粉Ｇ本社	68,600	2,502.00	171,637,200		
日東富士製粉	400	5,830.00	2,332,000		
昭和産業	5,600	3,075.00	17,220,000		
鳥越製粉	5,300	758.00	4,017,400		
中部飼料	7,400	1,186.00	8,776,400	貸付株式数	2,200株
フィード・ワン	40,600	172.00	6,983,200		
東洋精糖	900	983.00	884,700	貸付株式数	300株
日本甜菜糖	3,400	1,922.00	6,534,800	貸付株式数	1,300株
三井製糖	4,800	2,338.00	11,222,400	貸付株式数	200株
塩水港精糖	6,500	210.00	1,365,000		
日新製糖	2,900	1,835.00	5,321,500		
ＬＩＦＵＬＬ	21,100	586.00	12,364,600	貸付株式数	8,000株
ジェイエイシーリクルートメント	4,600	2,461.00	11,320,600	貸付株式数	1,800株
日本M&Aセンター	43,000	2,562.00	110,166,000	貸付株式数	17,100株
メンバーズ	1,900	1,813.00	3,444,700	貸付株式数	700株 (200株)

中広	500	555.00	277,500	貸付株式数	200株
アイティメディア	1,000	482.00	482,000		
タケエイ	5,900	929.00	5,481,100		
Ｅ・Ｊホールディングス	700	1,047.00	732,900		
トラスト・テック	3,200	3,095.00	9,904,000	貸付株式数	600株
コシダカホールディングス	14,200	1,431.00	20,320,200	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,300	761.00	989,300		
パソナグループ	7,000	1,746.00	12,222,000	貸付株式数	500株 (500株)
ＣＤＳ	1,400	1,310.00	1,834,000	貸付株式数	100株
リンクアンドモチベーション	10,600	590.00	6,254,000	貸付株式数	4,200株
ＧＣＡ	5,800	717.00	4,158,600	貸付株式数	300株
エス・エム・エス	21,200	2,496.00	52,915,200		
サニーサイドアップ	600	1,870.00	1,122,000		
パーソルホールディングス	57,700	2,398.00	138,364,600	貸付株式数	22,800株
リニカル	3,200	1,107.00	3,542,400	貸付株式数	1,200株 (600株)
クックパッド	18,000	324.00	5,832,000	貸付株式数	6,400株
エスクリ	1,600	765.00	1,224,000		
アイ・ケイ・ケイ	2,800	674.00	1,887,200		
森永製菓	15,300	4,995.00	76,423,500	貸付株式数	3,000株
中　村　屋	1,600	4,335.00	6,936,000	貸付株式数	500株
江崎グリコ	18,200	5,060.00	92,092,000	貸付株式数	7,200株
名糖産業	2,900	1,454.00	4,216,600	貸付株式数	1,100株
井村屋グループ	2,600	2,149.00	5,587,400		
不　二　家	3,400	1,973.00	6,708,200	貸付株式数	1,300株
山崎製パン	49,600	1,658.00	82,236,800	貸付株式数	18,700株
第一屋製パン	1,100	988.00	1,086,800	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,000	4,790.00	4,790,000	貸付株式数	400株
亀田製菓	3,800	4,935.00	18,753,000	貸付株式数	1,400株
寿スピリッツ	6,400	5,540.00	35,456,000		
カルビー	27,700	3,135.00	86,839,500	貸付株式数	10,900株
森永乳業	12,200	3,895.00	47,519,000	貸付株式数	4,800株
六甲バター	4,400	2,026.00	8,914,400		
ヤクルト	44,900	6,420.00	288,258,000		
明治ホールディングス	43,000	7,530.00	323,790,000		
雪印メグミルク	14,600	2,216.00	32,353,600		
プリマハム	8,500	2,067.00	17,569,500		
日本ハム	25,100	4,445.00	111,569,500		

林兼産業	1,800	587.00	1,056,600		
丸大食品	6,400	1,949.00	12,473,600		
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5,500	3,685.00	20,267,500	貸付株式数	300株
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	39,100	650.00	25,415,000	貸付株式数	1,100株
学情	2,300	1,084.00	2,493,200	貸付株式数	900株
スタジオアリス	2,900	2,031.00	5,889,900	貸付株式数	1,100株
クロスキャット	1,500	972.00	1,458,000	貸付株式数	600株
シミックホールディングス	3,200	2,032.00	6,502,400	貸付株式数	100株
システナ	21,100	1,597.00	33,696,700	貸付株式数	4,700株
ＮＪＳ	1,200	1,738.00	2,085,600		
デジタルアーツ	3,200	8,830.00	28,256,000	貸付株式数	200株 (200株)
日鉄ソリューションズ	8,900	3,330.00	29,637,000		
綜合警備保障	23,000	5,150.00	118,450,000		
キューブシステム	3,100	880.00	2,728,000	貸付株式数	1,100株
いちご	75,800	324.00	24,559,200		
エイジア	1,200	1,167.00	1,400,400	貸付株式数	400株
日本駐車場開発	71,300	175.00	12,477,500		
コア	2,500	1,455.00	3,637,500		
カカクコム	43,200	2,182.00	94,262,400	貸付株式数	17,200株
アイロムグループ	2,200	1,517.00	3,337,400	貸付株式数	800株
セントケア・ホールディング	4,100	477.00	1,955,700	貸付株式数	1,600株
サイネックス	900	645.00	580,500	貸付株式数	200株
ルネサンス	3,200	1,826.00	5,843,200		
ディップ	9,300	1,645.00	15,298,500	貸付株式数	3,600株
ＳＢＳホールディングス	6,100	1,638.00	9,991,800	貸付株式数	2,300株 (2,300株)
オプトホールディング	3,500	1,513.00	5,295,500	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
新日本科学	7,900	704.00	5,561,600	貸付株式数	2,600株
ツクイ	13,500	552.00	7,452,000	貸付株式数	5,300株
キャリアデザインセンター	1,400	1,488.00	2,083,200	貸付株式数	100株
ベネフィット・ワン	16,000	2,117.00	33,872,000	貸付株式数	6,300株
エムスリー	121,500	1,957.00	237,775,500	貸付株式数	48,200株
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	3,800	607.00	2,306,600	貸付株式数	1,400株
ブラス	500	615.00	307,500	貸付株式数	200株
アウトソーシング	30,400	1,152.00	35,020,800	貸付株式数	12,000株
ウェルネット	5,700	1,014.00	5,779,800	貸付株式数	2,300株

ワールドホールディングス	1,600	1,572.00	2,515,200	貸付株式数	600株
ディー・エヌ・エー	31,100	2,176.00	67,673,600		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	80,200	1,760.00	141,152,000		
ぐるなび	8,200	584.00	4,788,800	貸付株式数	3,200株
タカミヤ	6,100	764.00	4,660,400	貸付株式数	2,300株
ジャパンベストレスキューＳ	4,400	1,227.00	5,398,800	貸付株式数	500株
ファンコミュニケーションズ	15,900	541.00	8,601,900	貸付株式数	6,300株
ライク	2,300	1,243.00	2,858,900	貸付株式数	800株
ビジネス・ブレークスルー	2,300	342.00	786,600	貸付株式数	900株
ＷＤＢホールディングス	2,600	2,540.00	6,604,000		
ティア	3,200	641.00	2,051,200		
ＣＤＧ	500	1,295.00	647,500	貸付株式数	100株
バリューコマース	3,900	2,369.00	9,239,100	貸付株式数	1,500株 (1,300株)
インフォマート	31,600	1,648.00	52,076,800	貸付株式数	12,500株
サッポロホールディングス	22,200	2,311.00	51,304,200	貸付株式数	8,800株
アサヒグループホールディン	127,000	4,856.00	616,712,000		
キリンＨＤ	274,400	2,298.50	630,708,400		
宝ホールディングス	45,400	1,142.00	51,846,800		
オエノンホールディングス	17,000	371.00	6,307,000		
養　命　酒	1,900	2,037.00	3,870,300		
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	46,400	2,649.00	122,913,600	貸付株式数	7,400株
サントリー食品インター	40,600	4,520.00	183,512,000		
ダイドーグループＨＤ	3,400	4,590.00	15,606,000	貸付株式数	400株
伊　藤　園	18,400	5,200.00	95,680,000	貸付株式数	7,200株 (7,200株)
キーコーヒー	5,900	2,110.00	12,449,000	貸付株式数	2,100株
ユニカフェ	1,800	992.00	1,785,600		
ジャパンフーズ	800	1,192.00	953,600		
日清オイリオグループ	7,800	3,195.00	24,921,000	貸付株式数	1,100株
不二製油グループ	14,800	3,200.00	47,360,000		
かどや製油	600	4,180.00	2,508,000		
Ｊ－オイルミルズ	3,100	4,075.00	12,632,500	貸付株式数	1,200株
ローソン	15,100	5,110.00	77,161,000	貸付株式数	6,000株
サンエー	4,500	4,305.00	19,372,500	貸付株式数	1,700株
カワチ薬品	4,600	1,941.00	8,928,600	貸付株式数	1,800株

エービーシー・マート	9,300	6,740.00	62,682,000		
ハードオフコーポレーション	2,300	699.00	1,607,700	貸付株式数	800株
高千穂交易	2,200	992.00	2,182,400	貸付株式数	800株
アスクル	6,200	2,646.00	16,405,200	貸付株式数	1,600株
ゲオホールディングス	9,000	1,398.00	12,582,000	貸付株式数	3,000株
アダストリア	8,200	2,434.00	19,958,800	貸付株式数	3,200株
ジーフット	3,900	645.00	2,515,500	貸付株式数	1,100株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	800	666.00	532,800	貸付株式数	200株
伊藤忠食品	1,500	4,430.00	6,645,000		
くら寿司	3,500	4,280.00	14,980,000	貸付株式数	1,300株
キャンドゥ	2,800	1,633.00	4,572,400	貸付株式数	1,100株 (600株)
エレマテック	5,500	1,023.00	5,626,500	貸付株式数	1,800株
パルグループＨＬＤＧＳ	3,000	3,300.00	9,900,000	貸付株式数	100株
ＪＡＬＵＸ	1,700	2,846.00	4,838,200		
エディオン	25,200	970.00	24,444,000	貸付株式数	10,000株
あらた	4,400	3,825.00	16,830,000	貸付株式数	500株
サーラコーポレーション	12,000	578.00	6,936,000	貸付株式数	1,900株
ワッツ	2,500	709.00	1,772,500	貸付株式数	1,000株
トーメンデバイス	900	2,230.00	2,007,000	貸付株式数	200株
ハローズ	2,200	2,148.00	4,725,600		
ＪＰホールディングス	16,300	281.00	4,580,300	貸付株式数	6,400株 (2,000株)
フジオフードシステム	2,500	2,789.00	6,972,500	貸付株式数	900株
あみやき亭	1,300	3,335.00	4,335,500	貸付株式数	300株
東京エレクトロンデバイス	2,100	1,864.00	3,914,400		
ひらまつ	11,700	349.00	4,083,300	貸付株式数	4,600株
フィールズ	5,200	515.00	2,678,000	貸付株式数	1,800株
双日	328,400	349.00	114,611,600		
アルフレッサホールディングス	66,100	2,766.00	182,832,600	貸付株式数	23,900株
大黒天物産	1,400	3,535.00	4,949,000		
ハニーズホールディングス	5,600	1,006.00	5,633,600	貸付株式数	2,000株
ファーマライズＨＤ	1,400	518.00	725,200	貸付株式数	500株 (500株)
キッコーマン	40,000	4,675.00	187,000,000		
味　の　素	134,000	1,847.00	247,498,000	貸付株式数	20,500株
キユーピー	33,800	2,453.00	82,911,400	貸付株式数	13,400株

ハウス食品Ｇ本社	22,700	4,345.00	98,631,500	貸付株式数	5,000株
カ　ゴ　メ	24,300	2,540.00	61,722,000	貸付株式数	9,600株
焼津水産化工	2,900	1,100.00	3,190,000		
アリアケジャパン	5,500	6,840.00	37,620,000	貸付株式数	2,200株
ピエトロ	700	1,605.00	1,123,500	貸付株式数	200株
エバラ食品工業	1,400	2,133.00	2,986,200		
ニチレイ	31,500	2,651.00	83,506,500		
横浜冷凍	16,700	931.00	15,547,700	貸付株式数	5,400株
東洋水産	31,200	4,290.00	133,848,000	貸付株式数	10,500株
イートアンド	2,000	1,649.00	3,298,000	貸付株式数	800株
大冷	700	1,814.00	1,269,800	貸付株式数	100株
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	1,600	897.00	1,435,200	貸付株式数	600株
日清食品ＨＤ	25,800	6,590.00	170,022,000	貸付株式数	9,500株
永谷園ホールディングス	3,200	2,237.00	7,158,400	貸付株式数	900株
一正蒲鉾	2,300	1,137.00	2,615,100	貸付株式数	900株
フジッコ	6,600	2,142.00	14,137,200	貸付株式数	2,500株
ロックフィールド	6,500	1,598.00	10,387,000	貸付株式数	2,500株 (2,500株)
日本たばこ産業	350,200	2,500.00	875,500,000		
ケンコーマヨネーズ	3,400	2,322.00	7,894,800	貸付株式数	300株
わらべや日洋ＨＤ	3,900	1,635.00	6,376,500		
なとり	3,300	1,577.00	5,204,100		
イフジ産業	1,000	650.00	650,000	貸付株式数	300株
ピックルスコーポレーション	1,400	1,904.00	2,665,600		
北の達人コーポ	23,800	596.00	14,184,800	貸付株式数	9,400株 (2,100株)
ユーグレナ	25,900	899.00	23,284,100	貸付株式数	9,600株 (5,800株)
片倉工業	7,200	1,250.00	9,000,000		
グ　ン　ゼ	4,000	4,695.00	18,780,000	貸付株式数	1,400株
ヒューリック	123,900	861.00	106,677,900	貸付株式数	100株
神　栄	700	771.00	539,700		
ラサ商事	3,200	789.00	2,524,800		
アルペン	4,600	1,668.00	7,672,800	貸付株式数	1,800株
ハブ	1,900	1,315.00	2,498,500		
ラクーンホールディングス	3,400	648.00	2,203,200		
クオールホールディングス	8,800	1,450.00	12,760,000	貸付株式数	3,400株

アルコニックス	6,300	1,343.00	8,460,900	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
神戸物産	9,000	4,940.00	44,460,000	貸付株式数	3,500株
ソリトンシステムズ	3,300	937.00	3,092,100	貸付株式数	600株
ジンズ	3,200	6,520.00	20,864,000	貸付株式数	100株
ビックカメラ	35,300	1,120.00	39,536,000	貸付株式数	14,000株
ＤＣＭホールディングス	32,100	1,098.00	35,245,800	貸付株式数	12,700株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	4,700	1,918.00	9,014,600	貸付株式数	1,800株 (300株)
ＭｏｎｏｔａＲＯ	37,600	2,372.00	89,187,200	貸付株式数	14,900株
東京一番フーズ	1,400	601.00	841,400	貸付株式数	500株 (500株)
ＤＤホールディングス	1,300	1,938.00	2,519,400	貸付株式数	500株
あい　ホールディングス	8,700	1,677.00	14,589,900	貸付株式数	3,300株
ディーブイエックス	2,300	799.00	1,837,700		
きちりホールディングス	1,500	728.00	1,092,000	貸付株式数	600株
アークランドサービスＨＤ	4,300	1,889.00	8,122,700	貸付株式数	1,700株
Ｊ．　フロント　リテイリング	76,100	1,161.00	88,352,100		
ドトール・日レスＨＤ	10,500	2,083.00	21,871,500	貸付株式数	300株
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	24,600	3,235.00	79,581,000		
ブロンコビリー	3,100	2,212.00	6,857,200	貸付株式数	1,400株 (900株)
ＺＯＺＯ	64,300	1,805.00	116,061,500	貸付株式数	25,400株
トレジャー・ファクトリー	1,700	838.00	1,424,600	貸付株式数	200株
物語コーポレーション	1,500	8,650.00	12,975,000	貸付株式数	500株
ココカラファイン	6,700	5,250.00	35,175,000		
三越伊勢丹ＨＤ	111,300	930.00	103,509,000		
東洋紡	25,100	1,234.00	30,973,400		
ユニチカ	17,400	366.00	6,368,400		
富士紡ホールディングス	3,100	2,284.00	7,080,400	貸付株式数	1,100株
日清紡ホールディングス	33,600	775.00	26,040,000		
倉敷紡績	5,600	1,958.00	10,964,800	貸付株式数	600株
ダイワボウＨＤ	5,400	4,675.00	25,245,000	貸付株式数	2,000株
シキボウ	3,200	938.00	3,001,600	貸付株式数	1,200株
日東紡績	9,000	2,049.00	18,441,000		
トヨタ紡織	21,200	1,409.00	29,870,800	貸付株式数	7,700株
マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	16,500	1,365.00	22,522,500	貸付株式数	6,500株

Ｈａｍｅｅ	1,800	634.00	1,141,200	貸付株式数	600株
ラクト・ジャパン	2,600	4,195.00	10,907,000	貸付株式数	500株 (500株)
ウエルシアＨＤ	15,700	4,060.00	63,742,000	貸付株式数	6,200株
クリエイトＳＤＨ	8,800	2,405.00	21,164,000	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
バイタルＫＳＫＨＤ	11,100	1,048.00	11,632,800	貸付株式数	800株
八洲電機	5,400	807.00	4,357,800	貸付株式数	1,400株
メディアスホールディングス	3,300	716.00	2,362,800	貸付株式数	1,300株
レスターホールディングス	6,500	1,508.00	9,802,000		
ジューテックＨＤ	1,300	927.00	1,205,100	貸付株式数	500株
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	6,600	373.00	2,461,800	貸付株式数	2,600株
大光	2,400	639.00	1,533,600	貸付株式数	500株
ＯＣＨＩホールディングス	1,800	1,177.00	2,118,600	貸付株式数	100株
ＴＯＫＡＩホールディングス	31,500	887.00	27,940,500	貸付株式数	5,200株
黒谷	1,300	450.00	585,000	貸付株式数	400株
ミサワ	1,000	406.00	406,000		
ティーライフ	800	829.00	663,200	貸付株式数	300株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,000	848.00	848,000		
エー・ピーカンパニー	900	434.00	390,600		
三洋貿易	3,000	2,274.00	6,822,000	貸付株式数	1,000株
チムニー	1,800	2,451.00	4,411,800	貸付株式数	700株
シュッピン	4,000	798.00	3,192,000	貸付株式数	200株
ビューティガレージ	900	1,232.00	1,108,800	貸付株式数	300株
ウイン・パートナーズ	3,800	1,057.00	4,016,600	貸付株式数	1,300株
ネクステージ	9,500	1,165.00	11,067,500		
ジョイフル本田	17,500	1,268.00	22,190,000	貸付株式数	6,900株
鳥貴族	1,900	1,945.00	3,695,500	貸付株式数	900株
キリン堂ホールディングス	2,300	1,633.00	3,755,900	貸付株式数	900株
ホットランド	3,100	1,563.00	4,845,300	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
すかいらーくＨＤ	55,500	1,927.00	106,948,500	貸付株式数	22,000株 (2,800株)
ＳＦＰホールディングス	2,500	1,865.00	4,662,500		
綿半ホールディングス	2,200	2,368.00	5,209,600	貸付株式数	700株
日本毛織	19,700	857.00	16,882,900	貸付株式数	2,200株
ダイトウボウ	12,700	82.00	1,041,400	貸付株式数	3,700株
トーア紡コーポレーション	2,600	443.00	1,151,800		

ダイドーリミテツド	6,900	313.00	2,159,700	貸付株式数	2,700株 (200株)
ヨシックス	1,000	2,368.00	2,368,000	貸付株式数	300株 (200株)
ユナイテッド・スーパーマーケ	17,300	962.00	16,642,600	貸付株式数	6,800株
三栄建築設計	2,600	1,460.00	3,796,000	貸付株式数	900株
野村不動産ＨＬＤＧＳ	39,500	2,274.00	89,823,000		
三重交通グループＨＤ	12,500	601.00	7,512,500	貸付株式数	4,300株 (1,000株)
サムティ	8,300	1,429.00	11,860,700	貸付株式数	1,000株
エー・ディー・ワークス	96,100	34.00	3,267,400	貸付株式数	34,100株
日本商業開発	4,100	1,480.00	6,068,000	貸付株式数	1,900株
プレサンスコーポレーション	9,600	1,414.00	13,574,400	貸付株式数	3,700株
ユニゾホールディングス	8,800	1,838.00	16,174,400	貸付株式数	200株
日本管理センター	4,100	1,128.00	4,624,800	貸付株式数	800株
サンセイランディック	1,900	726.00	1,379,400	貸付株式数	600株
エストラスト	1,300	709.00	921,700	貸付株式数	300株
フージャースＨＤ	13,400	599.00	8,026,600	貸付株式数	6,000株
オープンハウス	8,600	4,535.00	39,001,000	貸付株式数	3,800株
東急不動産ＨＤ	159,700	613.00	97,896,100		
飯田ＧＨＤ	49,400	1,749.00	86,400,600	貸付株式数	1,900株
イーグランド	1,100	648.00	712,800		
帝国繊維	6,600	2,272.00	14,995,200		
日本コークス工業	50,200	93.00	4,668,600		
ゴルフダイジェスト・オン	2,400	698.00	1,675,200	貸付株式数	900株
ミタチ産業	1,700	683.00	1,161,100		
ＢＥＥＮＯＳ	2,100	1,820.00	3,822,000		
あさひ	4,900	1,298.00	6,360,200	貸付株式数	1,900株
日本調剤	2,100	3,515.00	7,381,500	貸付株式数	300株
コスモス薬品	2,600	17,650.00	45,890,000	貸付株式数	1,000株
シップヘルスケアＨＤ	12,400	4,590.00	56,916,000	貸付株式数	4,100株
トーエル	2,800	715.00	2,002,000	貸付株式数	100株
ソフトクリエイトＨＤ	2,500	1,576.00	3,940,000	貸付株式数	800株
オンリー	1,000	805.00	805,000	貸付株式数	300株
セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ	249,500	3,704.00	924,148,000	貸付株式数	54,000株
薬王堂	2,600	2,212.00	5,751,200	貸付株式数	800株
クリエイト・レストランツ・ホール	16,000	1,439.00	23,024,000	貸付株式数	100株

明治電機工業	1,800	1,344.00	2,419,200	貸付株式数	600株
ツルハホールディングス	12,900	8,870.00	114,423,000	貸付株式数	5,100株
デリカフーズＨＬＤＧＳ	1,000	1,495.00	1,495,000	貸付株式数	400株
スターティアホールディングス	1,100	528.00	580,800		
サンマルクホールディングス	4,700	2,374.00	11,157,800	貸付株式数	1,400株
フェリシモ	1,300	969.00	1,259,700	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	7,300	1,928.00	14,074,400	貸付株式数	2,900株 (800株)
帝　人	48,300	1,778.00	85,877,400	貸付株式数	7,200株
東　レ	459,100	766.70	351,991,970		
ク　ラ　レ	99,800	1,332.00	132,933,600		
旭　化　成	421,000	1,111.50	467,941,500		
サカイ　オーベックス	1,400	1,688.00	2,363,200		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	5,300	855.00	4,531,500		
稲葉製作所	3,300	1,407.00	4,643,100	貸付株式数	1,100株
宮地エンジニアリングＧ	1,800	1,691.00	3,043,800		
トーカロ	15,400	745.00	11,473,000	貸付株式数	1,300株
アルファＣＯ	2,100	1,187.00	2,492,700		
ＳＵＭＣＯ	66,100	1,220.00	80,642,000	貸付株式数	8,600株
川田テクノロジーズ	1,300	8,090.00	10,517,000		
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	1,200	2,450.00	2,940,000	貸付株式数	400株 (400株)
信和	3,100	971.00	3,010,100		
ビーロット	1,200	2,054.00	2,464,800		
ファーストブラザーズ	1,600	1,043.00	1,668,800	貸付株式数	600株
ハウスドゥ	3,200	1,280.00	4,096,000	貸付株式数	1,200株
シーアールイー	2,300	953.00	2,191,900		
プロパティエージェント	800	888.00	710,400	貸付株式数	200株
ケイアイスター不動産	1,800	1,526.00	2,746,800	貸付株式数	600株
アグレ都市デザイン	1,000	453.00	453,000		
ジェイ・エス・ビー	200	3,535.00	707,000		
テンポイノベーション	600	1,563.00	937,800	貸付株式数	200株
グロバルリンクマネジメント	500	556.00	278,000		
住江織物	1,700	2,966.00	5,042,200	貸付株式数	500株
日本フエルト	3,200	465.00	1,488,000	貸付株式数	900株
イチカワ	800	1,380.00	1,104,000		

エコナックホールディングス	10,400	124.00	1,289,600	貸付株式数	4,100株
日東製網	600	1,376.00	825,600	貸付株式数	200株
芦森工業	1,200	1,580.00	1,896,000		
アツギ	4,800	925.00	4,440,000	貸付株式数	1,900株
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	900	802.00	721,800		
ジャパンミート	3,000	1,698.00	5,094,000	貸付株式数	1,100株
コメダホールディングス	13,800	2,081.00	28,717,800	貸付株式数	5,400株
サツドラホールディングス	1,000	1,887.00	1,887,000	貸付株式数	300株
デファクトスタンダード	400	345.00	138,000	貸付株式数	100株
アレンザホールディングス	3,200	846.00	2,707,200	貸付株式数	200株
バロックジャパン	4,800	901.00	4,324,800	貸付株式数	400株
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	5,900	6,960.00	41,064,000	貸付株式数	2,300株
ダイニック	2,400	755.00	1,812,000	貸付株式数	400株
共和レザー	3,600	803.00	2,890,800		
力の源ＨＤ	2,200	714.00	1,570,800	貸付株式数	800株
スシローグローバルＨＬＤＧＳ	6,500	7,400.00	48,100,000		
ＬＩＸＩＬビバ	5,000	1,207.00	6,035,000	貸付株式数	1,100株
セーレン	14,500	1,466.00	21,257,000		
ソトー	2,200	978.00	2,151,600		
東海染工	800	1,188.00	950,400		
小松マテーレ	9,700	787.00	7,633,900	貸付株式数	3,700株
ワコールホールディングス	17,300	2,764.00	47,817,200	貸付株式数	5,000株
ホギメディカル	7,300	3,440.00	25,112,000	貸付株式数	600株
レナウン	16,700	99.00	1,653,300	貸付株式数	6,600株
クラウディアＨＬＤＧＳ	1,400	501.00	701,400		
ＴＳＩホールディングス	21,800	653.00	14,235,400		
マツオカコーポレーション	1,900	2,622.00	4,981,800	貸付株式数	700株
ワールド	7,700	2,175.00	16,747,500		
ＴＩＳ	19,800	5,480.00	108,504,000		
ネオス	2,300	712.00	1,637,600	貸付株式数	800株
電算システム	2,200	3,835.00	8,437,000	貸付株式数	800株
グリー	40,700	514.00	20,919,800	貸付株式数	15,500株
コーエーテクモＨＤ	12,100	1,987.00	24,042,700		
三菱総合研究所	2,500	3,185.00	7,962,500	貸付株式数	900株
ボルテージ	1,200	528.00	633,600		
電算	700	1,996.00	1,397,200	貸付株式数	200株 (100株)
ＡＧＳ	3,300	676.00	2,230,800	貸付株式数	900株

ファインデックス	5,000	879.00	4,395,000		
ブレインパッド	1,200	7,290.00	8,748,000	貸付株式数	500株
ＫＬａｂ	10,600	781.00	8,278,600	貸付株式数	4,200株
ポールトゥウィン・ピットクル	7,800	1,052.00	8,205,600	貸付株式数	2,500株 (2,500株)
イーブックイニシアティブ	900	1,984.00	1,785,600		
ネクソン	151,300	1,633.00	247,072,900	貸付株式数	300株
アイスタイル	15,200	716.00	10,883,200	貸付株式数	6,000株
エムアップ	2,000	1,957.00	3,914,000	貸付株式数	800株 (800株)
エイチーム	4,000	1,532.00	6,128,000	貸付株式数	1,700株
エニグモ	2,100	2,765.00	5,806,500		
テクノスジャパン	4,900	558.00	2,734,200	貸付株式数	2,000株
ｅｎｉｓｈ	2,300	598.00	1,375,400	貸付株式数	800株
コロプラ	19,400	780.00	15,132,000	貸付株式数	7,100株 (4,500株)
オルトプラス	3,800	242.00	919,600	貸付株式数	1,500株
ブロードリーフ	29,300	539.00	15,792,700	貸付株式数	11,600株
クロス・マーケティングＧ	2,100	352.00	739,200	貸付株式数	800株
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	2,700	1,050.00	2,835,000	貸付株式数	1,100株
システム情報	2,900	815.00	2,363,500		
メディアドゥＨＬＤＧＳ	1,800	3,170.00	5,706,000		
じげん	8,400	739.00	6,207,600		
ブイキューブ	3,100	555.00	1,720,500	貸付株式数	100株
エンカレッジ・テクノロジ	700	882.00	617,400		
サイバーリンクス	900	1,092.00	982,800		
ディー・エル・イー	3,900	155.00	604,500		
フィックスターズ	6,300	1,808.00	11,390,400	貸付株式数	1,500株
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,100	1,638.00	5,077,800	貸付株式数	1,200株
オプティム	2,600	3,065.00	7,969,000	貸付株式数	1,000株
セレス	1,900	1,749.00	3,323,100	貸付株式数	700株
特種東海製紙	3,800	3,740.00	14,212,000		
ティーガイア	5,900	1,906.00	11,245,400	貸付株式数	1,500株
セック	900	3,235.00	2,911,500		
日本アジアグループ	6,400	358.00	2,291,200	貸付株式数	1,700株
豆蔵ホールディングス	4,000	1,245.00	4,980,000		
テクマトリックス	4,200	1,908.00	8,013,600	貸付株式数	1,200株
プロシップ	1,700	1,149.00	1,953,300	貸付株式数	600株

ガンホー・オンライン・エンター	142,900	333.00	47,585,700		
GMOペイメントゲートウェイ	9,800	7,430.00	72,814,000	貸付株式数	3,800株
ザッパラス	3,000	378.00	1,134,000	貸付株式数	800株
システムリサーチ	800	2,865.00	2,292,000		
インターネットイニシアティブ	9,600	2,105.00	20,208,000		
さくらインターネット	7,000	494.00	3,458,000		
ヴィンクス	2,000	1,253.00	2,506,000	貸付株式数	700株
GMOクラウド	1,300	3,090.00	4,017,000	貸付株式数	500株
ＳＲＡホールディングス	3,100	2,433.00	7,542,300		
ＭＩＮＯＲＩソリューションズ	1,100	1,652.00	1,817,200		
システムインテグレータ	1,600	664.00	1,062,400	貸付株式数	600株
朝日ネット	4,900	587.00	2,876,300	貸付株式数	1,500株
ｅＢＡＳＥ	3,500	1,054.00	3,689,000	貸付株式数	300株
アバント	2,100	1,972.00	4,141,200	貸付株式数	800株
アドソル日進	2,100	1,620.00	3,402,000	貸付株式数	800株
フリービット	4,000	1,008.00	4,032,000	貸付株式数	1,300株 (700株)
コムチュア	3,300	4,340.00	14,322,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
サイバーコム	1,000	1,943.00	1,943,000	貸付株式数	400株
アステリア	3,900	1,003.00	3,911,700		
王子ホールディングス	266,500	585.00	155,902,500		
日本製紙	28,300	1,926.00	54,505,800	貸付株式数	11,200株
三菱製紙	9,800	590.00	5,782,000	貸付株式数	2,400株
北越コーポレーション	39,200	550.00	21,560,000	貸付株式数	13,100株
中越パルプ	2,600	1,408.00	3,660,800	貸付株式数	800株
巴川製紙	1,900	926.00	1,759,400	貸付株式数	200株
大王製紙	28,900	1,249.00	36,096,100	貸付株式数	8,600株
阿波製紙	1,500	435.00	652,500	貸付株式数	600株 (100株)
マークラインズ	2,700	1,862.00	5,027,400		
メディカル・データ・ビジ	5,300	1,319.00	6,990,700	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
ｇｕｍｉ	7,500	572.00	4,290,000	貸付株式数	2,900株
ショーケース	1,200	539.00	646,800	貸付株式数	400株
モバイルファクトリー	1,600	1,412.00	2,259,200	貸付株式数	600株

テラスカイ	1,200	1,497.00	1,796,400	貸付株式数	300株
デジタル・インフォメーション	2,600	1,812.00	4,711,200	貸付株式数	1,000株
ＰＣＩホールディングス	1,200	2,016.00	2,419,200		
パイプドＨＤ	900	1,054.00	948,600	貸付株式数	300株
アイビーシー	1,000	1,277.00	1,277,000	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,100	915.00	1,006,500	貸付株式数	300株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	500	2,807.00	1,403,500	貸付株式数	100株
ランドコンピュータ	800	1,155.00	924,000		
ダブルスタンダード	500	4,290.00	2,145,000	貸付株式数	200株
オープンドア	2,900	2,946.00	8,543,400		
マイネット	1,900	743.00	1,411,700		
アカツキ	2,100	5,480.00	11,508,000	貸付株式数	800株
ベネフィットジャパン	400	834.00	333,600	貸付株式数	100株 (100株)
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	1,100	1,652.00	1,817,200	貸付株式数	400株
ＬＩＮＥ	18,000	3,050.00	54,900,000	貸付株式数	7,100株 (2,100株)
カナミックネットワーク	1,200	2,187.00	2,624,400	貸付株式数	400株
ノムラシステムコーポレーション	600	735.00	441,000		
レンゴー	61,000	855.00	52,155,000		
トーモク	3,600	1,757.00	6,325,200	貸付株式数	1,400株
ザ・パック	4,500	3,150.00	14,175,000	貸付株式数	1,700株
チェンジ	1,200	2,750.00	3,300,000	貸付株式数	400株
シンクロ・フード	2,500	583.00	1,457,500	貸付株式数	900株
オークネット	3,100	1,330.00	4,123,000	貸付株式数	100株
エイトレッド	600	1,993.00	1,195,800		
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,400	725.00	4,640,000	貸付株式数	2,500株
マクロミル	10,500	1,210.00	12,705,000		
ビーグリー	1,400	803.00	1,124,200	貸付株式数	400株
オロ	1,600	2,782.00	4,451,200	貸付株式数	400株
テモナ	700	433.00	303,100		
昭和電工	39,300	3,100.00	121,830,000	貸付株式数	15,600株
住友化学	465,800	481.00	224,049,800		
住友精化	2,900	3,430.00	9,947,000	貸付株式数	1,000株
日産化学	36,300	4,700.00	170,610,000		
ラサ工業	2,100	1,330.00	2,793,000	貸付株式数	1,100株

クレハ	5,500	7,100.00	39,050,000	貸付株式数	1,800株
多木化学	1,800	4,325.00	7,785,000	貸付株式数	600株
テイカ	4,800	2,295.00	11,016,000		
石原産業	11,300	1,074.00	12,136,200		
片倉コープアグリ	2,200	1,100.00	2,420,000		
日東エフシー	3,800	1,199.00	4,556,200		
日本曹達	9,300	2,722.00	25,314,600	貸付株式数	3,100株
東ソー	91,400	1,400.00	127,960,000		
トクヤマ	17,000	2,540.00	43,180,000		
セントラル硝子	12,900	2,536.00	32,714,400		
東亞合成	37,100	1,217.00	45,150,700		
大阪ソーダ	6,400	2,591.00	16,582,400	貸付株式数	2,500株
関東電化	13,900	738.00	10,258,200	貸付株式数	5,500株
デンカ	23,200	3,200.00	74,240,000		
イビデン	37,000	1,792.00	66,304,000	貸付株式数	14,700株
信越化学	104,300	9,218.00	961,437,400		
日本カーバイド	2,000	1,330.00	2,660,000		
堺　化　学	3,900	2,629.00	10,253,100		
第一稀元素化学工	6,300	823.00	5,184,900		
エア・ウォーター	48,400	1,694.00	81,989,600	貸付株式数	17,900株
大陽日酸	48,700	2,078.00	101,198,600	貸付株式数	19,400株
日本化学工業	2,000	1,795.00	3,590,000	貸付株式数	700株
東邦アセチレン	1,000	1,337.00	1,337,000	貸付株式数	300株
日本パーカライジング	32,300	1,267.00	40,924,100		
高圧ガス	9,500	824.00	7,828,000		
チタン工業	800	2,722.00	2,177,600	貸付株式数	200株
四国化成	9,900	1,059.00	10,484,100	貸付株式数	3,600株
戸田工業	1,300	2,178.00	2,831,400		
ステラ　ケミファ	3,400	2,855.00	9,707,000	貸付株式数	1,300株 (500株)
保土谷化学	2,000	2,703.00	5,406,000		
日本触媒	9,900	6,700.00	66,330,000	貸付株式数	3,900株
大日精化	4,900	3,070.00	15,043,000	貸付株式数	300株
カネカ	15,300	3,880.00	59,364,000		
協和発酵キリン	70,900	2,009.00	142,438,100		
三菱瓦斯化学	60,800	1,407.00	85,545,600		
三井化学	53,700	2,506.00	134,572,200		
ＪＳＲ	59,300	1,611.00	95,532,300		
東京応化工業	10,200	3,250.00	33,150,000		
大阪有機化学	5,400	968.00	5,227,200	貸付株式数	700株

三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	395,600	729.60	288,629,760	貸付株式数	161,600株
ＫＨネオケム	9,000	2,823.00	25,407,000	貸付株式数	3,500株
ダイセル	87,100	968.00	84,312,800		
住友ベークライト	10,200	3,850.00	39,270,000		
積水化学	129,400	1,617.00	209,239,800	貸付株式数	41,800株
日本ゼオン	53,400	1,080.00	57,672,000	貸付株式数	17,800株
アイカ工業	17,700	3,685.00	65,224,500		
宇部興産	29,900	2,173.00	64,972,700		
積水樹脂	9,800	2,050.00	20,090,000	貸付株式数	1,700株
タキロンシーアイ	12,800	652.00	8,345,600	貸付株式数	5,000株
旭有機材	4,000	1,414.00	5,656,000	貸付株式数	700株
日立化成	27,400	2,995.00	82,063,000	貸付株式数	10,800株 (10,800株)
ニチバン	3,100	2,332.00	7,229,200	貸付株式数	1,200株
リケンテクノス	16,300	495.00	8,068,500	貸付株式数	6,100株
大倉工業	3,000	1,756.00	5,268,000	貸付株式数	1,200株
積水化成品	8,800	738.00	6,494,400		
群栄化学	1,600	2,462.00	3,939,200		
タイガース　ポリマー	3,100	579.00	1,794,900	貸付株式数	100株
ミライアル	1,700	1,055.00	1,793,500		
ダイキアクシス	2,000	851.00	1,702,000		
ダイキョーニシカワ	12,500	851.00	10,637,500	貸付株式数	4,900株
竹本容器	2,100	1,126.00	2,364,600	貸付株式数	300株
森六ホールディングス	3,100	2,390.00	7,409,000		
日本化薬	37,600	1,288.00	48,428,800		
カーリットホールディングス	6,300	659.00	4,151,700	貸付株式数	500株
ＥＰＳホールディングス	8,700	1,832.00	15,938,400	貸付株式数	1,600株
ソルクシーズ	2,500	770.00	1,925,000		
レッグス	1,500	1,398.00	2,097,000	貸付株式数	100株
プレステージ・インター	10,800	1,508.00	16,286,400	貸付株式数	400株
フェイス	2,300	829.00	1,906,700	貸付株式数	400株
プロトコーポレーション	2,600	1,795.00	4,667,000		
ハイマックス	700	1,827.00	1,278,900		
アミューズ	3,500	2,554.00	8,939,000	貸付株式数	1,300株
野村総合研究所	37,700	5,280.00	199,056,000	貸付株式数	1,100株
ドリームインキュベータ	1,700	1,637.00	2,782,900		
サイバネットシステム	4,800	650.00	3,120,000	貸付株式数	1,500株
クイック	3,500	1,624.00	5,684,000		
ＴＡＣ	3,100	196.00	607,600	貸付株式数	1,200株

ＣＥホールディングス	1,600	950.00	1,520,000		
ケネディクス	50,800	528.00	26,822,400		
日本システム技術	900	1,499.00	1,349,100		
電通	70,300	3,735.00	262,570,500		
インテージホールディングス	7,600	956.00	7,265,600	貸付株式数	2,700株
テイクアンドギヴニーズ	2,200	1,073.00	2,360,600		
東邦システムサイエンス	1,800	911.00	1,639,800	貸付株式数	500株
ぴあ	1,600	4,940.00	7,904,000		
イオンファンタジー	1,800	2,280.00	4,104,000	貸付株式数	700株
ソースネクスト	23,000	429.00	9,867,000	貸付株式数	9,100株 (9,100株)
シーティーエス	6,500	664.00	4,316,000	貸付株式数	2,500株
ネクシィーズグループ	2,000	2,298.00	4,596,000	貸付株式数	600株
インフォコム	6,500	2,265.00	14,722,500		
メディカルシステムネットワーク	6,200	503.00	3,118,600	貸付株式数	1,600株
日本精化	4,900	1,295.00	6,345,500	貸付株式数	1,800株
扶桑化学工業	5,900	2,049.00	12,089,100		
トリケミカル	1,300	4,630.00	6,019,000		
ＦＩＧ	5,100	300.00	1,530,000	貸付株式数	1,000株
ＡＤＥＫＡ	29,100	1,608.00	46,792,800	貸付株式数	2,500株
日油	22,200	4,035.00	89,577,000		
ミヨシ油脂	2,800	1,115.00	3,122,000	貸付株式数	1,000株
新日本理化	11,300	201.00	2,271,300		
ハリマ化成グループ	5,000	1,024.00	5,120,000		
アルテリア・ネットワークス	6,500	1,121.00	7,286,500		
ヒト・コミュニケーションズＨＤ	1,300	1,678.00	2,181,400	貸付株式数	500株
花　王	146,700	8,296.00	1,217,023,200		
第一工業製薬	2,200	3,045.00	6,699,000		
石原ケミカル	1,600	1,511.00	2,417,600		
日華化学	2,100	862.00	1,810,200	貸付株式数	400株
ニイタカ	900	1,430.00	1,287,000	貸付株式数	200株
三洋化成	4,000	5,690.00	22,760,000	貸付株式数	1,500株
武田薬品	527,500	3,647.00	1,923,792,500		
アステラス製薬	552,400	1,516.50	837,714,600		
大日本住友製薬	44,800	2,172.00	97,305,600		
塩野義製薬	77,300	6,160.00	476,168,000		

田辺三菱製薬	63,200	1,291.00	81,591,200		
わかもと製薬	7,100	269.00	1,909,900	貸付株式数	1,200株
あすか製薬	7,400	1,199.00	8,872,600	貸付株式数	100株
日本新薬	15,800	7,790.00	123,082,000	貸付株式数	2,100株
ビオフエルミン製薬	1,000	2,292.00	2,292,000		
中外製薬	63,000	7,230.00	455,490,000		
科研製薬	10,900	5,200.00	56,680,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
エーザイ	72,300	6,348.00	458,960,400		
理研ビタミン	2,900	3,535.00	10,251,500	貸付株式数	600株
ロート製薬	31,000	2,980.00	92,380,000	貸付株式数	12,200株
小野薬品	142,700	1,928.00	275,125,600		
久光製薬	17,900	4,550.00	81,445,000		
有機合成薬品	6,700	229.00	1,534,300		
持田製薬	9,100	4,885.00	44,453,500	貸付株式数	1,800株
参天製薬	112,500	1,573.00	176,962,500		
扶桑薬品	2,100	2,048.00	4,300,800		
日本ケミファ	800	2,910.00	2,328,000		
ツムラ	18,700	3,060.00	57,222,000	貸付株式数	7,400株
日医工	15,900	1,235.00	19,636,500		
テ　ル　モ	171,000	3,090.00	528,390,000		
みらかホールディングス	16,100	2,569.00	41,360,900	貸付株式数	4,900株
キッセイ薬品工業	10,700	2,643.00	28,280,100		
生化学工業	11,700	1,217.00	14,238,900	貸付株式数	3,800株
栄研化学	10,600	1,824.00	19,334,400	貸付株式数	3,500株
日水製薬	2,500	1,204.00	3,010,000		
鳥居薬品	3,200	2,253.00	7,209,600	貸付株式数	1,200株
ＪＣＲファーマ	4,300	6,380.00	27,434,000	貸付株式数	900株
東和薬品	8,700	2,683.00	23,342,100	貸付株式数	3,400株
富士製薬工業	4,100	1,451.00	5,949,100	貸付株式数	100株
沢井製薬	12,400	5,830.00	72,292,000	貸付株式数	2,300株
ゼリア新薬工業	11,900	2,106.00	25,061,400	貸付株式数	4,700株
第一三共	172,900	5,888.00	1,018,035,200		
キョーリン製薬ＨＤ	13,400	1,933.00	25,902,200	貸付株式数	2,800株
大幸薬品	2,700	2,096.00	5,659,200		
ダイト	3,500	3,540.00	12,390,000	貸付株式数	100株
大塚ホールディングス	115,100	3,690.00	424,719,000		
大正製薬ＨＤ	13,500	8,910.00	120,285,000		
ペプチドリーム	30,300	5,490.00	166,347,000	貸付株式数	12,000株
大日本塗料	7,000	1,010.00	7,070,000		

日本ペイントＨＯＬＤ	48,800	4,300.00	209,840,000	貸付株式数	19,200株
関西ペイント	66,500	2,095.00	139,317,500	貸付株式数	26,400株
神東塗料	7,900	169.00	1,335,100	貸付株式数	1,000株
中国塗料	19,300	957.00	18,470,100	貸付株式数	7,600株
日本特殊塗料	4,400	1,199.00	5,275,600		
藤倉化成	8,200	580.00	4,756,000	貸付株式数	3,100株
太陽ホールディングス	4,800	3,360.00	16,128,000	貸付株式数	1,400株
ＤＩＣ	26,700	2,728.00	72,837,600		
サカタインクス	12,900	979.00	12,629,100	貸付株式数	5,100株
東洋インキＳＣホールディン	12,400	2,356.00	29,214,400	貸付株式数	4,900株
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	4,700	972.00	4,568,400		
アルプス技研	5,000	1,790.00	8,950,000	貸付株式数	300株
サニックス	10,000	214.00	2,140,000	貸付株式数	1,700株
ダイオーズ	1,300	1,372.00	1,783,600	貸付株式数	500株
日本空調サービス	6,500	675.00	4,387,500	貸付株式数	2,400株
オリエンタルランド	68,200	13,165.00	897,853,000	貸付株式数	27,000株
フォーカスシステムズ	3,900	841.00	3,279,900		
ダスキン	14,900	2,894.00	43,120,600	貸付株式数	5,700株
パーク２４	34,900	2,172.00	75,802,800	貸付株式数	13,800株
明光ネットワークジャパン	7,200	960.00	6,912,000	貸付株式数	2,800株
ファルコホールディングス	3,200	1,693.00	5,417,600	貸付株式数	700株
クレスコ	1,800	3,335.00	6,003,000		
フジ・メディア・ＨＤ	61,400	1,533.00	94,126,200		
秀英予備校	1,500	430.00	645,000	貸付株式数	600株
田谷	1,400	597.00	835,800	貸付株式数	400株
ラウンドワン	17,900	1,681.00	30,089,900	貸付株式数	7,100株
リゾートトラスト	24,400	1,686.00	41,138,400	貸付株式数	9,600株
オービック	20,600	12,800.00	263,680,000	貸付株式数	700株
ジャストシステム	8,400	3,445.00	28,938,000	貸付株式数	3,300株
ＴＤＣソフト	5,100	792.00	4,039,200	貸付株式数	1,800株
ヤフー	386,400	307.00	118,624,800	貸付株式数	400株
ビー・エム・エル	7,400	3,050.00	22,570,000	貸付株式数	900株
ワタベウェディング	1,000	552.00	552,000		
トレンドマイクロ	31,600	4,875.00	154,050,000		
りらいあコミュニケーショ	10,400	1,160.00	12,064,000	貸付株式数	3,800株 (3,800株)
ＩＤホールディングス	2,200	1,072.00	2,358,400		
リソー教育	29,200	440.00	12,848,000		
日本オラクル	12,000	7,750.00	93,000,000	貸付株式数	2,700株

早稲田アカデミー	1,600	763.00	1,220,800		
アルファシステムズ	1,900	2,830.00	5,377,000	貸付株式数	300株
フューチャー	8,000	1,888.00	15,104,000		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,400	1,620.00	7,128,000	貸付株式数	600株
ソフトバンク・テクノ	2,500	2,380.00	5,950,000	貸付株式数	900株
トーセ	1,600	833.00	1,332,800	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	70,500	2,074.00	146,217,000	貸付株式数	23,500株
オービックビジネスＣ	6,100	4,965.00	30,286,500	貸付株式数	100株
伊藤忠テクノソリュー	27,000	2,658.00	71,766,000		
アイティフォー	7,100	830.00	5,893,000	貸付株式数	600株
東京個別指導学院	2,000	937.00	1,874,000	貸付株式数	800株
東計電算	900	3,035.00	2,731,500		
サイバーエージェント	33,200	3,895.00	129,314,000	貸付株式数	14,100株
楽天	269,100	1,116.00	300,315,600	貸付株式数	100株
エックスネット	1,100	929.00	1,021,900		
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,199.00	4,076,600	貸付株式数	1,300株
テー・オー・ダブリュー	5,400	753.00	4,066,200	貸付株式数	2,000株
大塚商会	32,100	4,155.00	133,375,500	貸付株式数	100株
サイボウズ	6,900	1,143.00	7,886,700	貸付株式数	2,700株
ソフトブレーン	4,500	477.00	2,146,500	貸付株式数	1,800株
山田コンサルティングＧＰ	2,800	1,992.00	5,577,600		
セントラルスポーツ	2,100	3,220.00	6,762,000	貸付株式数	800株
パラカ	1,500	1,959.00	2,938,500	貸付株式数	800株
電通国際情報Ｓ	3,700	3,480.00	12,876,000		
デジタルガレージ	11,500	3,210.00	36,915,000	貸付株式数	4,500株
イーエムシステムズ	4,800	1,493.00	7,166,400	貸付株式数	1,900株
ウェザーニューズ	2,000	3,205.00	6,410,000	貸付株式数	700株 (700株)
ＣＩＪ	4,600	964.00	4,434,400	貸付株式数	1,200株
東洋ビジネスエンジ	600	2,128.00	1,276,800	貸付株式数	100株
日本エンタープライズ	5,800	167.00	968,600	貸付株式数	1,000株
ＷＯＷＯＷ	2,800	2,637.00	7,383,600		
スカラ	4,700	926.00	4,352,200	貸付株式数	1,400株
インテリジェント　ウェイブ	2,200	787.00	1,731,400		
フルキャストホールディングス	5,800	2,110.00	12,238,000	貸付株式数	2,200株
エン・ジャパン	8,400	3,905.00	32,802,000	貸付株式数	3,300株
富士フイルムＨＬＤＧＳ	125,500	5,266.00	660,883,000		

コニカミノルタ	132,000	975.00	128,700,000		
資　生　堂	120,100	7,805.00	937,380,500		
ライオン	84,200	2,122.00	178,672,400	貸付株式数	33,300株
高砂香料	4,100	3,165.00	12,976,500	貸付株式数	1,000株
マンダム	13,600	2,666.00	36,257,600	貸付株式数	5,300株 (2,900株)
ミルボン	7,500	5,180.00	38,850,000		
ファンケル	26,900	2,860.00	76,934,000	貸付株式数	4,100株
コーセー	10,200	17,320.00	176,664,000	貸付株式数	300株
コタ	3,200	1,161.00	3,715,200		
シーボン	700	2,383.00	1,668,100	貸付株式数	200株
ポーラ・オルビスＨＤ	25,800	3,070.00	79,206,000	貸付株式数	100株
ノエビアホールディングス	5,800	5,970.00	34,626,000		
アジュバンコスメジャパン	1,300	907.00	1,179,100	貸付株式数	500株
エステー	4,300	1,778.00	7,645,400	貸付株式数	1,700株
アグロカネショウ	2,400	2,092.00	5,020,800	貸付株式数	900株
コ　ニ　シ	10,600	1,579.00	16,737,400	貸付株式数	1,200株
長谷川香料	8,000	1,807.00	14,456,000	貸付株式数	1,400株
星光ＰＭＣ	4,300	734.00	3,156,200		
小林製薬	16,900	8,060.00	136,214,000	貸付株式数	6,700株 (4,300株)
荒川化学工業	5,400	1,298.00	7,009,200		
メック	4,100	1,081.00	4,432,100	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	2,000	2,376.00	4,752,000	貸付株式数	300株
タカラバイオ	15,800	2,076.00	32,800,800		
ＪＣＵ	7,800	2,015.00	15,717,000		
新田ゼラチン	3,900	700.00	2,730,000	貸付株式数	1,400株
ＯＡＴアグリオ	800	1,280.00	1,024,000		
デクセリアルズ	15,400	714.00	10,995,600	貸付株式数	300株
アース製薬	4,600	5,000.00	23,000,000	貸付株式数	1,800株
北興化学	6,500	491.00	3,191,500	貸付株式数	1,000株
大成ラミック	2,000	2,839.00	5,678,000		
クミアイ化学	24,900	763.00	18,998,700	貸付株式数	9,300株
日本農薬	11,900	415.00	4,938,500	貸付株式数	1,100株
富士興産	2,200	730.00	1,606,000	貸付株式数	300株
ニチレキ	7,700	1,016.00	7,823,200	貸付株式数	2,600株
ユシロ化学	3,100	1,326.00	4,110,600	貸付株式数	1,100株
ビーピー・カストロール	2,200	1,447.00	3,183,400		
富士石油	14,400	262.00	3,772,800	貸付株式数	5,700株

ＭＯＲＥＳＣＯ	2,400	1,424.00	3,417,600	貸付株式数	600株
出光興産	69,800	3,005.00	209,749,000		
ＪＸＴＧホールディングス	1,016,500	514.40	522,887,600		
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	17,500	2,240.00	39,200,000	貸付株式数	6,900株
横浜ゴム	35,000	1,930.00	67,550,000		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	31,000	1,424.00	44,144,000	貸付株式数	12,300株
ブリヂストン	185,700	4,191.00	778,268,700		
住友ゴム	54,300	1,231.00	66,843,300	貸付株式数	21,600株 (200株)
藤倉コンポジット	5,300	394.00	2,088,200		
オカモト	4,200	4,755.00	19,971,000		
アキレス	4,400	1,985.00	8,734,000		
フ　コ　ク	2,500	736.00	1,840,000		
ニッタ	6,800	3,120.00	21,216,000		
クリエートメディック	1,900	926.00	1,759,400	貸付株式数	100株
住友理工	11,700	828.00	9,687,600		
三ツ星ベルト	8,000	2,068.00	16,544,000	貸付株式数	2,700株
バンドー化学	11,500	952.00	10,948,000		
ＡＧＣ	59,700	3,635.00	217,009,500		
日本板硝子	28,900	732.00	21,154,800	貸付株式数	11,400株
石塚硝子	1,000	2,348.00	2,348,000	貸付株式数	300株
有沢製作所	9,400	811.00	7,623,400	貸付株式数	700株
日本山村硝子	2,400	1,489.00	3,573,600		
日本電気硝子	26,200	2,700.00	70,740,000		
オハラ	2,400	1,277.00	3,064,800		
住友大阪セメント	12,200	4,435.00	54,107,000		
太平洋セメント	38,200	3,300.00	126,060,000		
リソルホールディングス	600	3,840.00	2,304,000		
日本ヒユーム	5,900	724.00	4,271,600	貸付株式数	2,300株
日本コンクリート	12,900	290.00	3,741,000	貸付株式数	500株
三谷セキサン	2,800	2,933.00	8,212,400		
アジアパイルＨＤ	8,500	616.00	5,236,000	貸付株式数	2,900株
東海カーボン	54,900	1,081.00	59,346,900	貸付株式数	21,800株 (100株)
日本カーボン	2,900	4,060.00	11,774,000	貸付株式数	1,100株
東洋炭素	3,500	2,025.00	7,087,500	貸付株式数	1,400株
ノリタケ	3,600	4,635.00	16,686,000	貸付株式数	1,400株
ＴＯＴＯ	46,500	4,060.00	188,790,000		
日本碍子	73,800	1,504.00	110,995,200		

日本特殊陶業	51,000	1,983.00	101,133,000		
ダントーホールディングス	5,600	106.00	593,600		
ＭＡＲＵＷＡ	2,100	5,210.00	10,941,000	貸付株式数	800株
品川リフラクトリーズ	1,600	2,968.00	4,748,800	貸付株式数	600株
黒崎播磨	1,200	6,070.00	7,284,000	貸付株式数	400株 (400株)
ヨータイ	5,200	545.00	2,834,000	貸付株式数	1,900株
イソライト	3,100	457.00	1,416,700		
東京窯業	7,500	293.00	2,197,500		
ニッカトー	2,700	674.00	1,819,800		
フジミインコーポレーテッド	5,400	2,137.00	11,539,800		
クニミネ工業	2,600	802.00	2,085,200		
エーアンドエーマテリアル	1,100	995.00	1,094,500	貸付株式数	100株
ニチアス	16,500	1,929.00	31,828,500		
日本製鉄	277,800	1,850.50	514,068,900		
神戸製鋼所	109,400	691.00	75,595,400		
中山製鋼所	8,200	478.00	3,919,600	貸付株式数	1,800株
合同製鐵	2,900	2,071.00	6,005,900	貸付株式数	1,100株
ＪＦＥホールディングス	161,400	1,534.00	247,587,600		
東京製鐵	32,000	864.00	27,648,000		
共英製鋼	6,700	1,851.00	12,401,700	貸付株式数	2,400株
大和工業	12,700	3,095.00	39,306,500	貸付株式数	4,300株
東京鐵鋼	2,500	1,163.00	2,907,500	貸付株式数	900株
大阪製鐵	4,000	1,750.00	7,000,000		
淀川製鋼所	8,100	2,058.00	16,669,800	貸付株式数	2,800株
丸一鋼管	21,200	2,852.00	60,462,400		
モリ工業	1,800	1,933.00	3,479,400		
大同特殊鋼	9,800	3,975.00	38,955,000	貸付株式数	3,800株
日本高周波	2,100	463.00	972,300	貸付株式数	300株
日本冶金工	49,400	215.00	10,621,000	貸付株式数	19,600株
山陽特殊製鋼	7,500	1,510.00	11,325,000		
愛知製鋼	3,400	3,230.00	10,982,000	貸付株式数	1,100株
日立金属	64,400	1,130.00	72,772,000		
日本金属	1,400	868.00	1,215,200		
大平洋金属	4,000	2,244.00	8,976,000		
新日本電工	35,400	196.00	6,938,400	貸付株式数	14,100株
栗本鉄工所	3,100	1,345.00	4,169,500		
虹　技	800	1,247.00	997,600	貸付株式数	300株
日本鋳鉄管	500	635.00	317,500	貸付株式数	200株

日本製鋼所	18,100	1,728.00	31,276,800		
三菱製鋼	4,400	1,185.00	5,214,000		
日亜鋼業	8,400	329.00	2,763,600	貸付株式数	3,300株
日本精線	800	2,558.00	2,046,400		
エンビプロＨＤ	2,200	605.00	1,331,000	貸付株式数	800株
大紀アルミニウム	9,800	707.00	6,928,600	貸付株式数	3,500株
日本軽金属ＨＤ	163,100	238.00	38,817,800		
三井金属	16,100	2,416.00	38,897,600		
東邦亜鉛	3,300	2,430.00	8,019,000		
三菱マテリアル	39,500	2,917.00	115,221,500		
住友鉱山	81,800	2,907.50	237,833,500		
ＤＯＷＡホールディングス	14,000	3,460.00	48,440,000		
古河機金	9,800	1,362.00	13,347,600		
エス・サイエンス	26,400	64.00	1,689,600	貸付株式数	10,500株 (100株)
大阪チタニウム	6,900	1,728.00	11,923,200	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
東邦チタニウム	10,700	1,186.00	12,690,200	貸付株式数	4,200株
ＵＡＣＪ	9,100	1,783.00	16,225,300	貸付株式数	800株 (100株)
ＣＫサンエツ	1,100	2,872.00	3,159,200		
古河電工	17,200	3,030.00	52,116,000		
住友電工	223,500	1,344.00	300,384,000		
フジクラ	72,200	379.00	27,363,800		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	7,000	773.00	5,411,000	貸付株式数	1,400株
東京特殊電線	800	1,612.00	1,289,600		
タツタ電線	11,800	466.00	5,498,800		
カナレ電気	1,000	1,865.00	1,865,000	貸付株式数	300株
平河ヒューテック	2,400	1,174.00	2,817,600	貸付株式数	900株
リョービ	7,300	2,063.00	15,059,900	貸付株式数	1,500株
アーレステイ	7,200	534.00	3,844,800		
アサヒＨＤ	11,200	2,099.00	23,508,800	貸付株式数	3,500株
東洋製罐グループＨＤ	38,000	2,135.00	81,130,000		
ホッカンホールディングス	3,000	1,773.00	5,319,000		
コロナ	3,200	1,010.00	3,232,000	貸付株式数	600株
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	11,100	1,610.00	17,871,000	貸付株式数	1,200株
ＯＳＪＢ　ＨＤ	29,700	274.00	8,137,800		
駒井ハルテック	1,100	1,669.00	1,835,900		
高田機工	500	2,521.00	1,260,500		
三和ホールディングス	61,700	1,104.00	68,116,800	貸付株式数	22,800株

文化シヤッター	17,600	823.00	14,484,800	貸付株式数	6,900株
三協立山	8,300	1,174.00	9,744,200		
アルインコ	4,700	987.00	4,638,900	貸付株式数	600株
東洋シヤッター	1,400	569.00	796,600		
ＬＩＸＩＬグループ	88,200	1,449.00	127,801,800		
日本フイルコン	4,400	505.00	2,222,000	貸付株式数	1,700株
ノーリツ	13,300	1,403.00	18,659,900	貸付株式数	100株
長府製作所	6,100	2,204.00	13,444,400	貸付株式数	2,400株
リンナイ	10,700	7,140.00	76,398,000		
ユニプレス	11,700	1,762.00	20,615,400	貸付株式数	3,400株
ダイニチ工業	3,100	596.00	1,847,600	貸付株式数	200株
日東精工	8,200	575.00	4,715,000		
三洋工業	800	1,725.00	1,380,000		
岡　部	12,200	981.00	11,968,200	貸付株式数	4,800株
ジーテクト	6,600	1,513.00	9,985,800		
中国工業	900	514.00	462,600		
東　プ　レ	11,100	1,811.00	20,102,100	貸付株式数	3,200株
高周波熱錬	11,500	866.00	9,959,000	貸付株式数	4,500株
東京製綱	3,600	1,001.00	3,603,600	貸付株式数	1,300株
サンコール	3,200	518.00	1,657,600		
モリテックスチル	4,500	344.00	1,548,000		
パイオラックス	9,600	1,922.00	18,451,200	貸付株式数	1,100株
エイチワン	5,800	762.00	4,419,600	貸付株式数	400株
日本発条	59,500	851.00	50,634,500	貸付株式数	23,600株
中央発條	700	2,865.00	2,005,500	貸付株式数	200株
アドバネクス	800	1,707.00	1,365,600	貸付株式数	300株 (300株)
三浦工業	25,900	3,370.00	87,283,000	貸付株式数	10,200株
タ　ク　マ	21,800	1,406.00	30,650,800		
テクノプロ・ホールディング	11,600	5,500.00	63,800,000	貸付株式数	4,300株
アトラ	1,200	281.00	337,200	貸付株式数	400株
インターワークス	1,100	608.00	668,800		
アイ・アールジャパンＨＤ	2,300	2,545.00	5,853,500	貸付株式数	300株
ＫｅｅＰｅｒ技研	2,100	1,411.00	2,963,100	貸付株式数	800株 (700株)
ファーストロジック	1,200	544.00	652,800	貸付株式数	400株
三機サービス	1,200	1,141.00	1,369,200	貸付株式数	400株
Ｇｕｎｏｓｙ	4,000	1,890.00	7,560,000	貸付株式数	1,500株
デザインワン・ジャパン	1,200	288.00	345,600	貸付株式数	400株

イー・ガーディアン	2,900	1,773.00	5,141,700	貸付株式数	800株
リブセンス	3,100	254.00	787,400	貸付株式数	1,200株
ジャパンマテリアル	15,800	1,386.00	21,898,800		
ベクトル	7,000	1,099.00	7,693,000	貸付株式数	2,700株
ウチヤマホールディングス	3,000	533.00	1,599,000	貸付株式数	1,100株
チャームケアコーポレーション	1,800	1,547.00	2,784,600		
ライクキッズネクスト	1,300	900.00	1,170,000		
キャリアリンク	2,100	428.00	898,800	貸付株式数	100株
ＩＢＪ	3,900	893.00	3,482,700	貸付株式数	1,500株
アサンテ	2,200	2,093.00	4,604,600		
Ｎ・フィールド	3,700	723.00	2,675,100	貸付株式数	1,000株
バリューＨＲ	1,200	3,225.00	3,870,000		
Ｍ＆Ａキャピタルパートナー	2,000	5,690.00	11,380,000	貸付株式数	800株 (600株)
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,400	1,205.00	2,892,000		
ＥＲＩホールディングス	1,600	916.00	1,465,600		
アビスト	900	2,550.00	2,295,000	貸付株式数	300株 (200株)
シグマクシス	2,700	1,274.00	3,439,800	貸付株式数	1,000株
ウィルグループ	3,700	875.00	3,237,500		
エスクローＡＪ	7,800	263.00	2,051,400	貸付株式数	3,200株
日本ビューホテル	1,800	1,106.00	1,990,800		
リクルートホールディングス	413,600	3,426.00	1,416,993,600		
エラン	4,000	1,832.00	7,328,000	貸付株式数	400株
ツ　ガ　ミ	13,400	904.00	12,113,600	貸付株式数	5,300株
オークマ	7,600	5,400.00	41,040,000	貸付株式数	3,000株
東芝機械	6,800	2,322.00	15,789,600	貸付株式数	2,600株
アマダホールディングス	89,800	1,182.00	106,143,600		
アイダエンジニア	16,200	743.00	12,036,600		
滝澤鉄工所	1,800	1,429.00	2,572,200	貸付株式数	600株
ＦＵＪＩ	23,900	1,205.00	28,799,500	貸付株式数	9,400株
牧野フライス	7,000	3,935.00	27,545,000		
オーエスジー	29,500	2,091.00	61,684,500		
ダイジェット	600	1,243.00	745,800	貸付株式数	200株
旭ダイヤモンド	15,600	632.00	9,859,200	貸付株式数	5,900株
ＤＭＧ森精機	37,900	1,434.00	54,348,600	貸付株式数	14,800株
ソディツク	13,000	945.00	12,285,000	貸付株式数	5,100株

ディスコ	8,100	15,760.00	127,656,000	貸付株式数	3,200株
日東工器	3,300	2,149.00	7,091,700		
日進工具	1,800	2,159.00	3,886,200	貸付株式数	500株
パンチ工業	4,100	491.00	2,013,100	貸付株式数	1,600株
冨士ダイス	2,500	570.00	1,425,000	貸付株式数	500株
土木管理総合試験	2,500	453.00	1,132,500	貸付株式数	900株
ネットマーケティング	1,900	452.00	858,800		
日本郵政	473,200	1,220.00	577,304,000		
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	9,700	1,529.00	14,831,300	貸付株式数	3,800株
鎌倉新書	4,200	1,619.00	6,799,800	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	794.00	555,800		
一蔵	700	622.00	435,400		
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	1,300	1,648.00	2,142,400	貸付株式数	500株
グローバルキッズＣＯＭＰ	800	886.00	708,800	貸付株式数	300株
エボラブルアジア	2,500	2,238.00	5,595,000	貸付株式数	800株 (600株)
アトラエ	1,500	3,580.00	5,370,000	貸付株式数	400株
ストライク	2,200	1,956.00	4,303,200	貸付株式数	600株 (100株)
ソラスト	14,100	918.00	12,943,800		
セラク	1,700	587.00	997,900	貸付株式数	200株
インソース	2,200	2,480.00	5,456,000	貸付株式数	700株
豊田自動織機	48,900	5,770.00	282,153,000		
豊和工業	3,300	829.00	2,735,700	貸付株式数	300株
ＯＫＫ	2,400	719.00	1,725,600	貸付株式数	900株
石川製作所	1,400	1,423.00	1,992,200	貸付株式数	500株
東洋機械金属	4,200	586.00	2,461,200	貸付株式数	1,500株
津田駒工業	1,200	1,569.00	1,882,800		
エンシュウ	1,500	1,130.00	1,695,000		
島精機製作所	8,200	3,070.00	25,174,000	貸付株式数	3,200株
オプトラン	5,800	2,427.00	14,076,600	貸付株式数	2,200株
ＮＣホールディングス	1,800	471.00	847,800	貸付株式数	300株
イワキポンプ	2,500	1,038.00	2,595,000		
フリュー	4,700	1,023.00	4,808,100		
ヤマシンフィルタ	10,400	589.00	6,125,600	貸付株式数	4,100株 (1,800株)
日阪製作所	7,300	928.00	6,774,400	貸付株式数	100株

やまびこ	11,600	932.00	10,811,200	貸付株式数	2,700株
平田機工	2,800	5,390.00	15,092,000	貸付株式数	1,100株 (200株)
ペガサスミシン製造	5,500	546.00	3,003,000	貸付株式数	1,500株
マルマエ	2,400	719.00	1,725,600	貸付株式数	900株
タツモ	2,400	795.00	1,908,000		
ナブテスコ	32,900	2,830.00	93,107,000	貸付株式数	12,600株
三井海洋開発	6,300	2,870.00	18,081,000	貸付株式数	2,500株
レオン自動機	5,900	1,590.00	9,381,000		
ＳＭＣ	17,700	36,990.00	654,723,000	貸付株式数	4,300株
新川	4,400	362.00	1,592,800	貸付株式数	1,700株
ホソカワミクロン	2,100	4,695.00	9,859,500		
ユニオンツール	2,600	2,710.00	7,046,000	貸付株式数	1,000株
オイレス工業	8,400	1,541.00	12,944,400	貸付株式数	2,300株
日精エーエスビー	2,000	3,040.00	6,080,000	貸付株式数	800株
サト－ホールディングス	7,200	2,714.00	19,540,800		
技研製作所	5,200	3,285.00	17,082,000		
日本エアーテック	1,800	578.00	1,040,400		
カ　ワ　タ	1,600	1,049.00	1,678,400		
日精樹脂工業	5,000	909.00	4,545,000	貸付株式数	400株
オカダアイヨン	2,000	1,290.00	2,580,000	貸付株式数	500株
ワイエイシイホールディングス	2,300	828.00	1,904,400		
小松製作所	273,600	2,460.50	673,192,800	貸付株式数	108,800株
住友重機械	34,600	3,460.00	119,716,000		
日立建機	24,300	2,615.00	63,544,500		
日　工	1,600	2,625.00	4,200,000	貸付株式数	500株
巴工業	2,500	2,278.00	5,695,000		
井関農機	6,000	1,490.00	8,940,000	貸付株式数	900株
ＴＯＷＡ	5,100	781.00	3,983,100	貸付株式数	2,000株
丸山製作所	1,300	1,121.00	1,457,300		
北川鉄工所	2,700	2,074.00	5,599,800		
シンニッタン	9,100	340.00	3,094,000	貸付株式数	3,400株
ローツェ	2,600	2,153.00	5,597,800	貸付株式数	1,000株 (400株)
タカキタ	2,000	555.00	1,110,000	貸付株式数	800株
クボタ	323,800	1,697.00	549,488,600		
荏原実業	1,700	1,939.00	3,296,300	貸付株式数	200株
東洋エンジニア	7,900	464.00	3,665,600	貸付株式数	2,900株 (700株)

三菱化工機	2,000	1,482.00	2,964,000	貸付株式数	100株
月島機械	12,000	1,349.00	16,188,000	貸付株式数	4,400株
帝国電機製作所	4,200	1,203.00	5,052,600		
東京機械	2,400	428.00	1,027,200	貸付株式数	900株
新東工業	14,300	940.00	13,442,000	貸付株式数	2,100株
渋谷工業	5,300	2,916.00	15,454,800	貸付株式数	700株
アイチ　コーポレーション	10,400	697.00	7,248,800	貸付株式数	400株
小森コーポレーション	15,300	1,157.00	17,702,100	貸付株式数	900株
鶴見製作所	4,700	1,994.00	9,371,800		
住友精密	1,000	2,777.00	2,777,000		
酒井重工業	1,100	2,552.00	2,807,200	貸付株式数	400株
荏原製作所	26,800	2,876.00	77,076,800		
石井鉄工所	1,100	1,972.00	2,169,200	貸付株式数	100株
酉島製作所	6,200	1,026.00	6,361,200		
北越工業	6,200	1,237.00	7,669,400		
千代田化工建	48,800	311.00	15,176,800	貸付株式数	16,900株
ダイキン工業	82,400	13,345.00	1,099,628,000		
オルガノ	2,200	3,405.00	7,491,000	貸付株式数	700株
トーヨーカネツ	2,300	2,102.00	4,834,600	貸付株式数	700株
栗田工業	32,700	2,592.00	84,758,400		
椿本チエイン	7,900	3,425.00	27,057,500		
大同工業	2,800	816.00	2,284,800		
日　機　装	19,500	1,429.00	27,865,500	貸付株式数	7,700株
木村化工機	4,900	340.00	1,666,000	貸付株式数	1,400株
新興プランテック	12,100	1,272.00	15,391,200	貸付株式数	4,000株
アネスト岩田	9,400	1,001.00	9,409,400	貸付株式数	3,500株
ダイフク	33,300	5,610.00	186,813,000		
サムコ	1,600	792.00	1,267,200	貸付株式数	200株
加藤製作所	3,000	1,978.00	5,934,000		
油研工業	1,000	1,655.00	1,655,000	貸付株式数	200株
タダノ	29,200	1,080.00	31,536,000	貸付株式数	11,500株
フジテック	22,000	1,447.00	31,834,000	貸付株式数	6,400株
ＣＫＤ	16,800	1,049.00	17,623,200	貸付株式数	700株
キトー	4,600	1,600.00	7,360,000		
平和	16,800	2,189.00	36,775,200		
理想科学工業	5,300	1,768.00	9,370,400	貸付株式数	1,900株
ＳＡＮＫＹＯ	15,100	4,165.00	62,891,500	貸付株式数	5,100株
日本金銭機械	6,600	1,110.00	7,326,000	貸付株式数	2,600株 (2,100株)
マースグループＨＬＤＧＳ	3,800	2,091.00	7,945,800		

福島工業	3,800	3,595.00	13,661,000	貸付株式数	400株
オーイズミ	2,800	380.00	1,064,000	貸付株式数	600株
ダイコク電機	2,800	1,327.00	3,715,600	貸付株式数	1,100株
竹内製作所	10,100	1,838.00	18,563,800		
ア　マ　ノ	17,300	2,881.00	49,841,300	貸付株式数	5,800株
ＪＵＫＩ	8,400	950.00	7,980,000	貸付株式数	600株
サンデンホールディングス	7,300	530.00	3,869,000	貸付株式数	700株
蛇の目ミシン	5,600	435.00	2,436,000	貸付株式数	1,800株
ブラザー工業	78,700	1,895.00	149,136,500		
マックス	9,200	1,511.00	13,901,200	貸付株式数	2,300株
モリタホールディングス	10,600	1,884.00	19,970,400	貸付株式数	3,800株
グローリー	16,700	2,776.00	46,359,200	貸付株式数	2,600株
新晃工業	5,500	1,647.00	9,058,500	貸付株式数	2,200株
大和冷機工業	8,700	1,214.00	10,561,800	貸付株式数	3,400株
セガサミーホールディングス	59,900	1,246.00	74,635,400		
日本ピストンリング	2,100	1,381.00	2,900,100		
リ　ケ　ン	2,800	4,375.00	12,250,000	貸付株式数	400株
ＴＰＲ	8,100	1,895.00	15,349,500	貸付株式数	2,700株
ツバキ・ナカシマ	9,200	1,704.00	15,676,800	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,600	7,910.00	139,216,000	貸付株式数	7,000株
大豊工業	4,800	831.00	3,988,800		
日本精工	124,200	912.00	113,270,400		
Ｎ　Ｔ　Ｎ	130,100	302.00	39,290,200	貸付株式数	51,600株
ジェイテクト	58,000	1,222.00	70,876,000		
不　二　越	5,600	4,365.00	24,444,000	貸付株式数	2,200株
ミネベアミツミ	112,200	1,669.00	187,261,800		
日本トムソン	17,900	449.00	8,037,100		
Ｔ　Ｈ　Ｋ	37,700	2,297.00	86,596,900	貸付株式数	100株
ユーシン精機	4,700	1,072.00	5,038,400		
前澤給装工業	2,400	1,965.00	4,716,000	貸付株式数	900株
イーグル工業	7,500	1,061.00	7,957,500	貸付株式数	2,000株
前澤工業	4,300	338.00	1,453,400		
日本ピラー工業	6,100	1,091.00	6,655,100	貸付株式数	1,000株
キッツ	24,500	757.00	18,546,500	貸付株式数	9,700株
日　立	272,000	3,789.00	1,030,608,000		
三菱電機	604,100	1,402.50	847,250,250		
富士電機	39,200	3,685.00	144,452,000		
東洋電機製造	2,700	1,281.00	3,458,700	貸付株式数	200株

安川電機	70,100	3,305.00	231,680,500	貸付株式数	21,200株
シンフォニア　テクノロジー	8,300	1,183.00	9,818,900	貸付株式数	3,300株
明　電　舎	11,800	1,558.00	18,384,400		
オリジン	1,600	1,441.00	2,305,600		
山洋電気	2,900	3,945.00	11,440,500		
デンヨー	5,800	1,358.00	7,876,400		
ベイカレントコンサルティング	4,100	3,670.00	15,047,000		
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	900	1,282.00	1,153,800		
アイモバイル	1,800	832.00	1,497,600	貸付株式数	600株
キャリアインデックス	2,000	764.00	1,528,000	貸付株式数	700株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2,300	1,588.00	3,652,400	貸付株式数	900株
船場	900	934.00	840,600		
グレイステクノロジー	2,100	2,715.00	5,701,500	貸付株式数	100株
ジャパンエレベーターＳＨＤ	4,500	2,108.00	9,486,000	貸付株式数	1,800株
フルテック	700	1,169.00	818,300		
グリーンズ	2,100	1,510.00	3,171,000		
ツナググループＨＬＤＧＳ	600	503.00	301,800		
ソウルドアウト	600	2,403.00	1,441,800		
ＭＳ&ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	900	1,048.00	943,200	貸付株式数	300株
日総工産	4,200	1,407.00	5,909,400	貸付株式数	1,000株
キュービーネットＨＬＤＧＳ	3,500	2,348.00	8,218,000	貸付株式数	1,300株 (1,000株)
ＲＰＡホールディングス	1,200	5,350.00	6,420,000		
三桜工業	7,500	412.00	3,090,000		
マキタ	73,600	3,820.00	281,152,000	貸付株式数	27,400株
東芝テック	7,600	2,735.00	20,786,000	貸付株式数	2,500株
芝浦メカトロニクス	1,100	2,604.00	2,864,400		
マブチモーター	16,700	3,690.00	61,623,000		
日本電産	72,700	13,665.00	993,445,500	貸付株式数	28,800株
ユーエムシーエレクトロニクス	3,200	1,129.00	3,612,800		
トレックス・セミコンダクター	2,700	1,149.00	3,102,300	貸付株式数	1,000株
東光高岳	3,400	1,160.00	3,944,000	貸付株式数	1,200株

ダブル・スコープ	8,800	1,384.00	12,179,200	貸付株式数	3,400株 (700株)
宮越ホールディングス	2,400	851.00	2,042,400	貸付株式数	800株
ダイヘン	6,500	2,981.00	19,376,500		
ヤーマン	8,800	945.00	8,316,000	貸付株式数	3,400株
ＪＶＣケンウッド	46,000	228.00	10,488,000		
ミマキエンジニアリング	5,300	608.00	3,222,400	貸付株式数	2,100株
第一精工	2,500	1,435.00	3,587,500	貸付株式数	1,000株
日新電機	14,100	1,125.00	15,862,500		
大崎電気	12,400	705.00	8,742,000		
オムロン	64,200	5,390.00	346,038,000	貸付株式数	25,400株
日東工業	9,900	1,903.00	18,839,700	貸付株式数	3,300株
ＩＤＥＣ	8,100	1,980.00	16,038,000	貸付株式数	2,400株
正興電機製作所	900	757.00	681,300		
不二電機工業	600	1,236.00	741,600		
ジーエス・ユアサ　コーポ	21,700	2,037.00	44,202,900		
サクサホールディングス	1,500	1,831.00	2,746,500		
メルコホールディングス	2,500	3,050.00	7,625,000	貸付株式数	600株
テクノメディカ	1,400	2,132.00	2,984,800	貸付株式数	200株
日本電気	78,200	3,975.00	310,845,000	貸付株式数	13,400株 (100株)
富　士　通	58,300	7,403.00	431,594,900		
沖　電　気	26,200	1,304.00	34,164,800		
岩崎通信機	2,800	783.00	2,192,400		
電気興業	3,200	2,635.00	8,432,000		
サンケン電気	7,100	2,186.00	15,520,600	貸付株式数	2,800株
ナカヨ	1,100	1,520.00	1,672,000		
アイホン	3,400	1,622.00	5,514,800	貸付株式数	800株
ルネサスエレクトロニクス	63,600	509.00	32,372,400		
セイコーエプソン	75,000	1,626.00	121,950,000		
ワコム	43,700	339.00	14,814,300	貸付株式数	17,300株
アルバック	12,100	3,150.00	38,115,000	貸付株式数	4,700株
アクセル	2,500	550.00	1,375,000	貸付株式数	900株
ＥＩＺＯ	5,500	3,900.00	21,450,000	貸付株式数	600株
ジャパンディスプレイ	141,700	60.00	8,502,000	貸付株式数	55,600株
日本信号	15,000	1,118.00	16,770,000		
京三製作所	12,400	361.00	4,476,400		
能美防災	7,900	2,091.00	16,518,900	貸付株式数	3,100株
ホーチキ	3,900	1,123.00	4,379,700	貸付株式数	1,400株
星和電機	3,000	509.00	1,527,000	貸付株式数	1,000株

エレコム	5,700	3,550.00	20,235,000	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
パナソニック	690,200	876.40	604,891,280		
シャープ	60,000	1,017.00	61,020,000	貸付株式数	23,800株
アンリツ	38,900	1,764.00	68,619,600	貸付株式数	15,400株
富士通ゼネラル	18,500	1,561.00	28,878,500	貸付株式数	7,300株
ソ　ニ　ー※	405,400	5,213.00	2,113,350,200		
Ｔ　Ｄ　Ｋ	31,600	7,650.00	241,740,000		
帝国通信工業	2,600	1,177.00	3,060,200		
タムラ製作所	23,200	555.00	12,876,000	貸付株式数	1,200株
アルプスアルパイン	62,900	1,829.00	115,044,100		
池上通信機	1,800	1,130.00	2,034,000	貸付株式数	900株
日本電波工業	5,400	470.00	2,538,000	貸付株式数	2,300株
鈴木	3,200	621.00	1,987,200	貸付株式数	1,200株
日本トリム	1,100	5,200.00	5,720,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド　ディー. ジー.	3,100	2,403.00	7,449,300	貸付株式数	200株
フオスター電機	7,000	1,540.00	10,780,000	貸付株式数	2,700株
Ｓ　Ｍ　Ｋ	1,700	2,653.00	4,510,100	貸付株式数	600株
ヨコオ	4,300	2,077.00	8,931,100		
ティアック	4,200	183.00	768,600	貸付株式数	1,600株
ホシデン	17,800	1,068.00	19,010,400	貸付株式数	7,000株
ヒロセ電機	8,700	11,990.00	104,313,000	貸付株式数	2,600株
日本航空電子	13,800	1,598.00	22,052,400	貸付株式数	5,500株
Ｔ　Ｏ　Ａ	6,500	1,299.00	8,443,500	貸付株式数	2,300株
マクセルホールディングス	13,000	1,816.00	23,608,000	貸付株式数	5,100株
古野電気	7,800	908.00	7,082,400	貸付株式数	3,000株
ユニデンホールディングス	1,700	1,801.00	3,061,700		
スミダコーポレーション	5,100	1,154.00	5,885,400	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
アイコム	3,300	2,236.00	7,378,800		
リオン	2,800	2,088.00	5,846,400	貸付株式数	1,000株
本多通信工業	5,000	490.00	2,450,000	貸付株式数	1,500株
船井電機	6,100	739.00	4,507,900	貸付株式数	1,900株 (1,800株)
横河電機	60,500	2,117.00	128,078,500		
新電元工業	2,100	3,545.00	7,444,500		
アズビル	38,800	2,589.00	100,453,200	貸付株式数	7,400株
東亜ディーケーケー	2,900	845.00	2,450,500		

日本光電工業	26,600	3,100.00	82,460,000		
チ　ノ　ー	2,000	1,173.00	2,346,000		
共和電業	6,300	412.00	2,595,600	貸付株式数	100株
日本電子材料	2,300	520.00	1,196,000	貸付株式数	900株
堀場製作所	12,000	5,130.00	61,560,000	貸付株式数	4,700株 (3,100株)
アドバンテスト	41,200	2,659.00	109,550,800		
小野測器	2,600	574.00	1,492,400		
エスペック	5,300	2,200.00	11,660,000	貸付株式数	1,000株
キーエンス	29,700	61,540.00	1,827,738,000		
日置電機	3,100	3,730.00	11,563,000	貸付株式数	1,200株
シスメックス	47,100	7,386.00	347,880,600	貸付株式数	1,300株
日本マイクロニクス	10,500	927.00	9,733,500	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
メガチップス	4,700	1,264.00	5,940,800	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,200	3,610.00	11,552,000	貸付株式数	1,100株
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	5,000	519.00	2,595,000	貸付株式数	1,100株
澤藤電機	700	1,643.00	1,150,100		
デンソー	133,100	4,357.00	579,916,700		
原田工業	2,400	750.00	1,800,000		
コーセル	8,000	1,062.00	8,496,000	貸付株式数	3,100株
イリソ電子工業	5,500	5,160.00	28,380,000	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	10,500	1,332.00	13,986,000	貸付株式数	4,200株
千代田インテグレ	2,600	2,035.00	5,291,000	貸付株式数	600株
アイ・オー・データ	2,400	1,064.00	2,553,600	貸付株式数	100株
レーザーテック	12,400	3,985.00	49,414,000	貸付株式数	3,000株
スタンレー電気	42,700	2,558.00	109,226,600	貸付株式数	6,000株
岩崎電気	2,800	1,346.00	3,768,800	貸付株式数	800株
ウシオ電機	35,100	1,375.00	48,262,500		
岡谷電機	4,300	380.00	1,634,000	貸付株式数	1,700株
ヘリオステクノＨ	5,500	602.00	3,311,000	貸付株式数	1,100株
エノモト	1,600	739.00	1,182,400	貸付株式数	600株
日本セラミック	6,100	2,841.00	17,330,100	貸付株式数	2,400株
遠藤照明	3,500	741.00	2,593,500		
古河電池	5,000	631.00	3,155,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
双信電機	2,900	520.00	1,508,000	貸付株式数	400株
山一電機	4,300	941.00	4,046,300		

図　研	3,900	1,586.00	6,185,400		
日本電子	11,900	2,251.00	26,786,900	貸付株式数	4,700株
カ　シ　オ	53,500	1,269.00	67,891,500		
ファナック	57,400	18,800.00	1,079,120,000		
日本シイエムケイ	15,300	674.00	10,312,200	貸付株式数	6,000株
エンプラス	2,700	3,140.00	8,478,000	貸付株式数	1,000株 (700株)
大真空	2,200	1,034.00	2,274,800		
ロ　ー　ム	28,900	7,070.00	204,323,000		
浜松ホトニクス	43,300	3,935.00	170,385,500		
三井ハイテック	6,600	1,091.00	7,200,600	貸付株式数	2,500株 (100株)
新光電気工業	20,300	898.00	18,229,400		
京　セ　ラ	92,100	6,866.00	632,358,600		
協栄産業	700	1,490.00	1,043,000	貸付株式数	100株
太陽誘電	26,900	2,007.00	53,988,300	貸付株式数	10,600株
村田製作所	190,200	4,628.00	880,245,600		
ユーシン	1,400	984.00	1,377,600		
双葉電子工業	9,800	1,420.00	13,916,000	貸付株式数	3,600株
日東電工	41,700	4,980.00	207,666,000		
北陸電気工業	2,100	944.00	1,982,400		
東海理化電機	15,900	1,716.00	27,284,400	貸付株式数	5,400株
ニチコン	18,900	804.00	15,195,600	貸付株式数	1,800株
日本ケミコン	4,300	1,608.00	6,914,400		
Ｋ　Ｏ　Ａ	9,100	1,309.00	11,911,900		
三井Ｅ＆ＳＨＤ	21,700	951.00	20,636,700		
日立造船	47,900	357.00	17,100,300	貸付株式数	18,600株
三菱重工業	101,200	4,776.00	483,331,200		
川崎重工業	47,000	2,491.00	117,077,000		
ＩＨＩ	46,400	2,516.00	116,742,400		
名村造船所	18,100	302.00	5,466,200	貸付株式数	7,100株
サノヤスホールディングス	7,900	201.00	1,587,900	貸付株式数	3,100株 (2,900株)
スプリックス	1,900	1,891.00	3,592,900	貸付株式数	200株
日本車輌	2,200	2,549.00	5,607,800		
三菱ロジスネクスト	7,200	1,183.00	8,517,600	貸付株式数	2,800株
近畿車輌	900	1,792.00	1,612,800		
ＦＰＧ	18,700	869.00	16,250,300	貸付株式数	6,900株
島根銀行	1,400	724.00	1,013,600	貸付株式数	200株
じもとホールディングス	40,000	95.00	3,800,000	貸付株式数	15,900株

全国保証	16,800	4,130.00	69,384,000	貸付株式数	6,600株
めぶきフィナンシャルG	309,800	275.00	85,195,000	貸付株式数	42,200株
東京きらぼしＦＧ	8,000	1,670.00	13,360,000		
九州フィナンシャルG	97,800	442.00	43,227,600		
かんぽ生命保険	22,500	2,067.00	46,507,500		
ゆうちょ銀行	168,900	1,099.00	185,621,100	貸付株式数	67,200株
富山第一銀行	13,800	309.00	4,264,200		
コンコルディア・フィナンシャル	374,000	422.00	157,828,000		
ジェイリース	1,500	321.00	481,500	貸付株式数	400株
西日本フィナンシャルＨＤ	37,500	820.00	30,750,000		
マーキュリアインベストメント	2,300	668.00	1,536,400	貸付株式数	800株
イントラスト	1,700	449.00	763,300	貸付株式数	500株
日本モーゲージサービス	1,000	1,107.00	1,107,000		
Ｃａｓａ	2,600	1,017.00	2,644,200		
アルヒ	5,400	1,907.00	10,297,800	貸付株式数	2,700株
プレミアグループ	3,400	1,906.00	6,480,400	貸付株式数	1,300株
日産自動車	712,700	762.90	543,718,830		
いすゞ自動車	191,000	1,279.50	244,384,500		
トヨタ自動車 ※	673,400	6,530.00	4,397,302,000		
日野自動車	75,500	893.00	67,421,500		
三菱自動車工業	223,800	529.00	118,390,200		
エフテック	4,200	753.00	3,162,600		
レシップホールディングス	3,900	753.00	2,936,700	貸付株式数	700株
ＧＭＢ	1,100	794.00	873,400		
ファルテック	1,000	730.00	730,000		
武蔵精密工業	14,700	1,406.00	20,668,200	貸付株式数	5,800株
日産車体	11,800	1,028.00	12,130,400	貸付株式数	4,600株
新明和工業	25,300	1,323.00	33,471,900	貸付株式数	9,100株
極東開発工業	12,000	1,367.00	16,404,000	貸付株式数	3,600株
日信工業	11,000	1,412.00	15,532,000		
トピー工業	5,000	2,423.00	12,115,000		
ティラド	2,200	1,887.00	4,151,400	貸付株式数	100株
タチエス	10,100	1,333.00	13,463,300	貸付株式数	2,900株
Ｎ　Ｏ　Ｋ	32,500	1,441.00	46,832,500	貸付株式数	12,900株
フタバ産業	16,800	557.00	9,357,600	貸付株式数	6,200株
ＫＹＢ	6,300	2,868.00	18,068,400		
市光工業	9,000	585.00	5,265,000		
大同メタル工業	9,800	643.00	6,301,400	貸付株式数	3,300株

プレス工業	29,900	481.00	14,381,900	貸付株式数	7,700株
ミクニ	7,500	379.00	2,842,500	貸付株式数	1,000株
太平洋工業	12,600	1,466.00	18,471,600	貸付株式数	4,900株
ケーヒン	13,900	1,471.00	20,446,900		
河西工業	7,400	773.00	5,720,200		
アイシン精機	49,800	3,745.00	186,501,000	貸付株式数	19,000株
マ　ツ　ダ	189,700	1,121.00	212,653,700		
今仙電機製作所	5,600	894.00	5,006,400	貸付株式数	700株
本田技研	509,800	2,795.00	1,424,891,000	貸付株式数	150,500株
スズキ	110,600	5,181.00	573,018,600	貸付株式数	43,800株
ＳＵＢＡＲＵ	187,600	2,592.00	486,259,200		
安永	2,900	1,492.00	4,326,800	貸付株式数	1,100株
ヤマハ発動機	85,400	1,931.00	164,907,400	貸付株式数	200株
ショーワ	14,300	1,403.00	20,062,900		
小糸製作所	36,200	5,350.00	193,670,000	貸付株式数	13,400株
ＴＢＫ	7,000	387.00	2,709,000	貸付株式数	2,400株
エクセディ	8,200	2,228.00	18,269,600	貸付株式数	600株
ミツバ	11,000	579.00	6,369,000	貸付株式数	4,400株
豊田合成	19,500	1,982.00	38,649,000		
愛三工業	9,400	698.00	6,561,200		
盟和産業	1,000	1,034.00	1,034,000	貸付株式数	200株
日本プラスト	4,600	678.00	3,118,800		
ヨ　ロ　ズ	5,600	1,333.00	7,464,800		
エフ・シー・シー	10,900	2,257.00	24,601,300		
新家工業	1,300	1,425.00	1,852,500		
シマノ	24,400	16,840.00	410,896,000	貸付株式数	1,000株
テイ・エス　テック	14,100	2,817.00	39,719,700		
関西みらいＦＧ	28,000	733.00	20,524,000	貸付株式数	2,600株
３３ＦＧ	5,200	1,494.00	7,768,800	貸付株式数	500株
第四北越フィナンシャルＧ	10,300	2,860.00	29,458,000	貸付株式数	1,000株
ジャムコ	3,000	2,055.00	6,165,000	貸付株式数	900株 (900株)
小　野　建	5,200	1,398.00	7,269,600	貸付株式数	1,700株 (1,400株)
はるやまＨＬＤＧＳ	2,700	827.00	2,232,900		
南　陽	1,200	1,550.00	1,860,000		
ノ　ジ　マ	10,600	1,809.00	19,175,400		
佐鳥電機	4,400	864.00	3,801,600	貸付株式数	1,000株
カッパ・クリエイト	8,400	1,387.00	11,650,800	貸付株式数	3,300株
エコートレーディング	1,500	530.00	795,000		

伯東	4,000	1,153.00	4,612,000		
コンドーテック	4,600	951.00	4,374,600	貸付株式数	1,800株
中山福	3,400	539.00	1,832,600		
ライトオン	5,000	713.00	3,565,000	貸付株式数	1,700株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,600	2,535.00	21,801,000	貸付株式数	2,200株
ジーンズメイト	1,800	325.00	585,000	貸付株式数	700株
三菱食品	6,600	2,878.00	18,994,800	貸付株式数	2,300株
良品計画	8,400	19,130.00	160,692,000	貸付株式数	3,300株
三城ホールディングス	7,500	337.00	2,527,500	貸付株式数	2,600株
松田産業	4,500	1,484.00	6,678,000	貸付株式数	1,500株
第一興商	8,900	5,120.00	45,568,000	貸付株式数	1,300株
メディパルＨＤ	64,200	2,382.00	152,924,400		
アドヴァン	9,100	1,059.00	9,636,900	貸付株式数	1,500株 (600株)
ＳＰＫ	1,200	2,361.00	2,833,200		
萩原電気ＨＬＤＧＳ	2,200	2,664.00	5,860,800		
アルビス	2,200	2,460.00	5,412,000		
アズワン	4,300	9,540.00	41,022,000	貸付株式数	800株
スズデン	2,000	1,344.00	2,688,000	貸付株式数	800株
尾家産業	1,800	1,281.00	2,305,800		
シモジマ	3,600	1,113.00	4,006,800	貸付株式数	1,100株
ドウシシャ	5,600	1,761.00	9,861,600	貸付株式数	1,300株
小津産業	1,300	1,721.00	2,237,300		
コナカ	7,700	419.00	3,226,300	貸付株式数	100株
高速	3,500	1,151.00	4,028,500	貸付株式数	100株
ハウス　ローゼ	700	1,586.00	1,110,200		
Ｇ－７ホールディングス	1,700	3,195.00	5,431,500	貸付株式数	600株
たけびし	2,700	1,291.00	3,485,700		
イオン北海道	5,900	714.00	4,212,600	貸付株式数	1,500株
コ　ジ　マ	10,200	485.00	4,947,000	貸付株式数	4,000株
ヒマラヤ	1,900	861.00	1,635,900		
コーナン商事	7,800	2,268.00	17,690,400	貸付株式数	2,300株
ネットワンシステムズ	21,000	2,845.00	59,745,000	貸付株式数	7,200株
エコス	2,200	1,397.00	3,073,400		
ワタミ	7,800	1,465.00	11,427,000	貸付株式数	3,000株
マルシェ	1,400	767.00	1,073,800	貸付株式数	500株
リックス	1,300	1,409.00	1,831,700		
システムソフト	13,500	95.00	1,282,500	貸付株式数	3,200株
パンパシフィックＨＤ	35,600	6,610.00	235,316,000	貸付株式数	900株

丸文	5,200	547.00	2,844,400		
西松屋チェーン	13,000	892.00	11,596,000	貸付株式数	5,100株
ゼンショーホールディングス	28,100	2,250.00	63,225,000	貸付株式数	11,100株
ハピネット	4,900	1,301.00	6,374,900	貸付株式数	1,900株
幸楽苑ホールディングス	3,800	2,929.00	11,130,200	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,200	1,027.00	1,232,400		
橋本総業ＨＬＤＧＳ	1,200	1,450.00	1,740,000		
日本ライフライン	18,700	1,707.00	31,920,900	貸付株式数	7,400株
サイゼリヤ	9,800	2,456.00	24,068,800	貸付株式数	3,800株
タカショー	2,800	462.00	1,293,600	貸付株式数	600株
エクセル	2,200	1,714.00	3,770,800		
ＶＴホールディングス	26,800	457.00	12,247,600		
マルカ	1,900	1,855.00	3,524,500		
アルゴグラフィックス	5,000	2,176.00	10,880,000		
魚力	1,600	1,480.00	2,368,000	貸付株式数	500株
ＩＤＯＭ	20,000	285.00	5,700,000	貸付株式数	7,900株
日本エム・ディ・エム	3,500	1,409.00	4,931,500	貸付株式数	600株
ポプラ	1,500	488.00	732,000	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	1,500	2,119.00	3,178,500		
ユナイテッドアローズ	6,800	3,570.00	24,276,000	貸付株式数	2,600株 (1,900株)
進和	3,500	2,158.00	7,553,000	貸付株式数	1,400株
エスケイジャパン	1,400	519.00	726,600	貸付株式数	500株
ダイトロン	2,700	1,192.00	3,218,400	貸付株式数	400株
ハイデイ日高	8,600	2,049.00	17,621,400	貸付株式数	3,400株
シークス	7,500	1,254.00	9,405,000	貸付株式数	3,000株
京都きもの友禅	4,000	359.00	1,436,000		
コロワイド	19,800	2,166.00	42,886,800	貸付株式数	300株
ピーシーデポコーポ	7,900	402.00	3,175,800	貸付株式数	700株 (500株)
田中商事	2,000	580.00	1,160,000	貸付株式数	400株
オーハシテクニカ	3,300	1,442.00	4,758,600	貸付株式数	1,200株
壱番屋	4,200	4,605.00	19,341,000	貸付株式数	1,600株
白銅	1,900	1,351.00	2,566,900	貸付株式数	600株
トップカルチャー	2,200	345.00	759,000	貸付株式数	800株
ＰＬＡＮＴ	1,400	786.00	1,100,400		
スギホールディングス	13,100	4,935.00	64,648,500		
島津製作所	77,800	2,739.00	213,094,200	貸付株式数	15,500株

ＪＭＳ	5,400	658.00	3,553,200	貸付株式数	2,000株
クボテック	1,200	354.00	424,800	貸付株式数	400株
長野計器	4,700	694.00	3,261,800	貸付株式数	200株
ブイ・テクノロジー	2,800	4,640.00	12,992,000		
スター精密	10,300	1,378.00	14,193,400		
東京計器	3,900	916.00	3,572,400	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
愛知時計	800	4,085.00	3,268,000	貸付株式数	100株
インターアクション	3,200	1,368.00	4,377,600	貸付株式数	1,200株
オーバル	5,800	232.00	1,345,600	貸付株式数	2,300株
東京精密	11,000	2,550.00	28,050,000		
マニー	8,000	6,550.00	52,400,000	貸付株式数	3,100株
ニコン	105,300	1,526.00	160,687,800		
トプコン	32,500	1,431.00	46,507,500	貸付株式数	1,400株
オリンパス	360,100	1,313.00	472,811,300	貸付株式数	35,600株
理研計器	5,300	1,971.00	10,446,300	貸付株式数	1,200株
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	10,500	3,875.00	40,687,500	貸付株式数	4,100株
キヤノン電子	5,500	1,778.00	9,779,000		
タムロン	5,300	2,161.00	11,453,300	貸付株式数	1,200株
ＨＯＹＡ	121,600	7,693.00	935,468,800		
シ　ー　ド	2,600	1,108.00	2,880,800	貸付株式数	1,000株 (300株)
ノーリツ鋼機	4,700	1,812.00	8,516,400	貸付株式数	1,800株
エー・アンド・デイ	5,500	784.00	4,312,000		
朝日インテック	25,600	5,560.00	142,336,000		
キヤノン	325,300	3,091.00	1,005,502,300		
リ　コ　ー	181,700	1,059.00	192,420,300		
シチズン時計	66,200	518.00	34,291,600		
リズム時計	2,000	1,278.00	2,556,000	貸付株式数	600株
大研医器	4,800	674.00	3,235,200	貸付株式数	800株
メニコン	8,300	3,615.00	30,004,500	貸付株式数	400株
シンシア	900	584.00	525,600	貸付株式数	300株
中本パックス	1,700	1,487.00	2,527,900	貸付株式数	300株
スノーピーク	2,300	1,395.00	3,208,500		
パラマウントベッドＨＤ	7,000	4,400.00	30,800,000	貸付株式数	2,300株
トランザクション	3,800	822.00	3,123,600	貸付株式数	1,500株
ＳＨＯ‐ＢＩ	1,700	367.00	623,900	貸付株式数	600株
ニホンフラッシュ	2,600	2,624.00	6,822,400	貸付株式数	1,000株
前田工繊	6,600	1,903.00	12,559,800	貸付株式数	2,600株

永大産業	7,600	342.00	2,599,200	貸付株式数	200株
アートネイチャー	6,400	633.00	4,051,200	貸付株式数	1,300株
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	62,500	5,180.00	323,750,000	貸付株式数	16,800株
アイフィスジャパン	1,300	611.00	794,300	貸付株式数	400株
共立印刷	10,200	178.00	1,815,600		
ＳＨＯＥＩ	2,900	4,720.00	13,688,000	貸付株式数	1,200株
フランスベッドＨＬＤＧＳ	8,500	991.00	8,423,500		
マーベラス	9,000	824.00	7,416,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,500	4,115.00	43,207,500		
萩原工業	3,300	1,371.00	4,524,300		
エイベックス	10,100	1,371.00	13,847,100		
トッパン・フォームズ	12,900	894.00	11,532,600	貸付株式数	5,100株
フジシールインターナショナル	13,600	3,650.00	49,640,000	貸付株式数	1,400株
タカラトミー	25,300	1,273.00	32,206,900	貸付株式数	9,300株
廣済堂	5,500	641.00	3,525,500	貸付株式数	500株
エステールホールディングス	1,500	596.00	894,000	貸付株式数	600株
アーク	23,500	101.00	2,373,500	貸付株式数	8,500株
レック	6,400	1,268.00	8,115,200	貸付株式数	100株
タカノ	2,400	770.00	1,848,000	貸付株式数	900株
三光合成	6,800	319.00	2,169,200	貸付株式数	1,000株
プロネクサス	5,100	1,199.00	6,114,900	貸付株式数	1,900株
ホクシン	3,700	128.00	473,600		
ウッドワン	2,000	1,010.00	2,020,000		
大建工業	4,600	2,195.00	10,097,000	貸付株式数	1,800株
き　も　と	10,000	158.00	1,580,000	貸付株式数	3,800株
凸版印刷	85,300	1,620.00	138,186,000		
大日本印刷	85,100	2,331.00	198,368,100		
図書印刷	5,600	1,287.00	7,207,200		
共同印刷	1,900	2,773.00	5,268,700	貸付株式数	400株
ＮＩＳＳＨＡ	12,400	1,092.00	13,540,800	貸付株式数	4,800株 (2,700株)
光村印刷	500	2,006.00	1,003,000	貸付株式数	200株
藤森工業	5,400	2,929.00	15,816,600		
ヴィア・ホールディングス	7,200	601.00	4,327,200		
宝印刷	3,100	1,599.00	4,956,900	貸付株式数	1,000株
前澤化成工業	4,200	1,075.00	4,515,000	貸付株式数	1,600株

未来工業	3,200	2,142.00	6,854,400		
アシックス	57,000	1,231.00	70,167,000	貸付株式数	23,600株
ツ　ツ　ミ	1,900	2,035.00	3,866,500		
ウェーブロックＨＬＤＧＳ	1,500	660.00	990,000		
ジェイ　エス　ピー	3,500	2,032.00	7,112,000	貸付株式数	100株 (100株)
ニ　チ　ハ	8,400	2,848.00	23,923,200	貸付株式数	1,200株
エフピコ	6,700	6,560.00	43,952,000	貸付株式数	2,600株
小松ウオール工業	1,800	1,823.00	3,281,400	貸付株式数	300株
ヤマハ	35,900	4,985.00	178,961,500		
河合楽器	1,900	2,739.00	5,204,100		
クリナップ	5,700	528.00	3,009,600	貸付株式数	1,700株
ピジョン	36,500	4,165.00	152,022,500	貸付株式数	14,500株
天馬	4,100	1,769.00	7,252,900	貸付株式数	900株
兼松サステック	400	1,621.00	648,400	貸付株式数	100株
キングジム	4,900	870.00	4,263,000	貸付株式数	1,900株
象印マホービン	15,000	1,150.00	17,250,000	貸付株式数	5,900株
リンテック	14,400	2,211.00	31,838,400		
信越ポリマー	10,800	770.00	8,316,000		
東　リ	14,600	253.00	3,693,800	貸付株式数	2,300株
イトーキ	11,000	421.00	4,631,000	貸付株式数	300株
任　天　堂	34,600	38,770.00	1,341,442,000		
三菱鉛筆	10,000	1,916.00	19,160,000		
松　風	2,900	1,270.00	3,683,000		
タカラスタンダード	12,500	1,663.00	20,787,500	貸付株式数	4,300株
コ　ク　ヨ	29,000	1,475.00	42,775,000		
ナカバヤシ	5,900	504.00	2,973,600	貸付株式数	1,700株
ニ　フ　コ	24,200	2,829.00	68,461,800	貸付株式数	9,600株
立川ブラインド	2,600	1,250.00	3,250,000	貸付株式数	1,000株
グローブライド	2,900	3,265.00	9,468,500		
オカムラ	21,100	1,069.00	22,555,900		
バルカー	4,900	2,101.00	10,294,900	貸付株式数	800株
ＭＵＴＯＨホールディングス	700	1,671.00	1,169,700		
伊　藤　忠	416,200	1,900.50	790,988,100		
丸　紅	586,800	693.00	406,652,400		
スクロール	9,000	357.00	3,213,000		
高　島	900	1,648.00	1,483,200	貸付株式数	200株
ヨンドシーホールディングス	6,600	2,432.00	16,051,200		

三陽商会	3,600	1,802.00	6,487,200	貸付株式数	1,300株
長瀬産業	33,400	1,636.00	54,642,400	貸付株式数	2,900株
ナイガイ	2,000	504.00	1,008,000	貸付株式数	200株
蝶　理	3,700	1,570.00	5,809,000	貸付株式数	1,400株
豊田通商	66,400	3,170.00	210,488,000		
オンワードホールディングス	35,500	596.00	21,158,000	貸付株式数	1,600株
三共生興	10,200	524.00	5,344,800		
兼　松	23,700	1,231.00	29,174,700	貸付株式数	2,700株
美　津　濃	6,000	2,492.00	14,952,000		
ツカモトコーポレーション	1,000	1,004.00	1,004,000	貸付株式数	400株
ユニー・ファミリーマートＨＤ	66,600	2,560.00	170,496,000		
ルックホールディングス	2,100	1,349.00	2,832,900		
三井物産	490,200	1,725.00	845,595,000		
日本紙パルプ	3,400	3,830.00	13,022,000		
東京エレクトロン	40,300	15,310.00	616,993,000		
日立ハイテクノロジーズ	18,100	4,870.00	88,147,000		
カメイ	7,700	1,193.00	9,186,100	貸付株式数	3,000株
東都水産	800	2,517.00	2,013,600		
ＯＵＧホールディングス	900	2,576.00	2,318,400		
スターゼン	2,200	4,060.00	8,932,000		
セイコーＨＤ	9,300	2,107.00	19,595,100		
山　善	23,100	1,009.00	23,307,900		
椿本興業	1,300	3,010.00	3,913,000	貸付株式数	500株
住友商事	351,900	1,605.00	564,799,500	貸付株式数	138,400株
日本ユニシス	18,500	3,430.00	63,455,000		
内田洋行	2,700	3,570.00	9,639,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
三菱商事	417,600	2,908.00	1,214,380,800		
第一実業	2,700	3,155.00	8,518,500		
キヤノンマーケティングＪＰＮ	17,000	2,337.00	39,729,000	貸付株式数	6,700株
西華産業	3,300	1,264.00	4,171,200	貸付株式数	1,300株
佐藤商事	5,200	918.00	4,773,600	貸付株式数	2,000株
菱洋エレクトロ	6,000	1,683.00	10,098,000		
東京産業	6,300	470.00	2,961,000	貸付株式数	2,300株
ユアサ商事	6,000	3,045.00	18,270,000		
神鋼商事	1,300	2,250.00	2,925,000		
小林産業	3,300	324.00	1,069,200		

阪和興業	10,300	2,888.00	29,746,400	貸付株式数	4,000株
正栄食品	4,200	3,130.00	13,146,000	貸付株式数	1,200株
カナデン	5,700	1,312.00	7,478,400	貸付株式数	1,900株
菱電商事	4,600	1,563.00	7,189,800		
ニプロ	41,800	1,195.00	49,951,000	貸付株式数	16,600株
フルサト工業	3,200	1,501.00	4,803,200	貸付株式数	1,200株
岩谷産業	13,200	3,655.00	48,246,000	貸付株式数	5,200株
すてきナイスグループ	2,500	575.00	1,437,500	貸付株式数	900株
昭光通商	2,300	633.00	1,455,900	貸付株式数	900株
ニチモウ	1,300	1,711.00	2,224,300	貸付株式数	500株
極東貿易	1,900	1,456.00	2,766,400		
イ　ワ　キ	7,000	476.00	3,332,000	貸付株式数	2,800株
兼松エレクトロニクス	3,200	3,085.00	9,872,000		
三愛石油	16,000	981.00	15,696,000	貸付株式数	2,300株
稲畑産業	14,200	1,399.00	19,865,800	貸付株式数	5,100株
ＧＳＩクレオス	1,600	1,132.00	1,811,200	貸付株式数	100株
明和産業	6,200	360.00	2,232,000	貸付株式数	2,100株
クワザワ	2,000	491.00	982,000		
ゴールドウイン	5,400	14,280.00	77,112,000	貸付株式数	2,100株 (1,400株)
ユニ・チャーム	128,100	3,247.00	415,940,700	貸付株式数	50,700株
デサント	14,400	1,865.00	26,856,000	貸付株式数	100株
キ　ン　グ	3,000	608.00	1,824,000	貸付株式数	300株
ワ　キ　タ	12,600	1,042.00	13,129,200		
ヤマトインターナシヨナル	3,700	410.00	1,517,000	貸付株式数	1,200株
東邦ホールディングス	17,600	2,495.00	43,912,000	貸付株式数	6,900株
サンゲツ	17,700	2,116.00	37,453,200	貸付株式数	800株
ミツウロコグループ	8,300	789.00	6,548,700	貸付株式数	1,600株
シナネンホールディングス	2,400	1,806.00	4,334,400	貸付株式数	800株
伊藤忠エネクス	13,100	857.00	11,226,700		
サンリオ	18,400	2,634.00	48,465,600	貸付株式数	4,600株
サンワ　テクノス	3,600	820.00	2,952,000	貸付株式数	1,200株
リョーサン	6,500	2,629.00	17,088,500		
新光商事	5,600	1,880.00	10,528,000	貸付株式数	1,600株
トーホー	2,700	2,171.00	5,861,700	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
三信電気	4,200	1,835.00	7,707,000	貸付株式数	1,600株
東陽テクニカ	6,800	905.00	6,154,000	貸付株式数	600株
モスフード　サービス	7,800	2,392.00	18,657,600	貸付株式数	3,000株
加賀電子	5,900	1,636.00	9,652,400	貸付株式数	1,200株

三益半導体	5,300	1,530.00	8,109,000		
ソーダニツカ	6,600	529.00	3,491,400	貸付株式数	1,900株 (900株)
立花エレテック	4,400	1,576.00	6,934,400	貸付株式数	500株
木曽路	7,300	2,547.00	18,593,100		
ＳＲＳホールディングス	6,900	1,010.00	6,969,000	貸付株式数	1,700株
千　趣　会	11,100	269.00	2,985,900	貸付株式数	4,300株
タカキユー	4,800	177.00	849,600	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ケーヨー	10,800	495.00	5,346,000	貸付株式数	2,900株
上新電機	7,000	2,242.00	15,694,000		
日本瓦斯	9,700	2,705.00	26,238,500		
ロイヤルホールディングス	10,400	2,706.00	28,142,400	貸付株式数	4,100株
東　天　紅	500	1,202.00	601,000		
いなげや	6,600	1,381.00	9,114,600	貸付株式数	300株
島　忠	12,600	2,494.00	31,424,400	貸付株式数	5,300株
チヨダ	6,300	1,660.00	10,458,000	貸付株式数	100株
ライフコーポレーション	4,500	2,283.00	10,273,500		
リンガーハット	7,300	2,354.00	17,184,200	貸付株式数	2,900株 (1,700株)
ＭｒＭａｘＨＤ	8,100	440.00	3,564,000		
テンアライド	5,300	412.00	2,183,600	貸付株式数	2,100株
ＡＯＫＩホールディングス	11,900	1,046.00	12,447,400	貸付株式数	4,400株
オークワ	8,400	1,088.00	9,139,200	貸付株式数	1,200株
コメリ	9,200	2,185.00	20,102,000		
青山商事	10,600	2,092.00	22,175,200		
しまむら	6,900	8,430.00	58,167,000	貸付株式数	2,700株
はせがわ	2,900	394.00	1,142,600	貸付株式数	300株
高　島　屋	46,700	1,166.00	54,452,200	貸付株式数	18,100株
松　屋	12,000	903.00	10,836,000	貸付株式数	4,700株
エイチ・ツー・オーリテイリング	30,500	1,247.00	38,033,500	貸付株式数	10,500株
近鉄百貨店	2,300	3,320.00	7,636,000		
パ　ル　コ	5,700	1,085.00	6,184,500	貸付株式数	2,200株
丸井グループ	50,300	2,284.00	114,885,200		
クレディセゾン	41,700	1,176.00	49,039,200		
アクシアル　リテイリング	4,900	3,695.00	18,105,500	貸付株式数	1,700株
井　筒　屋	3,300	247.00	815,100		
イオン	229,000	1,909.50	437,275,500	貸付株式数	91,100株
イ　ズ　ミ	12,100	4,585.00	55,478,500		

フオーバル	2,600	946.00	2,459,600		
平　和　堂	12,100	1,939.00	23,461,900	貸付株式数	4,600株
フ　ジ	7,200	1,779.00	12,808,800		
ヤオコー	6,800	4,830.00	32,844,000		
ゼビオホールディングス	7,200	1,243.00	8,949,600	貸付株式数	2,400株
ケーズホールディングス	61,900	1,042.00	64,499,800	貸付株式数	13,000株 (13,000株)
ＰＡＬＴＡＣ	10,700	5,620.00	60,134,000	貸付株式数	3,600株
三谷産業	7,900	277.00	2,188,300	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,500	667.00	2,334,500		
日産東京販売ＨＤ	8,500	273.00	2,320,500		
新生銀行	43,700	1,646.00	71,930,200	貸付株式数	17,400株
あおぞら銀行	33,300	2,657.00	88,478,100		
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ ※	4,102,700	506.50	2,078,017,550		
りそなホールディングス	654,100	467.10	305,530,110		
三井住友トラストＨＤ	117,200	4,054.00	475,128,800		
三井住友フィナンシャルＧ	420,000	3,800.00	1,596,000,000		
千葉銀行	205,100	539.00	110,548,900		
群馬銀行	119,300	393.00	46,884,900	貸付株式数	1,700株
武蔵野銀行	8,900	2,087.00	18,574,300		
千葉興業銀行	16,300	274.00	4,466,200	貸付株式数	6,000株
筑波銀行	24,500	176.00	4,312,000		
七十七銀行	18,700	1,634.00	30,555,800		
青森銀行	4,600	2,909.00	13,381,400	貸付株式数	400株
秋田銀行	3,800	2,171.00	8,249,800	貸付株式数	1,400株
山形銀行	6,600	1,689.00	11,147,400	貸付株式数	2,600株 (1,600株)
岩手銀行	4,200	3,035.00	12,747,000	貸付株式数	800株
東邦銀行	53,100	258.00	13,699,800	貸付株式数	19,800株
東北銀行	3,000	1,090.00	3,270,000	貸付株式数	1,100株
みちのく銀行	4,000	1,674.00	6,696,000	貸付株式数	1,100株
ふくおかフィナンシャルＧ	52,500	1,921.00	100,852,500		
静岡銀行	150,100	822.00	123,382,200		
十六銀行	8,000	2,343.00	18,744,000		
スルガ銀行	60,500	434.00	26,257,000	貸付株式数	23,700株 (7,000株)
八十二銀行	143,800	460.00	66,148,000		
山梨中央銀行	7,300	1,258.00	9,183,400	貸付株式数	2,600株

大垣共立銀行	12,500	2,460.00	30,750,000	貸付株式数	4,900株
福井銀行	5,100	1,579.00	8,052,900	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
北國銀行	6,200	3,125.00	19,375,000		
清水銀行	2,500	1,800.00	4,500,000	貸付株式数	900株 (300株)
富山銀行	1,100	2,552.00	2,807,200	貸付株式数	300株
滋賀銀行	11,900	2,622.00	31,201,800	貸付株式数	4,200株
南都銀行	9,300	2,301.00	21,399,300		
百五銀行	53,500	340.00	18,190,000	貸付株式数	1,700株
京都銀行	21,300	4,325.00	92,122,500		
紀陽銀行	21,100	1,516.00	31,987,600	貸付株式数	2,100株
ほくほくフィナンシャルG	39,700	1,190.00	47,243,000		
広島銀行	88,100	564.00	49,688,400		
山陰合同銀行	35,300	720.00	25,416,000		
中国銀行	51,300	1,042.00	53,454,600	貸付株式数	20,400株
鳥取銀行	2,000	1,361.00	2,722,000	貸付株式数	400株
伊予銀行	79,000	567.00	44,793,000	貸付株式数	23,700株
百十四銀行	6,300	2,296.00	14,464,800	貸付株式数	100株
四国銀行	8,400	958.00	8,047,200	貸付株式数	1,800株
阿波銀行	9,100	2,709.00	24,651,900	貸付株式数	3,700株
大分銀行	3,600	3,230.00	11,628,000		
宮崎銀行	3,900	2,608.00	10,171,200		
佐賀銀行	3,600	1,648.00	5,932,800	貸付株式数	1,400株
沖縄銀行	5,400	3,480.00	18,792,000	貸付株式数	1,900株
琉球銀行	13,700	1,172.00	16,056,400	貸付株式数	5,400株
セブン銀行	201,400	283.00	56,996,200	貸付株式数	80,100株
みずほフィナンシャルG	8,097,600	153.10	1,239,742,560	貸付株式数	2,800,000株
高知銀行	2,000	735.00	1,470,000	貸付株式数	300株
山口フィナンシャルG	74,500	810.00	60,345,000	貸付株式数	29,600株
芙蓉総合リース	6,800	5,360.00	36,448,000		
興銀リース	11,200	2,543.00	28,481,600		
東京センチュリー	12,000	4,545.00	54,540,000	貸付株式数	3,500株
ＳＢＩホールディングス	71,000	2,445.00	173,595,000	貸付株式数	28,100株
日本証券金融	26,000	552.00	14,352,000	貸付株式数	10,400株
アイフル	90,700	214.00	19,409,800	貸付株式数	300株 (300株)
日本アジア投資	5,000	174.00	870,000	貸付株式数	1,900株
長野銀行	2,000	1,680.00	3,360,000		
名古屋銀行	4,800	3,585.00	17,208,000	貸付株式数	200株

北洋銀行	89,700	261.00	23,411,700		
愛知銀行	2,200	3,720.00	8,184,000	貸付株式数	600株
中京銀行	2,400	2,255.00	5,412,000		
大光銀行	2,000	1,678.00	3,356,000	貸付株式数	800株
愛媛銀行	8,200	1,102.00	9,036,400	貸付株式数	3,200株
トマト銀行	2,300	1,024.00	2,355,200		
京葉銀行	26,400	663.00	17,503,200		
栃木銀行	30,700	182.00	5,587,400	貸付株式数	4,200株
北日本銀行	1,800	1,711.00	3,079,800	貸付株式数	300株
東和銀行	10,400	731.00	7,602,400		
福島銀行	5,100	263.00	1,341,300	貸付株式数	2,200株
大東銀行	2,900	584.00	1,693,600	貸付株式数	500株
リコーリース	4,700	3,350.00	15,745,000	貸付株式数	1,400株
イオンフィナンシャルサービス	38,100	1,738.00	66,217,800	貸付株式数	2,300株
ア　コ　ム	119,900	371.00	44,482,900	貸付株式数	47,600株
ジャックス	6,500	1,933.00	12,564,500		
オ　リ　コ	161,200	113.00	18,215,600	貸付株式数	36,800株
日立キャピタル	14,000	2,356.00	32,984,000		
アプラスフィナンシャル	31,700	71.00	2,250,700	貸付株式数	10,500株
オリックス	397,600	1,548.50	615,683,600		
三菱ＵＦＪリース	134,400	550.00	73,920,000	貸付株式数	6,600株
ジャフコ	9,800	3,905.00	38,269,000		
九州　リースサービス	3,000	620.00	1,860,000		
トモニホールディングス	46,000	362.00	16,652,000		
大和証券Ｇ本社	478,300	476.90	228,101,270		
野村ホールディングス	1,048,700	350.00	367,045,000		
岡三証券グループ	50,600	404.00	20,442,400	貸付株式数	20,200株
丸三証券	17,800	574.00	10,217,200	貸付株式数	7,000株
東洋証券	21,300	121.00	2,577,300	貸付株式数	200株
東海東京ＨＤ	71,000	353.00	25,063,000	貸付株式数	23,000株
光世証券	1,400	664.00	929,600	貸付株式数	500株
水戸証券	17,100	207.00	3,539,700	貸付株式数	6,800株
いちよし証券	12,400	792.00	9,820,800	貸付株式数	4,500株
松井証券	29,100	1,026.00	29,856,600		
ＳＯＭＰＯホールディングス	105,100	4,257.00	447,410,700		
だいこう証券ビジ	2,400	410.00	984,000	貸付株式数	600株
日本取引所グループ	161,000	1,687.00	271,607,000		
マネックスＧ	55,400	328.00	18,171,200	貸付株式数	21,800株

カブドットコム証券	43,900	558.00	24,496,200		
極東証券	7,800	938.00	7,316,400	貸付株式数	3,100株
岩井コスモホールディング	6,000	1,140.00	6,840,000	貸付株式数	1,300株
藍澤證券	11,000	687.00	7,557,000	貸付株式数	3,000株
フィデアホール	57,900	118.00	6,832,200		
池田泉州ＨＤ	63,100	214.00	13,503,400	貸付株式数	1,000株
アニコム　ホールディングス	4,900	3,665.00	17,958,500	貸付株式数	1,900株
ＭＳ＆ＡＤ	155,800	3,511.00	547,013,800		
ＳＯＮＹ　ＦＨ	49,000	2,459.00	120,491,000		
マネーパートナーズＧＰ	6,800	287.00	1,951,600	貸付株式数	800株
スパークス・グループ	23,500	227.00	5,334,500		
小林洋行	2,000	251.00	502,000		
第一生命ＨＬＤＧＳ	337,200	1,620.50	546,432,600		
東京海上ＨＤ	213,100	5,451.00	1,161,608,100		
アドバンテッジリスクマネ	2,200	710.00	1,562,000		
イー・ギャランティ	5,600	1,350.00	7,560,000	貸付株式数	2,200株
アサックス	2,600	551.00	1,432,600	貸付株式数	300株
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,500	1,775.00	4,437,500		
Ｔ＆Ｄホールディングス	184,400	1,126.50	207,726,600		
アドバンスクリエイト	1,300	1,694.00	2,202,200	貸付株式数	500株
三井不動産	315,900	2,713.50	857,194,650	貸付株式数	105,800株
三菱地所	417,200	2,049.50	855,051,400		
平和不動産	11,200	2,210.00	24,752,000		
東京建物	64,800	1,158.00	75,038,400		
ダイビル	17,200	950.00	16,340,000		
京阪神ビルディング	10,800	1,032.00	11,145,600		
住友不動産	133,800	4,104.00	549,115,200		
太平洋興発	2,300	726.00	1,669,800	貸付株式数	800株
テーオーシー	13,200	634.00	8,368,800	貸付株式数	5,400株
東京楽天地	900	5,130.00	4,617,000	貸付株式数	300株
スターツコーポレーション	8,000	2,559.00	20,472,000		
フジ住宅	8,100	761.00	6,164,100	貸付株式数	1,300株
空港施設	6,500	525.00	3,412,500		
明和地所	4,200	533.00	2,238,600	貸付株式数	1,200株
ゴールドクレスト	4,500	1,789.00	8,050,500		
リログループ	31,500	2,891.00	91,066,500	貸付株式数	6,700株
日本エスリード	2,400	1,544.00	3,705,600		
日神不動産	8,800	441.00	3,880,800	貸付株式数	1,900株

日本エスコン	10,900	678.00	7,390,200	貸付株式数	4,600株
タカラレーベン	27,100	368.00	9,972,800	貸付株式数	10,700株
サンヨーハウジ　名古屋	4,000	871.00	3,484,000	貸付株式数	1,300株
イオンモール	29,600	1,600.00	47,360,000		
毎日コムネット	1,000	717.00	717,000		
ファースト住建	2,300	1,105.00	2,541,500		
ランド	258,500	8.00	2,068,000	貸付株式数	96,400株 (24,800株)
カチタス	6,600	3,910.00	25,806,000	貸付株式数	2,600株 (400株)
東祥	3,600	2,974.00	10,706,400	貸付株式数	1,400株
トーセイ	8,400	895.00	7,518,000		
穴吹興産	900	2,950.00	2,655,000	貸付株式数	200株
サンフロンティア不動産	8,400	993.00	8,341,200	貸付株式数	3,200株
インテリックス	2,000	669.00	1,338,000	貸付株式数	200株
ランドビジネス	3,700	783.00	2,897,100	貸付株式数	500株
グランディハウス	6,100	453.00	2,763,300		
東武鉄道	63,800	3,190.00	203,522,000		
相鉄ホールディングス	20,700	3,005.00	62,203,500		
東京急行	164,100	1,978.00	324,589,800		
京浜急行	82,800	1,897.00	157,071,600	貸付株式数	18,300株
小田急電鉄	96,800	2,691.00	260,488,800		
京王電鉄	33,800	7,070.00	238,966,000		
京成電鉄	45,300	3,985.00	180,520,500		
富士急行	8,200	4,000.00	32,800,000	貸付株式数	2,300株 (100株)
新京成電鉄	1,500	2,067.00	3,100,500		
東日本旅客鉄道	107,500	10,375.00	1,115,312,500		
西日本旅客鉄道	54,200	8,740.00	473,708,000		
東海旅客鉄道	54,100	22,690.00	1,227,529,000		
西武ホールディングス	74,800	1,860.00	139,128,000		
鴻池運輸	9,600	1,716.00	16,473,600		
西日本鉄道	16,700	2,429.00	40,564,300	貸付株式数	6,000株
ハマキョウレックス	4,600	3,745.00	17,227,000		
サカイ引越センター	3,200	6,500.00	20,800,000		
近鉄グループＨＬＤＧＳ	57,200	5,260.00	300,872,000		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	76,300	4,000.00	305,200,000	貸付株式数	21,500株
南海電鉄	25,500	2,870.00	73,185,000		
京阪ホールディングス	25,400	4,815.00	122,301,000	貸付株式数	10,100株
神戸電鉄	1,400	3,990.00	5,586,000		

名古屋鉄道	47,000	3,035.00	142,645,000	貸付株式数	15,600株
山陽電鉄	4,400	2,237.00	9,842,800		
トランコム	1,600	6,520.00	10,432,000	貸付株式数	600株
日本通運	22,100	5,840.00	129,064,000		
ヤマトホールディングス	100,300	2,264.00	227,079,200		
山　九	15,900	5,460.00	86,814,000	貸付株式数	6,300株
日　新	4,900	1,809.00	8,864,100	貸付株式数	1,600株
丸　運	3,200	285.00	912,000	貸付株式数	300株
丸全昭和運輸	4,600	3,245.00	14,927,000	貸付株式数	1,300株
センコーグループＨＬＤＧＳ	31,500	870.00	27,405,000	貸付株式数	12,500株
トナミホールディングス	1,400	5,650.00	7,910,000	貸付株式数	100株
ニッコンホールディングス	21,800	2,522.00	54,979,600	貸付株式数	2,800株
日石輸送	700	2,807.00	1,964,900	貸付株式数	200株
福山通運	7,300	3,900.00	28,470,000	貸付株式数	2,500株
セイノーホールディングス	42,900	1,447.00	62,076,300		
エスライン	1,600	954.00	1,526,400	貸付株式数	600株
神奈川中央交通	1,400	3,880.00	5,432,000		
日立物流	12,600	3,270.00	41,202,000		
丸和運輸機関	3,000	4,300.00	12,900,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	5,800	1,340.00	7,772,000	貸付株式数	1,100株
日本郵船	47,900	1,663.00	79,657,700	貸付株式数	19,000株
商船三井	34,000	2,401.00	81,634,000	貸付株式数	13,400株
川崎汽船	17,600	1,232.00	21,683,200	貸付株式数	7,000株
ＮＳユナイテッド海運	3,200	2,332.00	7,462,400	貸付株式数	1,200株
明治海運	5,900	315.00	1,858,500	貸付株式数	1,100株
飯野海運	26,900	362.00	9,737,800		
共栄タンカー	500	1,454.00	727,000		
九州旅客鉄道	48,000	3,285.00	157,680,000		
ＳＧホールディングス	54,100	3,030.00	163,923,000	貸付株式数	21,500株
日本航空	104,800	3,468.00	363,446,400		
ＡＮＡホールディングス	104,600	3,676.00	384,509,600		
パスコ	1,100	828.00	910,800		
西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,300	3,930.00	5,109,000		
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	400	1,187.00	474,800		

ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	2,900	2,431.00	7,049,900	貸付株式数	800株
国際紙パルプ商事	13,600	269.00	3,658,400	貸付株式数	2,000株
総合メディカルＨＤ	5,200	1,758.00	9,141,600	貸付株式数	1,300株
ブックオフＧＨＤ	3,000	885.00	2,655,000	貸付株式数	1,200株
三菱倉庫	19,700	2,976.00	58,627,200	貸付株式数	5,200株
三井倉庫ＨＯＬＤ	7,000	1,601.00	11,207,000		
住友倉庫	21,000	1,413.00	29,673,000	貸付株式数	8,500株
渋沢倉庫	3,100	1,779.00	5,514,900	貸付株式数	1,200株
ヤマタネ	2,900	1,333.00	3,865,700	貸付株式数	1,000株
東陽倉庫	9,900	317.00	3,138,300	貸付株式数	3,600株
乾汽船	5,200	851.00	4,425,200	貸付株式数	1,900株
日本トランスシティ	12,600	464.00	5,846,400		
ケイヒン	1,000	1,236.00	1,236,000	貸付株式数	400株
中央倉庫	3,400	1,021.00	3,471,400	貸付株式数	1,000株
川西倉庫	1,100	1,043.00	1,147,300	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,600	901.00	4,144,600	貸付株式数	1,800株
ファイズ	1,000	703.00	703,000		
東洋埠頭	1,700	1,400.00	2,380,000		
宇徳	4,700	514.00	2,415,800	貸付株式数	1,000株
上　組	35,300	2,607.00	92,027,100		
サンリツ	1,400	631.00	883,400	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,500	1,079.00	1,618,500	貸付株式数	100株
キユーソー流通システム	1,400	2,021.00	2,829,400	貸付株式数	200株 (200株)
近鉄エクスプレス	10,800	1,467.00	15,843,600	貸付株式数	4,200株
東海運	3,300	243.00	801,900	貸付株式数	1,000株
エーアイテイー	3,700	971.00	3,592,700	貸付株式数	1,000株
内外トランスライン	1,800	1,214.00	2,185,200	貸付株式数	500株
ショーエイコーポ	400	742.00	296,800	貸付株式数	100株
日本コンセプト	2,000	1,180.00	2,360,000	貸付株式数	600株
東京放送ＨＤ	39,300	1,832.00	71,997,600		
日本テレビＨＬＤＳ	54,500	1,587.00	86,491,500		
朝日放送グループＨＤ	6,100	735.00	4,483,500	貸付株式数	2,100株
テレビ朝日ＨＤ	16,300	1,766.00	28,785,800	貸付株式数	4,300株
スカパーＪＳＡＴＨＤ	45,200	416.00	18,803,200		
テレビ東京ＨＤ	4,900	2,401.00	11,764,900	貸付株式数	1,900株 (1,500株)
日本ＢＳ放送	2,000	1,068.00	2,136,000	貸付株式数	700株
ビジョン	1,800	5,320.00	9,576,000		

スマートバリュー	1,700	723.00	1,229,100		
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	2,300	755.00	1,736,500	貸付株式数	400株
ワイヤレスゲート	2,500	408.00	1,020,000	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,200	1,320.00	5,544,000	貸付株式数	1,300株
日本通信	50,900	157.00	7,991,300	貸付株式数	22,900株 (1,000株)
クロップス	1,000	616.00	616,000		
日本電信電話	405,500	4,942.00	2,003,981,000		
ＫＤＤＩ	518,300	2,778.00	1,439,837,400		
ソフトバンク	628,600	1,431.00	899,526,600	貸付株式数	107,400株
光通信	7,000	21,330.00	149,310,000	貸付株式数	2,700株
ＮＴＴドコモ	375,400	2,475.50	929,302,700		
エムティーアイ	6,900	681.00	4,698,900	貸付株式数	2,400株
GMOインターネット	21,600	1,740.00	37,584,000	貸付株式数	8,500株
アイドママーケティングコミュ	1,300	586.00	761,800	貸付株式数	500株
カドカワ	17,300	1,489.00	25,759,700	貸付株式数	6,800株
学研ホールディングス	2,000	4,510.00	9,020,000		
ゼンリン	11,800	2,058.00	24,284,400	貸付株式数	4,600株
昭文社	2,700	372.00	1,004,400	貸付株式数	400株
インプレスホールディングス	4,900	133.00	651,700		
東京電力HD	482,400	578.00	278,827,200	貸付株式数	191,900株
中部電力	184,900	1,562.50	288,906,250	貸付株式数	73,200株
関西電力	246,600	1,319.50	325,388,700	貸付株式数	45,800株
中国電力	83,500	1,376.00	114,896,000	貸付株式数	33,200株
北陸電力	59,200	802.00	47,478,400	貸付株式数	23,500株
東北電力	141,500	1,135.00	160,602,500	貸付株式数	56,000株
四国電力	54,400	1,025.00	55,760,000	貸付株式数	21,300株
九州電力	124,600	1,087.00	135,440,200		
北海道電力	56,500	615.00	34,747,500		
沖縄電力	11,200	1,703.00	19,073,600	貸付株式数	4,400株
電源開発	48,100	2,433.00	117,027,300		
エフオン	3,600	754.00	2,714,400		
イーレックス	10,500	1,245.00	13,072,500	貸付株式数	3,900株
レノバ	9,900	888.00	8,791,200		
東京瓦斯	118,600	2,683.00	318,203,800		
大阪瓦斯	117,300	1,962.00	230,142,600		
東邦瓦斯	29,900	4,220.00	126,178,000	貸付株式数	11,900株

北海道瓦斯	3,100	1,510.00	4,681,000		
広島ガス	12,300	338.00	4,157,400		
西部瓦斯	6,800	2,303.00	15,660,400	貸付株式数	1,100株
静岡ガス	18,600	856.00	15,921,600	貸付株式数	2,200株
メタウォーター	2,900	3,260.00	9,454,000	貸付株式数	1,000株
アイネット	3,300	1,255.00	4,141,500	貸付株式数	500株
松　竹	3,900	13,020.00	50,778,000	貸付株式数	1,500株
東　宝	39,000	4,775.00	186,225,000	貸付株式数	12,600株
エイチ・アイ・エス	10,300	3,265.00	33,629,500	貸付株式数	4,000株 (3,200株)
東　映	2,500	14,740.00	36,850,000		
ラックランド	1,100	2,330.00	2,563,000	貸付株式数	400株
ＮＴＴデータ	157,900	1,305.00	206,059,500		
共立メンテナンス	8,800	5,060.00	44,528,000	貸付株式数	3,500株 (1,300株)
イチネンホールディングス	5,900	1,091.00	6,436,900	貸付株式数	2,000株
建設技術研究所	3,900	1,505.00	5,869,500		
スペース	3,700	1,195.00	4,421,500	貸付株式数	1,300株
長　大	2,200	724.00	1,592,800		
アインホールディングス	8,000	7,190.00	57,520,000	貸付株式数	2,900株
燦ホールディングス	1,200	2,331.00	2,797,200		
ピー・シー・エー	700	3,340.00	2,338,000		
スバル興業	400	5,470.00	2,188,000		
東京テアトル	2,400	1,334.00	3,201,600		
タナベ経営	1,100	1,203.00	1,323,300		
ビジネスＢ太田昭和	1,000	1,970.00	1,970,000		
ナ　ガ　ワ	1,600	5,800.00	9,280,000	貸付株式数	300株
よみうりランド	1,200	5,210.00	6,252,000		
東京都競馬	3,800	3,255.00	12,369,000		
常磐興産	2,200	1,646.00	3,621,200	貸付株式数	600株
カナモト	8,600	2,500.00	21,500,000	貸付株式数	3,400株
東京ドーム	21,600	1,064.00	22,982,400	貸付株式数	8,500株
ＤＴＳ	6,600	4,455.00	29,403,000		
スクウェア・エニックス・ＨＤ	27,600	3,955.00	109,158,000	貸付株式数	10,900株
シーイーシー	6,300	1,957.00	12,329,100	貸付株式数	2,500株
カプコン	25,400	2,213.00	56,210,200		
西尾レントオール	5,900	2,924.00	17,251,600	貸付株式数	100株
アイ・エス・ビー	1,100	1,593.00	1,752,300	貸付株式数	400株

アゴーラ・ホスピタリティーG	33,400	34.00	1,135,600	貸付株式数	12,700株 (800株)
日本空港ビルデング	19,000	4,120.00	78,280,000	貸付株式数	7,500株
トランス・コスモス	6,400	2,425.00	15,520,000	貸付株式数	800株
乃村工藝社	27,000	1,361.00	36,747,000	貸付株式数	10,600株
ジャステック	3,400	948.00	3,223,200	貸付株式数	1,300株
ＳＣＳＫ	15,600	5,280.00	82,368,000	貸付株式数	6,100株
藤田観光	2,300	2,640.00	6,072,000	貸付株式数	900株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	3,100	1,425.00	4,417,500	貸付株式数	100株
日本管財	6,200	1,843.00	11,426,600		
トーカイ	5,600	2,395.00	13,412,000	貸付株式数	700株
白　洋　舎	700	2,836.00	1,985,200	貸付株式数	200株
セコム	61,300	9,138.00	560,159,400		
日本システムウエア	1,900	2,512.00	4,772,800		
セントラル警備保障	2,800	5,560.00	15,568,000		
アイネス	7,400	1,155.00	8,547,000	貸付株式数	2,600株
丹青社	10,900	1,121.00	12,218,900	貸付株式数	3,000株
メイテツク	7,100	5,330.00	37,843,000	貸付株式数	1,800株
ＴＫＣ	5,000	4,410.00	22,050,000	貸付株式数	1,900株
富士ソフト	8,800	4,570.00	40,216,000	貸付株式数	3,500株
応用地質	6,200	1,075.00	6,665,000	貸付株式数	2,000株
船井総研ホールディン	11,900	2,619.00	31,166,100	貸付株式数	4,700株
ＮＳＤ	9,700	3,035.00	29,439,500	貸付株式数	3,800株
進学会ホールディングス	2,800	603.00	1,688,400	貸付株式数	700株
丸紅建材リース	500	1,690.00	845,000	貸付株式数	200株
オ　オ　バ	4,400	640.00	2,816,000	貸付株式数	1,700株
コナミホールディングス	24,200	5,020.00	121,484,000		
いであ	1,100	1,128.00	1,240,800	貸付株式数	400株
学　究　社	1,900	1,310.00	2,489,000		
ベネッセホールディングス	21,200	2,553.00	54,123,600	貸付株式数	2,900株
イオンディライト	7,100	3,210.00	22,791,000		
ナック	3,800	948.00	3,602,400	貸付株式数	1,000株
福井コンピュータＨＬＤＳ	1,900	2,392.00	4,544,800	貸付株式数	700株
ニチイ学館	8,200	1,500.00	12,300,000	貸付株式数	3,200株
ダイセキ	9,700	2,750.00	26,675,000	貸付株式数	3,800株
ステップ	2,100	1,452.00	3,049,200	貸付株式数	600株
日鉄物産	4,300	4,290.00	18,447,000		
泉州電業	2,000	2,545.00	5,090,000	貸付株式数	100株
元気寿司	1,700	3,605.00	6,128,500		

トラスコ中山	12,400	2,404.00	29,809,600	貸付株式数	4,900株
ヤマダ電機	181,400	509.00	92,332,600	貸付株式数	72,000株 (400株)
オートバックスセブン	23,600	1,716.00	40,497,600		
モリト	4,200	822.00	3,452,400		
アークランドサカモト	10,100	1,356.00	13,695,600	貸付株式数	900株
ニトリホールディングス	25,800	12,925.00	333,465,000		
グルメ杵屋	4,100	1,161.00	4,760,100		
愛　眼	4,700	243.00	1,142,100		
ケーユーホールディングス	3,000	868.00	2,604,000		
吉野家ホールディングス	20,800	1,830.00	38,064,000	貸付株式数	8,200株
加藤産業	9,300	3,425.00	31,852,500		
北恵	1,000	789.00	789,000		
イノテック	4,000	852.00	3,408,000		
イエローハット	11,200	1,394.00	15,612,800		
松屋フーズＨＬＤＧＳ	2,800	3,370.00	9,436,000	貸付株式数	700株
ＪＢＣＣホールディングス	4,600	1,299.00	5,975,400		
ＪＫホールディングス	5,500	566.00	3,113,000	貸付株式数	600株
サガミホールディングス	7,800	1,331.00	10,381,800	貸付株式数	3,100株
日　伝	4,900	1,688.00	8,271,200	貸付株式数	500株
関西スーパーマーケット	4,400	1,042.00	4,584,800	貸付株式数	1,400株
ミロク情報サービス	5,900	3,270.00	19,293,000	貸付株式数	2,300株
北沢産業	4,400	289.00	1,271,600	貸付株式数	1,200株
杉本商事	3,200	2,059.00	6,588,800	貸付株式数	500株
因幡電機産業	8,400	4,390.00	36,876,000	貸付株式数	3,000株
王将フードサービス	4,400	6,720.00	29,568,000	貸付株式数	1,700株
プレナス	6,600	1,862.00	12,289,200	貸付株式数	2,500株 (2,500株)
ミニストップ	4,400	1,661.00	7,308,400	貸付株式数	1,700株
アークス	11,200	2,210.00	24,752,000	貸付株式数	600株
バローホールディングス	12,800	2,226.00	28,492,800		
東　テ　ク	2,000	2,084.00	4,168,000	貸付株式数	500株
ミスミグループ本社	74,500	2,635.00	196,307,500	貸付株式数	29,600株 (26,500株)
藤　　久	500	717.00	358,500	貸付株式数	100株
アルテック	4,400	213.00	937,200		
ベ　ル　ク	2,900	5,150.00	14,935,000		
大　庄	3,100	1,579.00	4,894,900	貸付株式数	600株
タキヒヨー	1,700	1,876.00	3,189,200		
ファーストリテイリング	8,000	62,310.00	498,480,000		

ソフトバンクグループ	247,800	9,579.00	2,373,676,200		
蔵王産業	900	1,334.00	1,200,600		
スズケン	27,100	6,760.00	183,196,000	貸付株式数	6,900株
サンドラッグ	22,400	2,753.00	61,667,200	貸付株式数	100株
サックスバーホールディング	5,000	966.00	4,830,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
ジェコス	4,100	972.00	3,985,200		
ヤマザワ	1,200	1,629.00	1,954,800	貸付株式数	400株
や　ま　や	1,000	2,015.00	2,015,000		
ルネサスイーストン	5,500	450.00	2,475,000	貸付株式数	200株
ベルーナ	14,600	746.00	10,891,600	貸付株式数	1,200株
合計			132,659,243,740		

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

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。

「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6月5日現在	2019年6月5日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		

金銭信託	25,123,383	―
コール・ローン	37,358,669	94,091,106
国債証券	12,625,182,130	15,069,587,840
地方債証券	1,142,002,100	1,144,791,100
特殊債券	918,794,500	717,137,200
社債券	1,229,222,300	1,045,023,400
未収利息	43,890,915	44,941,945
前払費用	2,252,809	1,372,937
流動資産合計	16,023,826,806	18,116,945,528
資産合計	16,023,826,806	18,116,945,528
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,211,874	3,776,000
その他未払費用	2,638	275
流動負債合計	11,214,512	3,776,275
負債合計	11,214,512	3,776,275
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	12,561,819,123	13,864,117,784
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,450,793,171	4,249,051,469
元本等合計	16,012,612,294	18,113,169,253
純資産合計	16,012,612,294	18,113,169,253
負債純資産合計	16,023,826,806	18,116,945,528

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6月6日 至　2019年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
1. ※1　期首	2017年6月6日	2018年6月6日
期首元本額	12,338,211,994円	12,561,819,123円
期中追加設定元本額	2,631,454,387円	2,439,429,897円
期中一部解約元本額	2,407,847,258円	1,137,131,236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（FOFs用）（適格機関投資家専用）	－円	38,029,395円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	57,799円	131,147円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	101,944,203円	125,293,828円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	757,841,093円	1,276,161,232円
ダイワ・ライフ・バランス３０	5,575,191,411円	5,944,077,268円
ダイワ・ライフ・バランス５０	2,918,530,812円	3,215,671,506円
ダイワ・ライフ・バランス７０	947,064,773円	985,461,372円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	638,224,393円	768,478,355円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	522,040,298円	608,543,705円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	164,504,376円	198,062,900円

	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	59,408,980円	54,610,175円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	49,467,428円	53,809,820円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	4,694,021円	5,611,687円
	ダイワつみたてインデックス日本債券	－円	53,186,457円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	513,344,330円	334,421,356円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	213,509,760円	199,880,911円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	50,296,094円	435,408円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	45,699,352円	2,251,262円
計		12,561,819,123円	13,864,117,784円
2.	期末日における受益権の総数	12,561,819,123口	13,864,117,784口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2018年6月6日 至　2019年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2019年6月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2018年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	10,377,750	374,820,970
地方債証券	△3,694,100	6,358,300
特殊債券	△2,094,400	1,293,400
社債券	△4,567,200	3,174,100
合計	22,050	385,646,770

（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6月5日まで、及び2018年12月1日から2019年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2747円 (12,747円)	1.3065円 (13,065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	３９５　２年国債	20,000,000	20,092,400	
	３９８　２年国債	100,000,000	100,557,000	
	１２５　５年国債	370,000,000	371,435,600	
	１２６　５年国債	233,000,000	234,113,740	
	１２７　５年国債	140,000,000	140,802,200	
	１２８　５年国債	187,000,000	188,243,550	
	１２９　５年国債	182,000,000	183,381,380	
	１３０　５年国債	197,000,000	198,684,350	
	１３１　５年国債	190,000,000	191,810,700	
	１３２　５年国債	90,000,000	90,950,400	
	１３３　５年国債	150,000,000	151,741,500	
	１３４　５年国債	60,000,000	60,749,400	
	１３５　５年国債	170,000,000	172,272,900	
	１３６　５年国債	100,000,000	101,427,000	
	１３７　５年国債	130,000,000	131,972,100	
	１３８　５年国債	150,000,000	152,410,500	
	１３９　５年国債	50,000,000	50,847,500	
	１　４０年国債	30,000,000	46,264,500	
	２　４０年国債	23,000,000	34,477,460	
	３　４０年国債	19,000,000	28,768,660	
	４　４０年国債	30,000,000	45,809,700	
	５　４０年国債	35,000,000	51,832,550	
	６　４０年国債	28,000,000	40,927,040	
	７　４０年国債	31,000,000	43,639,630	
	８　４０年国債	23,000,000	30,294,910	
	９　４０年国債	40,000,000	39,430,800	
	１０　４０年国債	91,000,000	105,244,230	
	１１　４０年国債	75,000,000	84,224,250	
	３１０　１０年国債	30,000,000	30,465,600	
	３１１　１０年国債	42,000,000	42,543,060	

３１２　１０年国債	94,000,000	96,047,320	
３１３　１０年国債	34,000,000	34,926,500	
３１４　１０年国債	77,000,000	78,822,590	
３１５　１０年国債	90,000,000	92,626,200	
３１６　１０年国債	56,000,000	57,519,280	
３１７　１０年国債	40,000,000	41,220,000	
３１８　１０年国債	33,000,000	33,930,600	
３１９　１０年国債	140,000,000	144,755,800	
３２０　１０年国債	35,000,000	36,099,700	
３２１　１０年国債	65,000,000	67,250,950	
３２２　１０年国債	140,000,000	144,456,200	
３２３　１０年国債	70,000,000	72,442,300	
３２４　１０年国債	80,000,000	82,546,400	
３２５　１０年国債	160,000,000	165,545,600	
３２６　１０年国債	20,000,000	20,674,800	
３２７　１０年国債	90,000,000	93,357,900	
３２８　１０年国債	60,000,000	61,937,400	
３２９　１０年国債	160,000,000	166,819,200	
３３０　１０年国債	81,000,000	84,670,110	
３３１　１０年国債	130,000,000	134,761,900	
３３２　１０年国債	65,000,000	67,521,350	
３３３　１０年国債	83,000,000	86,396,360	
３３４　１０年国債	200,000,000	208,620,000	
３３５　１０年国債	160,000,000	166,388,800	
３３７　１０年国債	50,000,000	51,530,000	
３３８　１０年国債	70,000,000	72,649,500	
３３９　１０年国債	25,000,000	25,988,250	
３４０　１０年国債	53,000,000	55,166,110	
３４１　１０年国債	15,000,000	15,538,050	
３４３　１０年国債	192,000,000	196,602,240	
３４４　１０年国債	38,000,000	38,929,480	
３４５　１０年国債	280,000,000	286,977,600	
３４６　１０年国債	50,000,000	51,267,500	
３４７　１０年国債	180,000,000	184,561,200	
３４８　１０年国債	170,000,000	174,299,300	
３４９　１０年国債	170,000,000	174,278,900	
３５０　１０年国債	185,000,000	189,538,050	
３５１　１０年国債	130,000,000	133,160,300	
３５２　１０年国債	130,000,000	133,123,900	

３５３　１０年国債	130,000,000	133,081,000	
３５４　１０年国債	70,000,000	71,595,300	
２　３０年国債	9,000,000	11,417,130	
３　３０年国債	4,000,000	5,051,960	
４　３０年国債	8,000,000	10,731,920	
５　３０年国債	8,000,000	10,152,320	
６　３０年国債	9,000,000	11,719,980	
７　３０年国債	12,000,000	15,575,040	
１０　３０年国債	15,000,000	17,191,650	
１１　３０年国債	9,000,000	11,085,570	
１２　３０年国債	11,000,000	14,199,570	
１３　３０年国債	11,000,000	14,075,930	
１４　３０年国債	22,000,000	29,523,340	
１５　３０年国債	21,000,000	28,572,810	
１６　３０年国債	26,000,000	35,477,520	
１７　３０年国債	17,000,000	23,000,490	
１８　３０年国債	20,000,000	26,817,000	
１９　３０年国債	15,000,000	20,161,350	
２０　３０年国債	16,000,000	22,084,320	
２１　３０年国債	16,000,000	21,621,600	
２２　３０年国債	17,000,000	23,599,230	
２３　３０年国債	16,000,000	22,265,120	
２４　３０年国債	15,000,000	20,923,050	
２５　３０年国債	17,000,000	23,206,700	
２６　３０年国債	32,000,000	44,358,080	
２７　３０年国債	32,000,000	45,145,920	
２８　３０年国債	34,000,000	48,202,480	
２９　３０年国債	43,000,000	60,458,430	
３０　３０年国債	56,000,000	78,011,360	
３１　３０年国債	38,000,000	52,461,280	
３２　３０年国債	59,000,000	83,063,150	
３３　３０年国債	65,000,000	87,904,700	
３４　３０年国債	50,000,000	69,999,500	
３５　３０年国債	68,000,000	92,733,640	
３６　３０年国債	64,000,000	87,672,320	
３７　３０年国債	67,000,000	90,632,240	
３８　３０年国債	39,000,000	52,045,890	
３９　３０年国債	37,000,000	50,329,620	
４０　３０年国債	44,000,000	58,942,400	

４１　３０年国債	34,000,000	44,828,660	
４２　３０年国債	33,000,000	43,608,180	
４３　３０年国債	37,000,000	48,949,520	
４４　３０年国債	42,000,000	55,690,740	
４５　３０年国債	43,000,000	54,979,370	
４６　３０年国債	55,000,000	70,459,400	
４７　３０年国債	44,000,000	57,536,600	
４８　３０年国債	50,000,000	62,942,000	
４９　３０年国債	93,000,000	117,282,300	
５０　３０年国債	44,000,000	48,788,960	
５１　３０年国債	45,000,000	44,117,100	
５２　３０年国債	57,000,000	58,763,580	
５３　３０年国債	55,000,000	58,088,800	
５４　３０年国債	45,000,000	49,875,300	
５５　３０年国債	46,000,000	51,024,580	
５６　３０年国債	50,000,000	55,435,000	
５７　３０年国債	50,000,000	55,406,500	
５８　３０年国債	55,000,000	60,914,700	
５９　３０年国債	45,000,000	48,638,700	
６０　３０年国債	37,000,000	42,015,350	
６１　３０年国債	50,000,000	53,962,500	
６２　３０年国債	16,000,000	16,360,480	
４７　２０年国債	23,000,000	23,715,530	
４８　２０年国債	9,000,000	9,377,370	
４９　２０年国債	4,000,000	4,166,920	
５０　２０年国債	30,000,000	31,143,900	
５１　２０年国債	25,000,000	26,137,750	
５２　２０年国債	19,000,000	20,018,210	
５３　２０年国債	13,000,000	13,773,760	
５４　２０年国債	14,000,000	14,868,980	
５５　２０年国債	41,000,000	43,572,340	
５６　２０年国債	12,000,000	12,822,600	
５７　２０年国債	24,000,000	25,571,760	
５８　２０年国債	35,000,000	37,490,250	
５９　２０年国債	3,000,000	3,208,320	
６１　２０年国債	40,000,000	41,903,200	
６２　２０年国債	16,000,000	16,681,920	
６３　２０年国債	30,000,000	32,495,400	
６４　２０年国債	35,000,000	38,246,950	

６５　２０年国債	42,000,000	46,125,240	
６６　２０年国債	30,000,000	32,808,900	
６７　２０年国債	19,000,000	20,968,590	
６８　２０年国債	25,000,000	27,953,500	
６９　２０年国債	12,000,000	13,359,600	
７０　２０年国債	18,000,000	20,418,300	
７１　２０年国債	17,000,000	19,110,550	
７２　２０年国債	53,000,000	59,629,240	
７５　２０年国債	14,000,000	15,917,580	
７６　２０年国債	25,000,000	28,131,000	
７８　２０年国債	17,000,000	19,223,090	
７９　２０年国債	14,000,000	15,916,460	
８１　２０年国債	65,000,000	74,251,450	
８２　２０年国債	28,000,000	32,163,880	
８５　２０年国債	31,000,000	35,966,820	
８６　２０年国債	6,000,000	7,044,060	
８８　２０年国債	33,000,000	38,944,950	
８９　２０年国債	15,000,000	17,595,000	
９２　２０年国債	45,000,000	52,963,200	
９３　２０年国債	18,000,000	21,140,460	
９４　２０年国債	45,000,000	53,207,100	
９５　２０年国債	30,000,000	36,112,500	
９６　２０年国債	23,000,000	27,310,430	
９７　２０年国債	25,000,000	30,020,000	
９８　２０年国債	34,000,000	40,540,920	
９９　２０年国債	53,000,000	63,452,660	
１００　２０年国債	35,000,000	42,379,750	
１０１　２０年国債	18,000,000	22,116,240	
１０２　２０年国債	10,000,000	12,342,100	
１０３　２０年国債	21,000,000	25,725,840	
１０４　２０年国債	64,000,000	77,229,440	
１０５　２０年国債	38,000,000	46,033,580	
１０６　２０年国債	16,000,000	19,533,280	
１０７　２０年国債	20,000,000	24,319,800	
１０８　２０年国債	68,000,000	81,372,880	
１０９　２０年国債	35,000,000	42,001,050	
１１０　２０年国債	27,000,000	32,935,410	
１１１　２０年国債	35,000,000	43,228,500	
１１２　２０年国債	14,000,000	17,149,160	

１１３　２０年国債	100,000,000	122,938,000	
１１４　２０年国債	45,000,000	55,515,600	
１１５　２０年国債	42,000,000	52,261,860	
１１６　２０年国債	27,000,000	33,715,980	
１１７　２０年国債	47,000,000	58,179,420	
１１８　２０年国債	13,000,000	16,002,350	
１１９　２０年国債	23,000,000	27,799,870	
１２０　２０年国債	50,000,000	59,321,500	
１２３　２０年国債	42,000,000	52,510,920	
１２４　２０年国債	45,000,000	55,739,250	
１２５　２０年国債	25,000,000	31,650,250	
１２６　２０年国債	21,000,000	26,088,510	
１２７　２０年国債	23,000,000	28,300,580	
１２８　２０年国債	32,000,000	39,485,440	
１２９　２０年国債	45,000,000	54,982,350	
１３０　２０年国債	28,000,000	34,299,720	
１３１　２０年国債	47,000,000	56,995,020	
１３２　２０年国債	25,000,000	30,386,500	
１３３　２０年国債	57,000,000	69,997,140	
１３４　２０年国債	15,000,000	18,464,100	
１３５　２０年国債	20,000,000	24,362,800	
１３６　２０年国債	65,000,000	78,347,750	
１３７　２０年国債	18,000,000	21,975,300	
１３９　２０年国債	62,000,000	74,884,840	
１４１　２０年国債	48,000,000	58,848,960	
１４２　２０年国債	45,000,000	55,777,950	
１４３　２０年国債	48,000,000	58,306,080	
１４４　２０年国債	34,000,000	40,833,660	
１４５　２０年国債	85,000,000	104,697,050	
１４６　２０年国債	86,000,000	106,133,460	
１４７　２０年国債	89,000,000	108,755,330	
１４８　２０年国債	74,000,000	89,485,980	
１４９　２０年国債	67,000,000	81,137,000	
１５０　２０年国債	75,000,000	89,818,500	
１５１　２０年国債	74,000,000	86,455,680	
１５２　２０年国債	69,000,000	80,669,970	
１５３　２０年国債	72,000,000	85,368,240	
１５４　２０年国債	87,000,000	101,850,030	
１５５　２０年国債	93,000,000	105,928,860	

	１５６　２０年国債	76,000,000	79,046,080	
	１５７　２０年国債	93,000,000	93,461,280	
	１５８　２０年国債	63,000,000	66,436,020	
	１５９　２０年国債	82,000,000	87,855,620	
	１６０　２０年国債	66,000,000	71,852,880	
	１６１　２０年国債	69,000,000	73,869,330	
	１６２　２０年国債	70,000,000	74,874,100	
	１６３　２０年国債	72,000,000	76,942,080	
	１６４　２０年国債	90,000,000	94,460,400	
	１６５　２０年国債	60,000,000	62,897,400	
	１６６　２０年国債	70,000,000	76,006,700	
	１６７　２０年国債	70,000,000	73,259,900	
	１６８　２０年国債	15,000,000	15,395,100	
国債証券　合計			15,069,587,840	
地方債証券	７５１　東京都公債	100,000,000	102,695,000	
	２７－１５　北海道公債	100,000,000	101,596,500	
	４０１　大阪府公債	100,000,000	103,217,900	
	３　兵庫県公債１２年	100,000,000	103,495,600	
	１１兵庫県公債２０年	100,000,000	119,216,000	
	２８－１　静岡県公債	100,000,000	100,713,700	
	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	102,968,300	
	２９－６　千葉県公債	100,000,000	101,800,300	
	１１６　共同発行地方	100,000,000	102,972,300	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	102,744,000	
	２５－６　大阪市公債	100,000,000	103,371,500	
地方債証券　合計			1,144,791,100	
特殊債券	１２２　政保道路機構	100,000,000	101,523,100	
	１９０　政保道路機構	100,000,000	102,990,500	
	２４１　政保道路機構	100,000,000	103,358,400	
	２６１　政保道路機構	100,000,000	103,313,500	
	３６　地方公共団体	100,000,000	102,799,500	
	６５　地方公共団体	100,000,000	103,065,500	
	い７８９　利付商工債	100,000,000	100,086,700	
特殊債券　合計			717,137,200	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	100,233,800	
	３３　中日本高速道	100,000,000	102,537,700	
	２５　西日本高速道	100,000,000	102,847,200	
	１７　パナソニツク	100,000,000	101,969,400	
	５　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	102,506,200	

	４４　野村ホールディング	100,000,000	101,124,300	
	８０　三菱地所	100,000,000	116,559,700	
	３２東日本旅客鉄道	100,000,000	110,870,100	
	７０東日本旅客鉄道	100,000,000	101,612,900	
	４９７　関西電力	100,000,000	104,762,100	
社債券　合計			1,045,023,400	
合計			17,976,539,540	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	762,623,208	481,629,403
金銭信託	53,514,619	―
コール・ローン	79,576,659	153,179,066
株式	98,105,026,572	104,190,649,830
投資証券	2,496,728,263	3,065,025,533
派生商品評価勘定	30,585,522	―
未収入金	104,521,610	10,267,250
未収配当金	187,496,115	210,200,525
差入委託証拠金	741,863,712	524,451,200
流動資産合計	102,561,936,280	108,635,402,807
資産合計	102,561,936,280	108,635,402,807
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	―	31,614,045
未払金	563,380,429	10,720,229
未払解約金	17,484,100	54,250,900

その他未払費用	2,596,447	242
流動負債合計	583,460,976	96,585,416
負債合計	583,460,976	96,585,416
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	41,789,264,029	44,634,928,104
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	60,189,211,275	63,903,889,287
元本等合計	101,978,475,304	108,538,817,391
純資産合計	101,978,475,304	108,538,817,391
負債純資産合計	102,561,936,280	108,635,402,807

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6月6日 至　2019年6月5日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
1. ※1　期首	2017年6月6日	2018年6月6日
期首元本額	39,805,675,154円	41,789,264,029円
期中追加設定元本額	6,682,593,477円	6,502,632,821円
期中一部解約元本額	4,699,004,602円	3,656,968,746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	516,810,268円	458,816,981円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	16,429,883円	12,197,180円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	233,161,261円	166,937,738円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	26,978,339円	19,605,630円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	749,390,377円	536,507,951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	2,865,539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）	545,958,104円	562,712,630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）	1,346,778,483円	1,662,511,603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）	485,740,600円	536,134,777円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	1,010,996円	6,510,581円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	195,844円	441,378円

ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	527,533,212円	899,220,107円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	400,480,504円	671,270,509円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	－円	16,447,253円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	25,626,982,790円	28,298,528,476円
ダイワ・ライフ・バランス３０	545,008,515円	567,362,106円
ダイワ・ライフ・バランス５０	769,127,059円	846,468,072円
ダイワ・ライフ・バランス７０	621,040,266円	648,673,708円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,474,573,333円	1,492,040,730円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	4,413,137円	3,377,054円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	13,149,627円	13,225,157円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	3,879,429円	4,116,773円
ダイワつみたてインデックス外国株式	－円	58,160,984円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	77,536円	73,977円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	158,798円	151,649円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	675,106円	1,168,038円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	2,241,162円	1,759,327円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	324,778,874円	201,023,739円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	376,573,646円	330,653,891円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,461,884,926円	2,865,499,019円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	170,696,684円	147,919,110円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	587,946,920円	662,523,384円

	ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	62,630,901円	106,348,298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）	463,630円	452,660円
	ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,741,000,970円	2,690,012,613円
	ダイワライフスタイル２５	20,140,252円	19,377,609円
	ダイワライフスタイル５０	71,155,924円	68,025,943円
	ダイワライフスタイル７５	60,196,673円	55,805,930円
	計	41,789,264,029円	44,634,928,104円
2.	期末日における受益権の総数	41,789,264,029口	44,634,928,104口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2018年6月6日 至　2019年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2019年6月5日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	3,092,028,279	3,186,864,865
投資証券	△78,580,366	245,721,587
合計	3,013,447,913	3,432,586,452

（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6月5日まで、及び2018年12月1日から2019年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種　類	2018年6月5日 現在				2019年6月5日 現在			
	契約額等	うち	時価	評価損益	契約額等	うち	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)

		1年超				1年超		
市場取引 株価指数 先物取引 買　建	1,312,836,390	－	1,342,944,852	30,108,462	1,244,738,495	－	1,213,218,600	△31,519,895
合計	1,312,836,390	－	1,342,944,852	30,108,462	1,244,738,495	－	1,213,218,600	△31,519,895

（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	2018年6月5日 現在				2019年6月5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	98,243,940	－	98,721,000	477,060	54,029,150	－	53,935,000	△94,150
アメリカ・ドル	98,243,940	－	98,721,000	477,060	54,029,150	－	53,935,000	△94,150
合計	98,243,940	－	98,721,000	477,060	54,029,150	－	53,935,000	△94,150

（注）　1．時価の算定方法

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

①　期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
1口当たり純資産額	2.4403円	2.4317円
（1万口当たり純資産額）	(24,403円)	(24,317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 SOLUTIO	3,050	126.300	385,215.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,500	201.710	504,275.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5,150	78.160	402,524.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,600	130.080	208,128.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	17,600	33.940	597,344.000	
	ABBOTT LABORATORIES	47,316	77.460	3,665,097.360	
	ARCONIC INC	11,333	22.550	255,559.150	
	VERISK ANALYTICS INC	4,150	141.840	588,636.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	10,500	55.620	584,010.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	8,200	89.570	734,474.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,829	120.240	1,061,598.960	
	QORVO INC	3,400	64.180	218,212.000	
	AFLAC INC	20,250	53.000	1,073,250.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,400	118.020	401,268.000	

LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3,900	61.550	240,045.000	
ADOBE INC	13,200	268.710	3,546,972.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,450	43.510	280,639.500	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,050	169.000	515,450.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,000	16.080	160,800.000	
GARMIN LTD	3,650	78.290	285,758.500	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,980	213.650	1,277,627.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	20,050	168.150	3,371,407.500	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,471	122.960	549,754.160	
WR BERKLEY CORP	3,825	62.990	240,936.750	
AUTOZONE INC	670	1,036.270	694,300.900	
DOLLAR TREE INC	6,321	100.690	636,461.490	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	30,900	9.530	294,477.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,950	95.240	280,958.000	
CELANESE CORP	3,550	100.760	357,698.000	
DR HORTON INC	9,416	44.410	418,164.560	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,450	40.230	98,563.500	
DENTSPLY SIRONA INC	5,900	54.400	320,960.000	
AUTODESK INC	5,950	159.910	951,464.500	
MOODY'S CORP	4,650	184.860	859,599.000	
DEVON ENERGY CORP	12,850	25.990	333,971.500	
ALBEMARLE CORP	2,800	67.540	189,112.000	
ATMOS ENERGY CORP	3,050	101.550	309,727.500	
ALLIANT ENERGY CORP	6,250	47.950	299,687.500	
CITIGROUP INC	65,573	65.880	4,319,949.240	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	11,800	159.450	1,881,510.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	13,350	87.050	1,162,117.500	
ALLEGHANY CORP	410	683.580	280,267.800	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	284.000	312,400.000	
HESS CORP	7,200	55.840	402,048.000	
DAVITA INC	3,500	47.000	164,500.000	
DANAHER CORP	17,200	132.450	2,278,140.000	
FORTIVE CORP	8,200	77.770	637,714.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	15,550	83.810	1,303,245.500	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,900	24.700	121,030.000	

UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,728	21.700	102,597.600	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,100	39.630	598,413.000	
BUNGE LTD	4,000	54.750	219,000.000	
TE CONNECTIVITY LTD	9,425	88.100	830,342.500	
APPLE INC	127,800	179.640	22,957,992.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8,900	77.230	687,347.000	
BOEING CO/THE	14,560	344.620	5,017,667.200	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,215	99.750	420,446.250	
BECTON DICKINSON AND CO	7,199	235.220	1,693,348.780	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	19.420	130,114.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,850	78.000	300,300.000	
CDK GLOBAL INC	3,200	48.360	154,752.000	
NISOURCE INC	10,150	28.080	285,012.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,850	80.240	308,924.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	26,421	44.290	1,170,186.090	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	112,204	56.220	6,308,108.880	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	35,500	201.590	7,156,445.000	
ANSYS INC	2,250	182.360	410,310.000	
H&R BLOCK INC	5,800	27.100	157,180.000	
BB&T CORP	20,750	48.830	1,013,222.500	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	43,800	46.630	2,042,394.000	
JPMORGAN CHASE & CO	89,270	109.740	9,796,489.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,650	102.850	683,952.500	
LKQ CORP	8,500	26.390	224,315.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,150	176.100	202,515.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,562	51.780	443,340.360	
CADENCE DESIGN SYS INC	7,850	63.220	496,277.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,810	146.920	559,765.200	
DOLLAR GENERAL CORP	7,200	130.000	936,000.000	
SERVICENOW INC	4,840	257.550	1,246,542.000	
CATERPILLAR INC	16,000	122.080	1,953,280.000	
CMS ENERGY CORP	7,700	56.580	435,666.000	
MOSAIC CO/THE	9,750	22.720	221,520.000	
DELTA AIR LINES INC	4,750	54.310	257,972.500	
CORNING INC	22,000	29.870	657,140.000	
CISCO SYSTEMS INC	121,050	53.230	6,443,491.500	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	3,700	65.570	242,609.000	
MORGAN STANLEY	34,450	42.480	1,463,436.000	

WABCO HOLDINGS INC	1,400	131.110	183,554.000	
MSCI INC	2,450	224.830	550,833.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,000	278.650	278,650.000	
MIDDLEBY CORP	1,450	132.690	192,400.500	
COTY INC-CL A	13,539	13.030	176,413.170	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	6,050	56.510	341,885.500	
BROADCOM INC	11,072	265.700	2,941,830.400	
ACUITY BRANDS INC	1,150	131.880	151,662.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,430	68.800	167,184.000	
ARAMARK	6,450	35.260	227,427.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,050	25.360	153,428.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,950	126.390	625,630.500	
CENTENE CORP	10,900	53.940	587,946.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,000	109.940	329,820.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,900	34.540	445,566.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,000	85.870	429,350.000	
GARTNER INC	2,500	151.340	378,350.000	
SPLUNK INC	4,000	111.730	446,920.000	
DOMINION ENERGY INC	21,841	75.970	1,659,260.770	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,100	62.870	697,857.000	
SMITH (A.O.) CORP	4,150	43.160	179,114.000	
DEERE & CO	8,250	145.620	1,201,365.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	4,250	153.180	651,015.000	
VMWARE INC-CLASS A	2,300	174.400	401,120.000	
CHEMOURS CO/THE	4,550	23.070	104,968.500	
BURLINGTON STORES INC	1,900	158.380	300,922.000	
NASDAQ INC	3,150	92.760	292,194.000	
VAIL RESORTS INC	1,120	218.110	244,283.200	
EAST WEST BANCORP INC	4,100	45.280	185,648.000	
TARGA RESOURCES CORP	5,850	40.770	238,504.500	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,800	150.230	270,414.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,980	101.460	200,890.800	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,050	63.540	66,717.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	8,400	87.530	735,252.000	
COGNEX CORP	4,550	42.590	193,784.500	
TELEFLEX INC	1,230	292.840	360,193.200	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,300	88.490	203,527.000	

WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,400	286.330	400,862.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,350	155.580	521,193.000	
IDEX CORP	2,100	157.520	330,792.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	22,300	70.820	1,579,286.000	
ROLLINS INC	3,825	37.970	145,235.250	
AMETEK INC	6,175	83.670	516,662.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,500	75.110	488,215.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,650	29.670	108,295.500	
HEICO CORP	1,200	125.180	150,216.000	
XPO LOGISTICS INC	3,450	55.280	190,716.000	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	2,000	112.480	224,960.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,050	284.980	299,229.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,900	82.050	730,245.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	12,000	245.610	2,947,320.000	
GRUBHUB INC	2,600	64.820	168,532.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,500	168.180	252,270.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,500	87.400	131,100.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	740	662.180	490,013.200	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	8,350	18.500	154,475.000	
UGI CORP	4,600	52.540	241,684.000	
CUMMINS INC	4,050	156.340	633,177.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	21,050	43.610	917,990.500	
SABRE CORP	7,650	21.060	161,109.000	
CDW CORP/DE	4,050	102.480	415,044.000	
SIGNATURE BANK	1,500	121.260	181,890.000	
COSTAR GROUP INC	970	506.000	490,820.000	
SVB FINANCIAL GROUP	1,490	214.670	319,858.300	
AMERCO	220	386.620	85,056.400	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,650	135.230	223,129.500	
MERCADOLIBRE INC	1,170	551.710	645,500.700	
HANESBRANDS INC	9,500	15.730	149,435.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,100	132.670	278,607.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7,416	90.320	669,813.120	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	5,350	16.320	87,312.000	
IPG PHOTONICS CORP	1,020	131.540	134,170.800	
DEXCOM INC	2,450	124.750	305,637.500	

COPART INC	5,850	72.370	423,364.500	
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,250	99.130	421,302.500	
SEATTLE GENETICS INC	2,900	69.400	201,260.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,070	297.240	615,286.800	
TRANSDIGM GROUP INC	1,280	454.820	582,169.600	
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,900	22.670	224,433.000	
KINDER MORGAN INC	56,081	20.340	1,140,687.540	
HCA HEALTHCARE INC	7,350	125.530	922,645.500	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,050	299.120	314,076.000	
CABOT OIL & GAS CORP	12,050	25.480	307,034.000	
T-MOBILE US INC	9,000	75.690	681,210.000	
ZILLOW GROUP INC - C	3,450	44.360	153,042.000	
COCA-COLA CO/THE	110,600	50.000	5,530,000.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,750	56.520	324,990.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,850	71.490	346,726.500	
EATON VANCE CORP	3,050	39.750	121,237.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,650	33.000	285,450.000	
CSX CORP	21,450	76.660	1,644,357.000	
FLUOR CORP	3,650	29.150	106,397.500	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,780	166.430	462,675.400	
EXPEDIA GROUP INC	3,425	120.150	411,513.750	
AUTOLIV INC	2,400	66.040	158,496.000	
AMAZON.COM INC	11,350	1,729.560	19,630,506.000	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	6,650	18.060	120,099.000	
FLOWSERVE CORP	3,550	48.360	171,678.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,650	174.040	983,326.000	
EXXON MOBIL CORP	115,055	73.590	8,466,897.450	
FLIR SYSTEMS INC	3,750	49.520	185,700.000	
AES CORP	18,400	16.080	295,872.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	2,200	248.660	547,052.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,120	248.270	278,062.400	
EOG RESOURCES INC	15,650	84.280	1,318,982.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,450	75.920	337,844.000	
ABIOMED INC	1,170	267.060	312,460.200	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,250	82.210	349,392.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,740	67.950	593,883.000	
FORD MOTOR CO	107,123	9.920	1,062,660.160	
MACY'S INC	8,098	21.620	175,078.760	

DISCOVERY INC - A	3,990	28.620	114,193.800	
EXACT SCIENCES CORP	3,500	102.610	359,135.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	25.550	124,862.850	
DISCOVERY INC-C	10,089	26.680	269,174.520	
AERCAP HOLDINGS NV	3,400	48.110	163,574.000	
FORTINET INC	3,800	72.470	275,386.000	
MARKEL CORP	380	1,081.350	410,913.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,400	23.390	102,916.000	
NEXTERA ENERGY INC	13,000	199.380	2,591,940.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	36,408	10.320	375,730.560	
US BANCORP	41,650	52.210	2,174,546.500	
UNITED RENTALS INC	2,300	121.340	279,082.000	
F5 NETWORKS INC	1,600	136.730	218,768.000	
FASTENAL CO	15,400	31.780	489,412.000	
FISERV INC	10,600	86.160	913,296.000	
GENERAL ELECTRIC CO	234,950	10.000	2,349,500.000	
NEKTAR THERAPEUTICS	4,450	32.920	146,494.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	6,100	54.260	330,986.000	
GENERAL MOTORS CO	34,200	35.730	1,221,966.000	
TRIPADVISOR INC	2,750	45.360	124,740.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,800	167.780	1,140,904.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,090	189.880	1,726,009.200	
ALPHABET INC-CL A	8,130	1,054.490	8,573,003.700	
ALPHABET INC-CL C	8,557	1,053.050	9,010,948.850	
OWENS CORNING	3,150	51.100	160,965.000	
GENERAL MILLS INC	16,350	50.880	831,888.000	
FIRSTENERGY CORP	14,668	41.840	613,709.120	
GENUINE PARTS CO	4,000	100.880	403,520.000	
IHS MARKIT LTD	10,734	58.220	624,933.480	
FIFTH THIRD BANCORP	22,600	27.330	617,658.000	
HARRIS CORP	3,250	192.100	624,325.000	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	29.120	87,360.000	
HALLIBURTON CO	23,400	21.960	513,864.000	
HOME DEPOT INC	30,500	195.250	5,955,125.000	
ASSURANT INC	1,400	103.710	145,194.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	29,400	13.370	393,078.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,190	211.100	251,209.000	

HERSHEY CO/THE	4,150	133.130	552,489.500	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,450	34.240	152,368.000	
HUMANA INC	3,730	252.830	943,055.900	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,400	94.630	889,522.000	
HELMERICH & PAYNE	2,900	50.330	145,957.000	
HENRY SCHEIN INC	4,050	66.410	268,960.500	
HP INC	43,300	19.390	839,587.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	39,400	14.130	556,722.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,800	36.340	174,432.000	
HOLLYFRONTIER CORP	4,700	39.670	186,449.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	5,450	37.440	204,048.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,500	36.270	90,675.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,150	34.880	388,912.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	18,653	28.670	534,781.510	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	24,450	132.690	3,244,270.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	10,700	43.890	469,623.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,000	51.190	204,760.000	
ZOETIS INC	13,050	108.120	1,410,966.000	
INGERSOLL-RAND PLC	6,579	123.160	810,269.640	
CHENIERE ENERGY INC	5,850	66.140	386,919.000	
ALLEGION PLC	2,450	100.420	246,029.000	
LEGGETT & PLATT INC	3,500	37.590	131,565.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	13,573	25.050	340,003.650	
WASTE CONNECTIONS INC	7,207	91.470	659,224.290	
JUNIPER NETWORKS INC	9,650	25.880	249,742.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,170	124.600	394,982.000	
JOHNSON & JOHNSON	72,350	133.730	9,675,365.500	
ABBVIE INC	40,329	76.750	3,095,250.750	
HOLOGIC INC	7,550	45.080	340,354.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	9,300	131.430	1,222,299.000	
KROGER CO	21,850	23.630	516,315.500	
KLA-TENCOR CORP	4,350	105.320	458,142.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	6,920	349.350	2,417,502.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,440	253.650	618,906.000	
L BRANDS INC	6,500	24.030	156,195.000	

LOWE'S COS INC	21,850	96.830	2,115,735.500	
ELI LILLY & CO	24,055	117.560	2,827,905.800	
LAM RESEARCH CORP	4,230	180.420	763,176.600	
JONES LANG LASALLE INC	1,250	127.980	159,975.000	
LOEWS CORP	7,250	52.940	383,815.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,799	63.470	368,062.530	
MCDONALD'S CORP	20,650	199.630	4,122,359.500	
3M CO	15,600	164.290	2,562,924.000	
FACEBOOK INC-CLASS A	64,650	167.500	10,828,875.000	
MANPOWERGROUP INC	1,780	89.990	160,182.200	
S&P GLOBAL INC	6,730	214.830	1,445,805.900	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,720	223.660	384,695.200	
CONCHO RESOURCES INC	5,450	101.250	551,812.500	
FIRST DATA CORP- CLASS A	14,550	25.590	372,334.500	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,850	32.750	191,587.500	
PHILLIPS 66	12,600	84.120	1,059,912.000	
TECHNIPFMC PLC	12,100	21.400	258,940.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	13,250	25.640	339,730.000	
DXC TECHNOLOGY CO	7,788	48.370	376,705.560	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,200	153.120	489,984.000	
MYLAN NV	13,750	17.820	245,025.000	
METLIFE INC	22,700	48.020	1,090,054.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	16,900	23.420	395,798.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,390	254.710	354,046.900	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,200	42.380	177,996.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,478	156.940	702,777.320	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	690	741.890	511,904.100	
BAKER HUGHES A GE CO	13,273	22.040	292,536.920	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,180	157.060	499,450.800	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,940	37.990	111,690.600	
MERCK & CO. INC.	69,871	81.080	5,665,140.680	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,718	74.110	1,535,410.980	
MASCO CORP	8,600	37.190	319,834.000	
M & T BANK CORP	3,569	167.260	596,950.940	
MARSH & MCLENNAN COS	13,700	96.960	1,328,352.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,100	101.020	212,142.000	

MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,722	128.180	989,805.960	
WORKDAY INC-CLASS A	4,200	195.790	822,318.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,650	144.820	238,953.000	
SQUARE INC - A	9,050	63.390	573,679.500	
TRANSUNION	5,100	65.400	333,540.000	
VISTRA ENERGY CORP	10,050	24.270	243,913.500	
CAPRI HOLDINGS LTD	3,850	35.400	136,290.000	
WORLDPAY INC-CLASS A	8,250	121.640	1,003,530.000	
BEIGENE LTD-ADR	950	120.300	114,285.000	
NETAPP INC	6,850	61.150	418,877.500	
NIKE INC -CL B	34,300	81.620	2,799,566.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,320	201.220	1,472,930.400	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,400	84.260	539,264.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,450	85.140	293,733.000	
ALLY FINANCIAL INC	11,450	29.840	341,668.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,450	312.270	1,389,601.500	
APTIV PLC	7,300	70.510	514,723.000	
NEWMONT GOLDCORP CORP	22,461	34.360	771,759.960	
MCKESSON CORP	5,300	127.560	676,068.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,600	55.350	420,660.000	
XYLEM INC	4,800	77.400	371,520.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	41,950	78.500	3,293,075.000	
NUCOR CORP	8,700	50.150	436,305.000	
WESTERN UNION CO	11,746	20.370	239,266.020	
GODADDY INC - CLASS A	4,500	71.490	321,705.000	
NEWELL BRANDS INC	12,292	14.630	179,831.960	
EVERGY INC	6,900	58.640	404,616.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	20,500	49.690	1,018,645.000	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	700	219.390	153,573.000	
OKTA INC	2,800	113.990	319,172.000	
LIBERTY BROADBAND-C	2,850	99.790	284,401.500	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	7,305	32.730	239,092.650	
LINDE PLC	14,796	191.350	2,831,214.600	
WIX.COM LTD	1,300	138.180	179,634.000	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	6,500	21.000	136,500.000	
KKR & CO INC -A	13,500	23.570	318,195.000	
PAYCHEX INC	8,800	85.360	751,168.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,200	374.900	824,780.000	

ALTRIA GROUP INC	50,400	50.420	2,541,168.000	
PFIZER INC	155,313	42.230	6,558,867.990	
ALKERMES PLC	4,000	23.600	94,400.000	
CIGNA CORP	10,180	154.050	1,568,229.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	4,101	57.680	236,545.680	
ALTICE USA INC- A	9,200	24.800	228,160.000	
XCEL ENERGY INC	13,700	57.780	791,586.000	
STERIS PLC	2,300	135.920	312,616.000	
FOX CORP - CLASS B	4,033	34.090	137,484.970	
FOX CORP - CLASS A	9,399	34.480	324,077.520	
STRYKER CORP	9,000	186.450	1,678,050.000	
DOW INC	20,718	49.930	1,034,449.740	
PARKER HANNIFIN CORP	3,500	161.200	564,200.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	5,200	42.750	222,300.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,700	144.620	679,714.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,550	84.000	130,200.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	68,067	104.680	7,125,253.560	
EXELON CORP	26,072	48.710	1,269,967.120	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,000	117.540	705,240.000	
NVR INC	90	3,317.550	298,579.500	
CONOCOPHILLIPS	31,300	59.100	1,849,830.000	
TWILIO INC - A	2,600	128.390	333,814.000	
DOCUSIGN INC	2,900	52.940	153,526.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,400	209.020	292,628.000	
PEPSICO INC	38,150	129.070	4,924,020.500	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,100	127.310	140,041.000	
DROPBOX INC-CLASS A	5,200	21.870	113,724.000	
MONGODB INC	900	138.210	124,389.000	
SNAP INC - A	19,000	12.950	246,050.000	
CORTEVA INC	20,718	27.750	574,924.500	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,000	97.820	1,076,020.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,850	113.820	552,027.000	
ACCENTURE PLC-CL A	17,150	177.970	3,052,185.500	
PENTAIR PLC	4,705	36.350	171,026.750	
QUALCOMM INC	32,500	68.450	2,224,625.000	
INVESCO LTD	10,950	20.700	226,665.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,050	154.610	316,950.500	

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,800	54.800	427,440.000	
RAYTHEON COMPANY	7,720	179.060	1,382,343.200	
RED HAT INC	4,750	184.410	875,947.500	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,160	302.060	652,449.600	
REPUBLIC SERVICES INC	6,000	84.530	507,180.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,240	1,747.030	2,166,317.200	
ROSS STORES INC	9,900	94.640	936,936.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,650	93.600	248,040.000	
RESMED INC	3,900	114.070	444,873.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,800	97.210	369,398.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,350	55.400	185,590.000	
RALPH LAUREN CORP	1,450	111.760	162,052.000	
PERKINELMER INC	3,100	88.090	273,079.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	28,035	14.330	401,741.550	
CHEVRON CORP	51,268	117.300	6,013,736.400	
EDISON INTERNATIONAL	8,800	62.320	548,416.000	
TESLA INC	3,420	193.600	662,112.000	
SYMANTEC CORP	17,250	18.870	325,507.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,122	132.500	546,165.000	
SYNOPSYS INC	4,100	118.050	484,005.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,305	387.670	1,668,919.350	
CBRE GROUP INC - A	8,700	47.360	412,032.000	
TWITTER INC	20,150	36.100	727,415.000	
SOUTHERN CO/THE	28,450	54.200	1,541,990.000	
SYSCO CORP	13,300	69.400	923,020.000	
TRAVELERS COS INC/THE	7,123	147.550	1,050,998.650	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,550	51.960	184,458.000	
STEEL DYNAMICS INC	6,200	26.500	164,300.000	
SCHLUMBERGER LTD	37,652	35.730	1,345,305.960	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,600	45.450	209,070.000	
AT&T INC	198,291	31.480	6,242,200.680	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,050	48.950	198,247.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	11,000	18.960	208,560.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,280	435.390	992,689.200	
SEMPRA ENERGY	7,350	132.190	971,596.500	
TIFFANY & CO	2,950	92.510	272,904.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,600	44.160	335,616.000	

TEXAS INSTRUMENTS INC	25,750	109.120	2,809,840.000	
SALESFORCE.COM INC	20,850	150.810	3,144,388.500	
WESTROCK CO	7,130	35.600	253,828.000	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	24,884	39.550	984,162.200	
UNION PACIFIC CORP	19,750	170.410	3,365,597.500	
MARATHON OIL CORP	22,600	13.450	303,970.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	18,488	48.490	896,483.120	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	22,037	129.370	2,850,926.690	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	18,700	97.660	1,826,242.000	
UNUM GROUP	5,900	33.090	195,231.000	
SPRINT CORP	20,765	6.980	144,939.700	
IQVIA HOLDINGS INC	4,644	135.570	629,587.080	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	54.150	235,552.500	
AMEREN CORPORATION	6,700	74.450	498,815.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	25,976	240.760	6,253,981.760	
VERISIGN INC	2,900	194.290	563,441.000	
VALERO ENERGY CORP	11,292	73.850	833,914.200	
ULTA BEAUTY INC	1,510	335.530	506,650.300	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	7,488	39.840	298,321.920	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,300	122.410	281,543.000	
ANTHEM INC	7,030	279.810	1,967,064.300	
WALT DISNEY CO/THE	48,912	134.820	6,594,315.840	
WELLS FARGO & CO	120,222	45.680	5,491,740.960	
WASTE MANAGEMENT INC	11,500	111.450	1,281,675.000	
WILLIAMS COS INC	33,100	27.690	916,539.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,200	104.140	333,248.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	125.810	213,877.000	
WALMART INC	39,200	102.560	4,020,352.000	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	82.400	238,960.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,550	117.410	651,625.500	
WYNN RESORTS LTD	2,600	112.870	293,462.000	
XEROX CORP	5,911	33.300	196,836.300	
WABTEC CORP	4,411	65.960	290,949.560	
TJX COMPANIES INC	33,450	50.700	1,695,915.000	
WATERS CORP	2,050	201.860	413,813.000	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,800	80.520	144,936.000	
ALLERGAN PLC	9,107	128.610	1,171,251.270	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,500	177.080	265,620.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,900	51.500	1,127,850.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,523	179.220	631,392.060	
WESTERN DIGITAL CORP	7,800	39.140	305,292.000	
WEC ENERGY GROUP INC	8,680	81.290	705,597.200	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	13,400	59.400	795,960.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	47,550	162.330	7,718,791.500	
PPL CORP	18,600	30.560	568,416.000	
PULTEGROUP INC	7,500	31.940	239,550.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,450	111.710	720,529.500	
NORTHERN TRUST CORP	5,650	88.910	502,341.500	
NVIDIA CORP	15,550	143.000	2,223,650.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,050	222.970	457,088.500	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12,543	133.400	1,673,236.200	
QURATE RETAIL INC	11,450	12.950	148,277.500	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4,700	42.780	201,066.000	
TYSON FOODS INC-CL A	7,900	79.330	626,707.000	
NETFLIX INC	11,890	353.400	4,201,926.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10,800	267.970	2,894,076.000	
NRG ENERGY INC	7,950	34.880	277,296.000	
TORCHMARK CORP	2,925	88.230	258,072.750	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,500	98.700	444,150.000	
TEXTRON INC	6,850	48.390	331,471.500	
NEWS CORP - CLASS A	10,237	11.580	118,544.460	
OGE ENERGY CORP	5,300	42.650	226,045.000	
OMNICOM GROUP	6,050	78.030	472,081.500	
ORACLE CORP	71,283	52.020	3,708,141.660	
MASTERCARD INC - A	24,850	249.180	6,192,123.000	
ONEOK INC	11,250	65.100	732,375.000	
CENTURYLINK INC	27,052	10.350	279,988.200	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,820	351.660	991,681.200	
YUM! BRANDS INC	8,300	106.970	887,851.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	3,050	108.990	332,419.500	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,330	142.730	189,830.900	

MOLSON COORS BREWING CO -B	5,050	57.980	292,799.000	
NOBLE ENERGY INC	13,350	21.510	287,158.500	
BANK OF AMERICA CORP	251,101	27.920	7,010,739.920	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,900	83.780	410,522.000	
NORDSTROM INC	3,000	32.910	98,730.000	
AMERICAN EXPRESS CO	19,700	116.850	2,301,945.000	
ANALOG DEVICES INC	9,999	100.970	1,009,599.030	
ADVANCED MICRO DEVICES	25,400	29.570	751,078.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	7,700	52.020	400,554.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	23,822	53.830	1,282,338.260	
ANADARKO PETROLEUM CORP	13,300	70.600	938,980.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,800	69.400	333,120.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,950	121.510	601,474.500	
AVERY DENNISON CORP	2,300	107.690	247,687.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	15,800	61.100	965,380.000	
EMERSON ELECTRIC CO	17,000	62.460	1,061,820.000	
AON PLC	6,500	182.810	1,188,265.000	
AMGEN INC	17,200	174.730	3,005,356.000	
TAPESTRY INC	7,650	30.050	229,882.500	
EATON CORP PLC	11,536	77.770	897,154.720	
CELGENE CORP	18,750	95.340	1,787,625.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,530	184.440	835,513.200	
APPLIED MATERIALS INC	26,300	40.420	1,063,046.000	
CIT GROUP INC	2,800	49.000	137,200.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,500	58.900	147,250.000	
CME GROUP INC	9,550	194.960	1,861,868.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	10,594	21.320	225,864.080	
ECOLAB INC	7,050	190.400	1,342,320.000	
EQUIFAX INC	3,150	124.190	391,198.500	
GAP INC/THE	5,950	18.930	112,633.500	
GILEAD SCIENCES INC	34,900	64.320	2,244,768.000	
HORMEL FOODS CORP	7,750	40.350	312,712.500	
STATE STREET CORP	10,243	57.630	590,304.090	
SUNTRUST BANKS INC	11,948	62.810	750,453.880	
SCHWAB (CHARLES) CORP	32,900	43.840	1,442,336.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,700	76.210	1,044,077.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,850	38.110	184,833.500	
CROWN HOLDINGS INC	3,450	57.240	197,478.000	

CARDINAL HEALTH INC	8,300	43.950	364,785.000	
FEDEX CORP	6,800	159.590	1,085,212.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	12,604	89.920	1,133,351.680	
FMC CORP	3,600	78.140	281,304.000	
FLEX LTD	14,750	9.550	140,862.500	
CERNER CORP	9,000	70.880	637,920.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,774	143.450	397,930.300	
CITRIX SYSTEMS INC	3,700	94.360	349,132.000	
INTEL CORP	122,600	44.790	5,491,254.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	10,200	21.640	220,728.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,750	53.900	525,525.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	8,950	145.170	1,299,271.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	46,100	5.390	248,479.000	
ILLUMINA INC	3,970	313.830	1,245,905.100	
SEALED AIR CORP	4,400	43.810	192,764.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,160	474.430	1,499,198.800	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,450	112.090	386,710.500	
SNAP-ON INC	1,550	159.800	247,690.000	
CARMAX INC	4,600	80.270	369,242.000	
COMERICA INC	4,500	72.050	324,225.000	
INGREDION INC	1,900	80.470	152,893.000	
DUKE ENERGY CORP	19,878	85.900	1,707,520.200	
TARGET CORP	14,300	85.850	1,227,655.000	
DOVER CORP	3,900	94.120	367,068.000	
WW GRAINGER INC	1,300	269.490	350,337.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,400	78.920	268,328.000	
CINTAS CORP	2,500	226.500	566,250.000	
CONAGRA BRANDS INC	12,700	28.620	363,474.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,100	61.230	251,043.000	
CLOROX COMPANY	3,500	152.800	534,800.000	
ENTERGY CORP	5,050	97.440	492,072.000	
MICROSOFT CORP	198,200	123.160	24,410,312.000	
INCYTE CORP	5,000	81.560	407,800.000	
CVS HEALTH CORP	34,669	54.620	1,893,620.780	
MEDTRONIC PLC	36,538	94.410	3,449,552.580	
MICRON TECHNOLOGY INC	30,350	34.490	1,046,771.500	
BLACKROCK INC	3,160	434.530	1,373,114.800	

CENTERPOINT ENERGY INC	13,700	28.820	394,834.000	
HASBRO INC	3,350	103.040	345,184.000	
KELLOGG CO	6,850	54.600	374,010.000	
KEYCORP	28,200	16.940	477,708.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,750	117.120	322,080.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	39,461	52.140	2,057,496.540	
KOHLS CORP	4,450	50.390	224,235.500	
COOPER COS INC/THE	1,300	310.610	403,793.000	
APACHE CORP	10,610	28.340	300,687.400	
CHUBB LTD	12,349	147.350	1,819,625.150	
ARROW ELECTRONICS INC	2,400	66.340	159,216.000	
ALLSTATE CORP	9,200	97.880	900,496.000	
EBAY INC	24,500	36.540	895,230.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	30,100	108.730	3,272,773.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	3,750	71.290	267,337.500	
XILINX INC	6,900	106.900	737,610.000	
DISH NETWORK CORP-A	6,450	36.250	233,812.500	
ZIONS BANCORP NA	5,200	44.400	230,880.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,850	169.240	990,054.000	
TRIMBLE INC	7,050	41.100	289,755.000	
LENNAR CORP-A	8,100	51.400	416,340.000	
LEAR CORP	1,800	131.490	236,682.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,000	46.690	326,830.000	
PROGRESSIVE CORP	15,900	81.820	1,300,938.000	
PACCAR INC	9,537	68.620	654,428.940	
PVH CORP	2,000	91.050	182,100.000	
BIOGEN INC	5,460	227.000	1,239,420.000	
IDEXX LABORATORIES INC	2,370	252.880	599,325.600	
STARBUCKS CORP	33,400	78.520	2,622,568.000	
PTC INC	3,150	84.260	265,419.000	
PERRIGO CO PLC	3,400	44.150	150,110.000	
EVERSOURCE ENERGY	8,530	74.390	634,546.700	
INTUIT INC	7,070	247.100	1,746,997.000	
BORGWARNER INC	5,600	38.340	214,704.000	
BEST BUY CO INC	6,500	63.940	415,610.000	
BALL CORP	8,734	63.090	551,028.060	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	36,997	39.050	1,444,732.850	
ELECTRONIC ARTS INC	8,200	94.130	771,866.000	

	VULCAN MATERIALS CO	3,700	131.870	487,919.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,850	171.270	1,173,199.500	
	VF CORP	9,100	85.100	774,410.000	
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,371	48.810	457,398.510	
	VIACOM INC-CLASS B	9,271	29.360	272,196.560	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,720	145.100	249,572.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,400	126.980	304,752.000	
	CARNIVAL CORP	11,150	52.280	582,922.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	121,940	41.400	5,048,316.000	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,100	38.040	232,044.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,200	65.190	404,178.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	7.670	69,030.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	31,300	6.800	212,840.000	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 653,156,500.230 (70,625,812,370)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	MERLIN ENTERTAINMENT	19,300	3.700	71,410.000	
	TUI AG-DI	11,897	7.226	85,967.720	
	BP PLC	558,700	5.446	3,042,680.200	
	UNILEVER PLC	30,760	48.145	1,480,940.200	
	BARCLAYS PLC	468,000	1.541	721,188.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	46,800	8.790	411,372.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	42,100	2.299	96,787.900	
	PRUDENTIAL PLC	71,200	16.010	1,139,912.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	134,791	2.184	294,383.540	
	EVRAZ PLC	15,000	6.072	91,080.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	5,464	31.960	174,629.440	
	BAE SYSTEMS PLC	89,800	4.670	419,366.000	
	AVIVA PLC	107,566	4.178	449,410.740	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	138,352	15.304	2,117,339.000	
	INFORMA PLC	34,200	7.700	263,340.000	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	9,540	18.588	177,329.520	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	134,500	1.682	226,229.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	25,300	5.792	146,537.600	
	DCC PLC	2,600	66.660	173,316.000	
	OCADO GROUP PLC	13,500	11.125	150,187.500	

SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,100	84.750	177,975.000	
HALMA PLC	11,000	18.325	201,575.000	
GVC HOLDINGS PLC	16,700	6.100	101,870.000	
NMC HEALTH PLC	2,700	23.700	63,990.000	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT	3,322,800	0.001	3,322.800	
MARKS & SPENCER GROUP P-NIL	8,420	0.447	3,763.740	
RELX PLC	53,946	18.195	981,547.470	
DIAGEO PLC	67,350	32.980	2,221,203.000	
RIO TINTO PLC	31,450	46.060	1,448,587.000	
STANDARD CHARTERED PLC	78,300	6.828	534,632.400	
TESCO PLC	275,300	2.288	629,886.400	
FRESNILLO PLC	5,600	7.848	43,948.800	
SMITH & NEPHEW PLC	23,550	16.505	388,692.750	
GLENCORE PLC	311,325	2.618	815,048.850	
JOHN WOOD GROUP PLC	18,000	4.133	74,394.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	8,150	21.260	173,269.000	
SMITHS GROUP PLC	11,383	14.650	166,760.950	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	36,883	3.211	118,431.310	
PEARSON PLC	21,663	7.692	166,631.790	
SAINSBURY (J) PLC	45,225	2.025	91,580.620	
NEXT PLC	3,850	57.280	220,528.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	93,200	1.660	154,758.600	
WHITBREAD PLC	4,961	46.950	232,918.950	
BUNZL PLC	8,855	21.280	188,434.400	
VODAFONE GROUP PLC	741,183	1.336	990,813.430	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,361	50.400	169,394.400	
KINGFISHER PLC	55,411	2.189	121,294.670	
WPP PLC	35,400	9.696	343,238.400	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,727	7.872	147,418.940	
SEVERN TRENT PLC	6,333	19.760	125,140.080	
RENTOKIL INITIAL PLC	54,000	3.703	199,962.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	19,650	63.190	1,241,683.500	
ST JAMES'S PLACE PLC	15,150	10.355	156,878.250	
SCHRODERS PLC	3,450	29.330	101,188.500	
SSE PLC	28,000	10.880	304,640.000	
WEIR GROUP PLC/THE	6,850	14.820	101,517.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	28,500	5.540	157,890.000	
ASTRAZENECA PLC	35,300	59.870	2,113,411.000	

FERGUSON PLC	6,237	51.660	322,203.420	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	163,100	2.614	426,343.400	
3I GROUP PLC	27,391	10.495	287,468.540	
ASHTEAD GROUP PLC	13,650	18.970	258,940.500	
SAGE GROUP PLC/THE	29,714	7.332	217,863.040	
NATIONAL GRID PLC	93,534	7.830	732,371.220	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,970,965	0.578	1,140,991.630	
RSA INSURANCE GROUP PLC	28,760	5.590	160,768.400	
IMPERIAL BRANDS PLC	26,300	19.380	509,694.000	
CENTRICA PLC	152,660	0.940	143,561.460	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,200	35.220	112,704.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	63,010	28.380	1,788,223.800	
BHP GROUP PLC	58,327	18.006	1,050,235.960	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	9,800	25.110	246,078.000	
HSBC HOLDINGS PLC	557,250	6.477	3,609,308.250	
ANGLO AMERICAN PLC	28,683	19.354	555,130.780	
MONDI PLC	10,150	16.665	169,149.750	
WM MORRISON SUPERMARKETS	66,300	1.971	130,677.300	
CARNIVAL PLC	4,861	38.840	188,801.240	
EASYJET PLC	4,000	8.850	35,400.000	
COMPASS GROUP PLC	43,839	17.850	782,526.150	
PERSIMMON PLC	8,500	20.060	170,510.000	
BT GROUP PLC	233,200	2.016	470,247.800	
COCA-COLA HBC AG-DI	5,800	28.410	164,778.000	
BURBERRY GROUP PLC	11,339	17.320	196,391.480	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,736	49.850	236,089.600	
INTERTEK GROUP PLC	4,400	52.820	232,408.000	
ITV PLC	93,100	1.078	100,361.800	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	8,799	53.000	466,347.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	123,900	24.590	3,046,701.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	104,268	24.790	2,584,803.720	
MEGGITT PLC	21,500	4.993	107,349.500	
G4S PLC	43,500	2.073	90,175.500	
ADMIRAL GROUP PLC	5,550	20.750	115,162.500	
INVESTEC PLC	18,300	4.696	85,936.800	
ANTOFAGASTA PLC	9,800	8.046	78,850.800	

	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	2.750	194,870.500	
	EXPERIAN PLC	25,354	23.750	602,157.500	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 49,023,209.700 (6,731,376,923)	
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	14.160	488,520.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	221.800	221,800.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	17,600	18.290	321,904.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	540.600	324,360.000	
	BANK HAPOALIM BM	30,700	25.800	792,060.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	41,000	24.380	999,580.000	
	NICE LTD	1,650	494.200	815,430.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,000	79.900	239,700.000	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 4,203,354.000 (125,680,284)	
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	72,800	3.210	233,688.000	
	BHP GROUP LTD	82,150	37.310	3,065,016.500	
	SOUTH32 LTD	141,100	3.240	457,164.000	
	ALUMINA LTD	69,300	2.400	166,320.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	25,700	34.100	876,370.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	42,500	7.810	331,925.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	13,300	11.150	148,295.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	77,250	26.430	2,041,717.500	
	WESTPAC BANKING CORP	95,048	27.250	2,590,058.000	
	SANTOS LTD	48,700	6.660	324,342.000	
	AUSNET SERVICES	50,000	1.795	89,750.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	78,950	27.760	2,191,652.000	
	RIO TINTO LTD	10,300	98.560	1,015,168.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	49,500	7.110	351,945.000	
	AMCOR LIMITED	31,400	16.180	508,052.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	54,300	5.050	274,215.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	21.750	73,950.000	
	COLES GROUP LTD	31,545	12.650	399,044.250	
	OIL SEARCH LTD	38,400	6.860	263,424.000	

SEEK LTD	9,600	20.490	196,704.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	19,100	14.490	276,759.000	
NEWCREST MINING LTD	20,950	28.310	593,094.500	
INCITEC PIVOT LTD	42,300	3.340	141,282.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	49,300	78.420	3,866,106.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	7,150	26.150	186,972.500	
ORICA LTD	10,100	20.400	206,040.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	36,050	11.280	406,644.000	
CIMIC GROUP LTD	2,800	43.900	122,920.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	36,400	31.480	1,145,872.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	9.600	131,520.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	52,900	4.410	233,289.000	
CROWN RESORTS LTD	9,600	12.230	117,408.000	
TELSTRA CORP LTD	120,200	3.660	439,932.000	
AMP LTD	84,000	2.120	178,080.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	12,050	18.000	216,900.000	
MACQUARIE GROUP LTD	8,934	114.350	1,021,602.900	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	16,350	28.450	465,157.500	
BANK OF QUEENSLAND LTD	10,800	9.260	100,008.000	
CSL LTD	12,550	203.070	2,548,528.500	
WESFARMERS LTD	31,945	37.000	1,181,965.000	
COCHLEAR LTD	1,650	194.390	320,743.500	
BLUESCOPE STEEL LTD	14,400	10.590	152,496.000	
SUNCORP GROUP LTD	36,200	12.850	465,170.000	
BORAL LTD	30,500	5.200	158,600.000	
ASX LTD	5,400	75.200	406,080.000	
COMPUTERSHARE LTD	13,900	16.680	231,852.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	4.040	56,560.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	63,036	7.400	466,466.400	
SONIC HEALTHCARE LTD	12,150	25.610	311,161.500	
CHALLENGER LTD	13,900	8.040	111,756.000	
WORLEYPARSONS LTD	9,400	12.940	121,636.000	
AGL ENERGY LTD	19,000	20.410	387,790.000	
BRAMBLES LTD	44,300	12.310	545,333.000	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	43.600	61,040.000	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,850	69.170	266,304.500	
TPG TELECOM LTD	8,700	6.260	54,462.000	

	REA GROUP LTD	1,350	88.310	119,218.500	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,650	37.700	62,205.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 33,477,755.550 (2,531,922,652)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,600	35.790	272,004.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	600	1,146.310	687,786.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,996	17.910	107,388.360	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	6,787	86.990	590,401.130	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	12,000	30.320	363,840.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,850	116.110	447,023.500	
	BCE INC	4,130	61.320	253,251.600	
	FRANCO-NEVADA CORP	5,100	104.140	531,114.000	
	SUNCOR ENERGY INC	43,930	40.520	1,780,043.600	
	METRO INC/CN	7,300	49.650	362,445.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	9,500	61.600	585,200.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	33,700	70.070	2,361,359.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	12,150	105.000	1,275,750.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	50,900	74.740	3,804,266.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,300	30.780	255,474.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	39,450	103.070	4,066,111.500	
	TOURMALINE OIL CORP	6,600	17.670	116,622.000	
	VERMILION ENERGY INC	3,700	28.820	106,634.000	
	TC ENERGY CORP	25,450	66.150	1,683,517.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	13,929	48.660	677,785.140	
	BOMBARDIER INC-B	53,000	1.960	103,880.000	
	BARRICK GOLD CORP	47,900	17.720	848,788.000	
	CAE INC	7,200	35.610	256,392.000	
	THOMSON REUTERS CORP	5,412	85.000	460,020.000	
	EMPIRE CO LTD 'A'	4,600	31.150	143,290.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	56.870	90,992.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,150	63.390	263,068.500	
	HYDRO ONE LTD	9,200	23.050	212,060.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	69.840	381,326.400	
	WSP GLOBAL INC	2,700	70.950	191,565.000	
	QUEBECOR INC -CL B	5,300	31.440	166,632.000	

EMERA INC	1,700	52.480	89,216.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,300	38.000	125,400.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	10,000	71.420	714,200.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	6,400	60.660	388,224.000	
STARS GROUP INC/THE	6,300	22.840	143,892.000	
KINROSS GOLD CORP	34,100	4.770	162,657.000	
BANK OF MONTREAL	17,500	99.830	1,747,025.000	
POWER CORP OF CANADA	9,400	28.870	271,378.000	
METHANEX CORP	1,700	58.730	99,841.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	2,700	367.950	993,465.000	
NUTRIEN LTD	16,919	68.810	1,164,196.390	
AURORA CANNABIS INC	19,800	10.560	209,088.000	
CANOPY GROWTH CORP	5,500	55.000	302,500.000	
CRONOS GROUP INC	5,500	19.330	106,315.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,800	50.810	294,698.000	
CAMECO CORP	10,600	13.840	146,704.000	
TELUS CORP	5,400	50.370	271,998.000	
POWER FINANCIAL CORP	7,000	30.490	213,430.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	14,000	28.720	402,080.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	136.100	244,980.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	33,800	36.010	1,217,138.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	800	623.860	499,088.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,700	60.080	522,696.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,037	101.790	207,346.230	
BLACKBERRY LTD	13,500	10.780	145,530.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	16,550	53.570	886,583.500	
ENBRIDGE INC	56,300	47.880	2,695,644.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	23,450	62.370	1,462,576.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	54,700	23.530	1,287,091.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	8,700	28.620	248,994.000	
ENCANA CORP	41,800	7.190	300,542.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,900	302.540	1,179,906.000	
IA FINANCIAL CORP INC	2,900	51.440	149,176.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,600	48.670	272,552.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	20,150	121.140	2,440,971.000	
CGI INC - CLASS A	6,900	97.360	671,784.000	
HUSKY ENERGY INC	9,358	12.960	121,279.680	

	ONEX CORPORATION	2,200	74.480	163,856.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	12,500	27.400	342,500.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	23.850	107,325.000	
	IGM FINANCIAL INC	2,400	36.990	88,776.000	
	OPEN TEXT CORP	7,500	53.040	397,800.000	
	CI FINANCIAL CORP	7,000	20.440	143,080.000	
	SAPUTO INC	6,300	45.260	285,138.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	10.590	204,387.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	12,100	83.880	1,014,948.000	
	FORTIS INC	11,700	51.370	601,029.000	
	LUNDIN MINING CORP	16,100	6.400	103,040.000	
	CENOVUS ENERGY INC	29,300	10.750	314,975.000	
	DOLLARAMA INC	8,300	43.550	361,465.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,200	46.380	102,036.000	
	ALTAGAS LTD	6,900	19.480	134,412.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,800	21.520	103,296.000	
	KEYERA CORP	6,000	32.640	195,840.000	
	INTER PIPELINE LTD	11,500	20.670	237,705.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 50,747,823.530 (4,097,379,271)	
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	24.000	895,200.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	49,300	24.270	1,196,511.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	14,970	9.060	135,628.200	
	KEPPEL CORP LTD	39,500	5.990	236,605.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	6.760	94,640.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,400	8.300	86,320.000	
	CAPITALAND LTD	68,900	3.220	221,858.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	69,300	1.370	94,941.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	2.310	94,710.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	34.680	93,636.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	89,500	10.630	951,385.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	170,000	0.860	146,200.000	
	VENTURE CORP LTD	7,200	15.130	108,936.000	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	220,950	3.210	709,249.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	44,000	4.000	176,000.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	28,800	2.390	68,832.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.270	44,388.000	
	SATS LTD	19,600	5.040	98,784.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,800	7.390	153,712.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	55,300	2.480	137,144.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	53,400	3.300	176,220.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 5,920,899.700 (468,876,047)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFRY AG-REG	1,250	81.800	102,250.000	
	UBS GROUP AG-REG	105,550	11.625	1,227,018.750	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	230	614.000	141,220.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,250	54.780	232,815.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	19,480	263.000	5,123,240.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,100	74.550	82,005.000	
	SIKA AG-REG	3,590	150.350	539,756.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	76,300.000	228,900.000	
	ABB LTD-REG	50,300	18.750	943,125.000	
	SWISS RE AG	8,400	96.420	809,928.000	
	NESTLE SA-REG	84,900	99.300	8,430,570.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	530	694.400	368,032.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,140	211.800	241,452.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	69,770	11.590	808,634.300	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,400	40.390	258,496.000	
	SGS SA-REG	150	2,544.000	381,600.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	580	206.000	119,480.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,200	138.100	165,720.000	
	TEMENOS AG - REG	1,700	168.750	286,875.000	
	ALCON INC	11,880	58.510	695,098.800	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	850	258.900	220,065.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,152	328.000	1,361,856.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,300	167.800	218,140.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	18.595	105,991.500	
	NOVARTIS AG-REG	60,200	86.920	5,232,584.000	

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	60	1,964.000	117,840.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	14,410	76.820	1,106,976.200	
	SWISSCOM AG-REG	710	484.300	343,853.000	
	GEBERIT AG-REG	1,000	443.300	443,300.000	
	GIVAUDAN-REG	260	2,641.000	686,660.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	821.000	238,090.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,540	216.900	334,026.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,100	315.800	663,180.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	49.820	75,726.400	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	13,640	48.680	663,995.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	970	460.500	446,685.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,490	131.800	196,382.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,030	81.050	164,531.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	29	6,730.000	195,170.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 34,001,268.150 (3,705,458,202)	
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	2,300	385.200	885,960.000	
	ERICSSON LM-B SHS	83,730	91.800	7,686,414.000	
	VOLVO AB-B SHS	42,600	136.450	5,812,770.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,800	489.800	881,640.000	
	SKF AB-B SHARES	10,550	153.000	1,614,150.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,650	219.600	1,460,340.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,600	415.000	1,909,000.000	
	TELE2 AB-B SHS	13,700	128.850	1,765,245.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	45,550	85.800	3,908,190.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	43,050	93.980	4,045,839.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	24,800	138.550	3,436,040.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	23,550	146.660	3,453,843.000	
	SKANSKA AB-B SHS	9,150	157.400	1,440,210.000	
	SANDVIK AB	31,150	150.750	4,695,862.500	
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	420.800	5,175,840.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	18,550	260.600	4,834,130.000	
	SECURITAS AB-B SHS	8,450	159.400	1,346,930.000	
	TELIA CO AB	77,000	40.000	3,080,000.000	
	ALFA LAVAL AB	8,800	198.000	1,742,400.000	

	ATLAS COPCO AB-B SHS	10,300	233.900	2,409,170.000	
	ASSA ABLOY AB-B	28,250	187.650	5,301,112.500	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,200	323.400	711,480.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,250	261.200	1,371,300.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	16,550	279.300	4,622,415.000	
	BOLIDEN AB	7,800	221.500	1,727,700.000	
	EPIROC AB-A	17,950	92.580	1,661,811.000	
	EPIROC AB-B	9,700	88.730	860,681.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,450	81.200	929,740.000	
	NORDEA BANK ABP	82,800	68.830	5,699,124.000	
	KINNEVIK AB - B	6,500	246.000	1,599,000.000	
	HEXAGON AB-B SHS	7,400	453.500	3,355,900.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,600	196.400	903,440.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 90,327,677.000 (1,035,155,178)	
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	47,700	319.550	15,242,535.000	
	DANSKE BANK A/S	20,100	112.050	2,252,205.000	
	ISS A/S	4,400	194.050	853,820.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	6,780.000	644,100.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	263.200	447,440.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,250	544.800	2,860,200.000	
	CARLSBERG AS-B	2,950	864.600	2,550,570.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,800	317.500	1,841,500.000	
	COLOPLAST-B	3,350	719.800	2,411,330.000	
	DSV A/S	5,360	580.800	3,113,088.000	
	DEMANT A/S	2,675	216.800	579,940.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	170	7,138.000	1,213,460.000	
	TRYG A/S	3,300	212.400	700,920.000	
	PANDORA A/S	3,150	244.400	769,860.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,700	700.000	1,890,000.000	
	GENMAB A/S	1,700	1,135.000	1,929,500.000	
	ORSTED A/S	5,200	532.200	2,767,440.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 42,067,908.000 (685,286,222)	

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	4.260	146,970.000	
	A2 MILK CO LTD	19,000	14.090	267,710.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.740	197,056.860	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	29,400	8.850	260,190.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	5.320	106,932.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	15,100	15.010	226,651.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	11,800	11.570	136,526.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 1,342,035.860 (95,995,825)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	35,200	31.220	1,098,944.000	
	DNB ASA	26,150	150.550	3,936,882.500	
	ORKLA ASA	21,950	76.300	1,674,785.000	
	TELENOR ASA	21,300	182.000	3,876,600.000	
	EQUINOR ASA	27,023	168.300	4,547,970.900	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,960	388.000	1,924,480.000	
	MOWI ASA	11,050	205.200	2,267,460.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	5,550	174.750	969,862.500	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,400	222.200	533,280.000	
	AKER BP ASA	2,900	234.700	680,630.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 21,510,894.900 (267,380,424)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	25,770	54.500	1,404,465.000	
	EVONIK INDUSTRIES AG	5,300	24.410	129,373.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	53,150	6.241	331,709.150	
	COMMERZBANK AG	28,135	6.488	182,539.880	
	VOLKSWAGEN AG	890	147.600	131,364.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	5,130	144.660	742,105.800	
	SIEMENS AG-REG	21,300	104.280	2,221,164.000	
	E.ON SE	61,500	9.453	581,359.500	
	UNIPER SE	5,350	25.370	135,729.500	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,050	63.430	574,041.500	

GEA GROUP AG	4,500	25.390	114,255.000	
CONTINENTAL AG	2,970	126.160	374,695.200	
BASF SE	25,570	61.320	1,567,952.400	
ALLIANZ SE-REG	11,640	203.400	2,367,576.000	
THYSSENKRUPP AG	11,450	12.135	138,945.750	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,900	82.420	403,858.000	
RWE AG	15,250	22.330	340,532.500	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,650	17.485	116,275.250	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	72.060	85,030.800	
BRENNTAG AG	4,300	42.890	184,427.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	11,650	46.835	545,627.750	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	32.330	107,335.600	
HOCHTIEF AG	710	106.300	75,473.000	
SAP SE	27,342	111.140	3,038,789.880	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,120	219.100	902,692.000	
ZALANDO SE	3,550	35.280	125,244.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	4,150	68.320	283,528.000	
KION GROUP AG	1,850	50.440	93,314.000	
WIRECARD AG	3,270	145.150	474,640.500	
COVESTRO AG	5,200	41.180	214,136.000	
INNOGY SE	3,730	40.910	152,594.300	
SARTORIUS AG-VORZUG	950	168.300	159,885.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	4,300	57.460	247,078.000	
DELIVERY HERO SE	3,200	37.910	121,312.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	83.800	104,750.000	
METRO AG	5,000	14.455	72,275.000	
1&1 DRILLISCH AG	1,550	27.540	42,687.000	
AROUNDTOWN SA	22,200	7.686	170,629.200	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,000	35.280	141,120.000	
KNORR-BREMSE AG	1,450	96.400	139,780.000	
BEIERSDORF AG	2,690	103.400	278,146.000	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,950	35.340	68,913.000	
MERCK KGAA	3,500	88.560	309,960.000	
ADIDAS AG	5,010	258.000	1,292,580.000	
PUMA SE	236	525.000	123,900.000	
HENKEL AG & CO KGAA	2,850	77.750	221,587.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	92,850	15.234	1,414,476.900	

FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,870	66.600	390,942.000	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	25,350	48.580	1,231,503.000	
QIAGEN N.V.	6,498	33.820	219,762.360	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	31,550	14.874	469,274.700	
HANNOVER RUECK SE	1,610	136.400	219,604.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	27,350	26.990	738,176.500	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,190	124.800	647,712.000	
LANXESS AG	2,500	46.930	117,325.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,430	194.800	278,564.000	
AXEL SPRINGER SE	1,200	55.750	66,900.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	9,950	42.140	419,293.000	
SYMRISE AG	3,450	83.800	289,110.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	26,300	2.534	66,644.200	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,550	54.200	84,010.000	
HUGO BOSS AG -ORD	1,760	53.540	94,230.400	
RTL GROUP	1,000	42.900	42,900.000	
VONOVIA SE	13,650	47.650	650,422.500	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	25,326	35.220	891,981.720	
NN GROUP NV	8,250	35.080	289,410.000	
ARCELORMITTAL	18,800	13.858	260,530.400	
UNILEVER NV-CVA	42,400	53.570	2,271,368.000	
HEINEKEN NV	7,100	95.140	675,494.000	
AEGON NV	48,644	4.192	203,915.640	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	32,883	19.956	656,213.140	
AKZO NOBEL N.V.	6,088	77.000	468,776.000	
KONINKLIJKE DSM NV	5,000	102.200	511,000.000	
WOLTERS KLUWER	7,800	61.960	483,288.000	
ING GROEP NV	106,850	9.982	1,066,576.700	
KONINKLIJKE KPN NV	91,950	2.773	254,977.350	
ASML HOLDING NV	11,200	168.520	1,887,424.000	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	11,700	19.495	228,091.500	
ADYEN NV	300	690.000	207,000.000	
VOPAK	1,900	36.600	69,540.000	
RANDSTAD NV	3,200	46.350	148,320.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,150	88.850	279,877.500	

JCDECAUX SA	1,900	25.520	48,488.000	
TOTAL SA	66,350	47.220	3,133,047.000	
MICHELIN (CGDE)	4,750	104.050	494,237.500	
AIR LIQUIDE SA	11,992	114.300	1,370,685.600	
KERING	2,070	468.450	969,691.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	15,400	72.060	1,109,724.000	
BOUYGUES SA	6,050	31.440	190,212.000	
BNP PARIBAS	30,800	41.995	1,293,446.000	
PEUGEOT SA	16,550	20.460	338,613.000	
NATIXIS	25,350	4.105	104,061.750	
THALES SA	2,850	98.280	280,098.000	
DANONE	17,250	71.820	1,238,895.000	
CARREFOUR SA	15,800	17.025	268,995.000	
SUEZ	9,925	12.115	120,241.370	
VIVENDI	29,091	24.250	705,456.750	
L'OREAL	6,900	239.800	1,654,620.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	13,700	32.995	452,031.500	
LEGRAND SA	7,217	59.960	432,731.320	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	32.860	50,933.000	
PERNOD RICARD SA	5,937	156.300	927,953.100	
SOCIETE BIC SA	700	69.200	48,440.000	
EURAZEO SE	1,254	62.750	78,688.500	
SOCIETE GENERALE SA	20,900	22.720	474,848.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,640	342.100	2,613,644.000	
ACCOR SA	5,350	32.840	175,694.000	
CAPGEMINI SE	4,470	97.800	437,166.000	
VALEO SA	6,400	24.630	157,632.000	
PUBLICIS GROUPE	5,950	49.530	294,703.500	
BUREAU VERITAS SA	8,000	21.020	168,160.000	
EIFFAGE	2,140	85.680	183,355.200	
SODEXO SA	2,500	102.000	255,000.000	
IPSEN	1,000	109.200	109,200.000	
INGENICO GROUP	1,600	72.380	115,808.000	
AMUNDI SA	1,700	58.100	98,770.000	
TELEPERFORMANCE	1,650	170.500	281,325.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,200	71.080	156,376.000	
FAURECIA	1,900	35.320	67,108.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	320	385.000	123,200.000	

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	800	123.700	98,960.000	
SEB SA	650	148.800	96,720.000	
ESSILORLUXOTTICA	8,000	103.550	828,400.000	
DASSAULT AVIATION SA	70	1,138.000	79,660.000	
WORLDLINE SA	2,364	54.150	128,010.600	
AXA SA	53,250	22.290	1,186,942.500	
EDENRED	6,400	40.280	257,792.000	
RENAULT SA	5,350	56.570	302,649.500	
HERMES INTERNATIONAL	860	595.600	512,216.000	
STMICROELECTRONICS NV	18,550	14.130	262,111.500	
REMY COINTREAU	630	120.500	75,915.000	
ATOS SE	2,660	68.400	181,944.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,580	129.600	463,968.000	
WENDEL	780	114.800	89,544.000	
ORANGE	55,400	13.810	765,074.000	
ALSTOM	4,450	40.920	182,094.000	
CNP ASSURANCES	4,850	19.640	95,254.000	
SANOFI	30,975	73.680	2,282,238.000	
VINCI SA	13,900	89.240	1,240,436.000	
AIRBUS SE	15,950	118.480	1,889,756.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	14,450	20.650	298,392.500	
CREDIT AGRICOLE SA	32,300	10.520	339,796.000	
BIOMERIEUX	1,150	72.550	83,432.500	
ENGIE	49,973	12.655	632,408.310	
IMERYS SA	900	39.140	35,226.000	
EDF	17,050	12.440	212,102.000	
SES	9,700	13.700	132,890.000	
SAFRAN SA	9,070	120.350	1,091,574.500	
ILIAD SA	740	102.550	75,887.000	
ARKEMA	1,920	79.020	151,718.400	
ADP	810	154.900	125,469.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,700	15.755	74,048.500	
SCOR SE	4,500	37.420	168,390.000	
GETLINK SE	12,400	13.730	170,252.000	
BOLLORE	24,100	3.976	95,821.600	
UCB SA	3,550	67.840	240,832.000	
KBC GROUP NV	6,900	60.140	414,966.000	
COLRUYT SA	1,600	65.760	105,216.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,200	84.100	185,020.000	

SOLVAY SA	1,950	86.180	168,051.000	
UMICORE	5,800	27.450	159,210.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	20,800	74.300	1,545,440.000	
AGEAS	4,940	44.100	217,854.000	
PROXIMUS	4,100	25.250	103,525.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	48.520	70,354.000	
PRYSMIAN SPA	6,850	16.210	111,038.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	31,643	15.890	502,807.270	
MEDIOBANCA SPA	17,065	8.370	142,834.050	
TENARIS SA	13,300	11.110	147,763.000	
UNICREDIT SPA	54,956	10.430	573,191.080	
TELECOM ITALIA SPA	313,982	0.454	142,704.810	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.429	73,818.130	
INTESA SANPAOLO	410,237	1.866	765,584.280	
ATLANTIA SPA	13,457	21.900	294,708.300	
POSTE ITALIANE SPA	13,500	8.940	120,690.000	
MONCLER SPA	4,700	33.740	158,578.000	
RECORDATI SPA	3,050	37.510	114,405.500	
ENI SPA	70,000	14.018	981,260.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	16,200	8.775	142,155.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	5.256	57,816.000	
LEONARDO SPA	10,975	10.350	113,591.250	
ENEL SPA	222,934	5.709	1,272,730.200	
SNAM SPA	61,600	4.590	282,744.000	
TERNA SPA	38,900	5.534	215,272.600	
EXOR NV	2,880	57.900	166,752.000	
CNH INDUSTRIAL NV	27,200	8.072	219,558.400	
FINECOBANK SPA	13,000	9.376	121,888.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	29,850	11.814	352,647.900	
FERRARI NV	3,345	127.600	426,822.000	
TELEFONICA SA	128,827	7.317	942,627.150	
ENDESA SA	8,250	22.310	184,057.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	181,612	5.010	909,876.120	
IBERDROLA SA	160,934	8.456	1,360,857.900	
BANCO DE SABADELL SA	160,109	1.012	162,030.300	
BANKINTER SA	18,300	6.474	118,474.200	
REPSOL SA	39,200	14.630	573,496.000	

GRIFOLS SA	8,500	22.850	194,225.000	
BANCO SANTANDER SA	446,250	4.041	1,803,519.370	
AMADEUS IT GROUP SA	12,300	68.000	836,400.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,850	25.580	251,963.000	
MAPFRE SA	30,650	2.657	81,437.050	
CAIXABANK SA	100,300	2.812	282,043.600	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,176	37.250	267,306.000	
AENA SME SA	1,850	166.500	308,025.000	
CELLNEX TELECOM SA	5,800	30.320	175,856.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	29,750	24.830	738,692.500	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	6,650	14.305	95,128.250	
ENAGAS SA	5,900	24.200	142,780.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	11,500	18.805	216,257.500	
FERROVIAL SA	13,400	20.810	278,854.000	
BANKIA SA	30,105	2.251	67,766.350	
UPM-KYMMENE OYJ	14,850	22.800	338,580.000	
NOKIA OYJ	154,500	4.459	688,992.750	
WARTSILA OYJ ABP	12,000	13.330	159,960.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	15,550	9.736	151,394.800	
METSO OYJ	2,800	29.540	82,712.000	
ELISA OYJ	3,650	39.890	145,598.500	
SAMPO OYJ-A SHS	12,250	39.740	486,815.000	
FORTUM OYJ	12,250	18.970	232,382.500	
KONE OYJ-B	9,400	49.270	463,138.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,050	26.040	79,422.000	
NESTE OYJ	11,850	29.860	353,841.000	
ORION OYJ-CLASS B	2,750	29.620	81,455.000	
VERBUND AG	2,000	45.100	90,200.000	
OMV AG	3,550	42.700	151,585.000	
ERSTE GROUP BANK AG	8,300	32.420	269,086.000	
VOESTALPINE AG	2,850	24.200	68,970.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	20.810	70,754.000	
ANDRITZ AG	2,100	31.540	66,234.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,000	24.920	149,520.000	
AIB GROUP PLC	23,000	3.744	86,112.000	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	27,460	4.796	131,698.160	

	KINGSPAN GROUP PLC	4,400	46.460	204,424.000	
	JERONIMO MARTINS	6,000	13.915	83,490.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	66,000	3.324	219,384.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	13,950	13.380	186,651.000	
	KERRY GROUP PLC-A	4,570	103.800	474,366.000	
	CRH PLC	22,700	28.780	653,306.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,200	65.380	143,836.000	
ユーロ　小計				ユーロ 102,677,793.240 (12,496,914,215)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	37,500	54.350	2,038,125.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	46.000	2,990,000.000	
	MTR CORP	42,500	47.800	2,031,500.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	44,000	123.500	5,434,000.000	
	SINO LAND CO	90,000	12.500	1,125,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	73,669	75.200	5,539,908.800	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	20.000	640,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	13,500	94.450	1,275,075.000	
	CLP HOLDINGS LTD	45,500	88.650	4,033,575.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	39,507	40.700	1,607,934.900	
	HONG KONG & CHINA GAS	275,199	17.000	4,678,383.000	
	HANG SENG BANK LTD	21,400	195.100	4,175,140.000	
	WHEELOCK & CO LTD	22,000	51.950	1,142,900.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	169,000	11.700	1,977,300.000	
	WH GROUP LTD	265,000	7.010	1,857,650.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	33,300	244.600	8,145,180.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	16.600	946,200.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	7,600	74.200	563,920.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	19,000	21.800	414,200.000	
	NWS HOLDINGS LTD	42,500	15.220	646,850.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	17,500	30.050	525,875.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	32,640	24.200	789,888.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	17,000	40.500	688,500.000	
	SJM HOLDINGS LTD	58,000	8.470	491,260.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	32,600	32.700	1,066,020.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	72,669	56.900	4,134,866.100	

	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	18,000	61.850	1,113,300.000	
	PCCW LTD	117,000	4.460	521,820.000	
	AIA GROUP LTD	336,000	72.200	24,259,200.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	33,000	53.600	1,768,800.000	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	22,000	42.900	943,800.000	
	SANDS CHINA LTD	67,200	33.600	2,257,920.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	9.510	285,300.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	38,000	49.800	1,892,400.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	23,600	11.280	266,208.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	102,000	30.050	3,065,100.000	
	WYNN MACAU LTD	42,000	15.140	635,880.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 95,968,978.800 (1,323,412,217)	
合計				104,190,649,830 [104,190,649,830]	

(2)　株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,767	760,934.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	8,337	1,351,511.070	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,250	561,467.500	
		VORNADO REALTY TRUST	4,647	309,025.500	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,050	663,253.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	9,800	739,704.000	
		EQUINIX INC	2,158	1,038,105.900	
		AMERICAN TOWER CORP	11,900	2,475,319.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	20,043	362,778.300	
		KIMCO REALTY CORP	11,100	195,582.000	
		INVITATION HOMES INC	8,300	216,547.000	
		VENTAS INC	9,600	597,120.000	
		WEYERHAEUSER CO	20,064	469,898.880	
		AGNC INVESTMENT CORP	14,100	238,995.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	11,200	1,476,832.000	
		IRON MOUNTAIN INC	7,410	227,561.100	
		VEREIT INC	26,900	235,644.000	

	SUN COMMUNITIES INC	2,400	302,736.000	
	PROLOGIS INC	17,062	1,279,650.000	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,920	429,619.600	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,600	266,630.000	
	DUKE REALTY CORP	9,400	286,230.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,800	518,292.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,000	259,360.000	
	WELLTOWER INC	10,650	852,639.000	
	HCP INC	12,400	384,028.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,950	188,217.500	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,000	341,010.000	
	MACERICH CO/THE	2,900	107,619.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,400	287,832.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	37,700	346,086.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,150	220,821.500	
	REALTY INCOME CORP	7,950	559,680.000	
	PUBLIC STORAGE	4,290	1,019,733.000	
	REGENCY CENTERS CORP	4,600	302,910.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,400	208,248.000	
	UDR INC	7,400	330,188.000	
	WP CAREY INC	4,300	354,922.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	5,500	620,400.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,500	372,295.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 21,759,424.850 (2,352,846,610)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	19,662	163,784.460	
	SEGRO PLC	30,550	211,711.500	
	BRITISH LAND CO PLC	25,550	134,648.500	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 510,144.460 (70,047,936)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	14,900	204,577.000	
	TRANSURBAN GROUP	75,300	1,076,790.000	
	SYDNEY AIRPORT	30,300	224,826.000	
	APA GROUP	33,300	341,325.000	

	SCENTRE GROUP	143,322	541,757.160	
	DEXUS	30,750	404,670.000	
	GPT GROUP	51,160	304,913.600	
	MIRVAC GROUP	98,800	307,268.000	
	STOCKLAND	66,000	296,340.000	
	GOODMAN GROUP	44,500	608,315.000	
	VICINITY CENTRES	89,273	232,109.800	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 4,542,891.560 (343,578,889)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,500	48,690.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,700	83,953.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,900	102,102.000	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 234,745.000 (18,953,311)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	70,100	139,499.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	69,500	201,550.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	69,700	171,462.000	
	SUNTEC REIT	63,000	114,030.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 626,541.000 (49,615,782)	
ユーロ			ユーロ	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,780	515,592.000	
	ICADE	950	71,725.000	
	GECINA SA	1,250	161,750.000	
	KLEPIERRE	5,650	172,664.000	
	COVIVIO	1,270	120,142.000	
ユーロ　小計			ユーロ 1,041,873.000 (126,806,363)	
香港・ドル			香港・ドル	
	LINK REIT	59,000	5,661,050.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	75,000	577,500.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	99,000	1,243,440.000	
香港・ドル　小計			香港・ドル	

			7,481,990.000 (103,176,642)	
投資証券　合計			3,065,025,533 [3,065,025,533]	
合計			3,065,025,533 [3,065,025,533]	

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 615銘柄 投資証券 40銘柄	96.8%	3.2%	68.1%
イギリス・ポンド	株式 96銘柄 投資証券 3銘柄	99.0%	1.0%	6.3%
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄 投資証券 11銘柄	88.1%	11.9%	2.7%
カナダ・ドル	株式 86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	90.4%	9.6%	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%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	100%	-%	0.6%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 239銘柄 投資証券 5銘柄	99.0%	1.0%	11.8%
香港・ドル	株式 37銘柄 投資証券 3銘柄	92.8%	7.2%	1.3%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	3,067,386,484	3,379,392,000
金銭信託	353,158,673	－
コール・ローン	525,149,726	861,317,816
国債証券	162,140,109,061	171,499,593,659
派生商品評価勘定	9,444,566	215,093
未収入金	975,445	22,800
未収利息	1,190,123,498	1,160,393,657
前払費用	29,234,241	31,260,275
流動資産合計	167,315,581,694	176,932,195,300
資産合計	167,315,581,694	176,932,195,300
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	－	4,287,893
未払金	2,699,486,415	3,193,588,037
未払解約金	51,732,610	102,175,032
その他未払費用	18,891	2,684
流動負債合計	2,751,237,916	3,300,053,646
負債合計	2,751,237,916	3,300,053,646
純資産の部		
元本等		
元本　※1	60,553,811,990	62,672,577,238
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	104,010,531,788	110,959,564,416
元本等合計	164,564,343,778	173,632,141,654
純資産合計	164,564,343,778	173,632,141,654
負債純資産合計	167,315,581,694	176,932,195,300

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6月6日 至　2019年6月5日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在
1．※1　期首	2017年6月6日	2018年6月6日

期首元本額	59,593,264,615円	60,553,811,990円
期中追加設定元本額	6,491,291,088円	5,973,602,493円
期中一部解約元本額	5,530,743,713円	3,854,837,245円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	854,739,148円	654,072,209円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	29,450,309円	22,454,828円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	207,958,349円	152,368,413円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	56,669,778円	41,724,252円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	669,100,642円	484,204,601円
外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	10,650,859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）	353,042,211円	388,141,958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）	878,016,648円	1,241,090,560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）	634,437,238円	771,389,181円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	935,352円	2,265,454円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	27,099円	61,299円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	429,890,629円	555,040,636円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	357,073,139円	597,179,355円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	－円	8,700,775円

ＤＣダイワ外国債券インデックス	41,248,128,869円	43,717,317,336円
ダイワ・ライフ・バランス３０	716,722,091円	759,335,471円
ダイワ・ライフ・バランス５０	344,209,469円	377,147,861円
ダイワ・ライフ・バランス７０	222,130,841円	231,100,757円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	301,568,386円	360,169,154円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	246,615,112円	284,742,207円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	78,174,552円	92,710,863円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	11,141,325円	10,216,687円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	18,254,695円	18,537,253円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	1,736,790円	2,100,634円
ダイワつみたてインデックス外国債券	－円	26,939,221円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	338,604,323円	218,084,512円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	168,002,343円	154,401,436円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	6,143,671,153円	5,263,427,071円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	94,326,977円	815,488円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	32,619,487円	1,574,412円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	349,404,648円	314,888,512円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	138,957,693円	147,900,420円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	26,990,140円	30,674,106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）	373,707円	364,363円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,483,731,482円	5,618,281,887円
ダイワライフスタイル２５	35,965,029円	34,633,899円
ダイワライフスタイル５０	63,227,770円	60,827,287円
ダイワライフスタイル７５	17,914,566円	17,042,021円
計	60,553,811,990円	62,672,577,238円
2. 期末日における受益権の総数	60,553,811,990口	62,672,577,238口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2018年6月6日 至　2019年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2019年6月5日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2018年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△3,051,020,159	7,664,306,011
合計	△3,051,020,159	7,664,306,011

（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6月5日まで、及び2018年12月1日から2019年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2018年6月5日 現在				2019年6月5日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	749,028,496	－	758,473,062	9,444,566	716,511,480	－	712,438,680	△4,072,800
アメリカ・ドル	323,532,560	－	327,264,930	3,732,370	312,939,239	－	309,399,840	△3,539,399

イギリス・ポンド	50,138,238	－	50,759,160	620,922	47,583,745	－	47,742,120	158,375
オーストラリア・ドル	16,985,074	－	17,352,810	367,736	3,850,994	－	3,850,500	△494
カナダ・ドル	16,648,101	－	16,891,120	243,019	51,595,479	－	51,509,790	△85,689
シンガポール・ドル	－	－	－	－	23,732,703	－	23,712,000	△20,703
スウェーデン・クローナ	－	－	－	－	2,156,276	－	2,154,480	△1,796
デンマーク・クローネ	6,223,039	－	6,307,332	84,293	7,784,257	－	7,770,330	△13,927
ノルウェー・クローネ	－	－	－	－	12,093,167	－	12,072,240	△20,927
ポーランド・ズロチ	－	－	－	－	23,728,799	－	23,779,170	50,371
メキシコ・ペソ	15,871,398	－	15,985,920	114,522	20,124,048	－	19,716,060	△407,988
ユーロ	304,397,650	－	308,391,450	3,993,800	202,844,120	－	202,647,150	△196,970
南アフリカ・ランド	15,232,436	－	15,520,340	287,904	8,078,653	－	8,085,000	6,347
合計	749,028,496	－	758,473,062	9,444,566	716,511,480	－	712,438,680	△4,072,800

（注） 1. 時価の算定方法

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

① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2018年6月5日現在	2019年6月5日現在

1口当たり純資産額	2.7177円	2.7705円
（1万口当たり純資産額）	(27,177円)	(27,705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 20200815	2,854,000.000	2,872,379.760	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,550,347.530	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,190,780.160	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,610,871.970	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,548,139.720	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,161,073.750	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,237,089.440	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,452,557.420	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,525,707.600	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,144,335.040	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,371,054.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,663,730.100	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,442,616.330	

		1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,125,331.540	
		2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,822,787.770	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,683,250.640	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	1,994,634.260	
		2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,884,547.600	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,336,558.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,204,969.440	
		2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,502,150.460	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,018,918.640	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,431,205.430	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,651,759.830	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,736,288.880	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,838,067.050	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,051,648.160	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	7,907,000.000	7,959,739.690	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,738,174.320	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,502,425.000	
		8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	692,576.760	
		8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,412,591.480	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	768,960.120	

		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,068,279.750	
		6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	823,674.600	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	929,867.680	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	898,457.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	936,042.300	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	773,000.000	985,026.170	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,349,185.480	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,591,000.000	2,117,700.550	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,326,000.000	1,729,077.480	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	747,000.000	1,040,541.120	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	715,567.440	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	688,604.010	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,463,952.900	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,448,006.910	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,413,849.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,589,722.200	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	2,710,000.000	3,675,003.900	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,944,028.180	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,961,273.430	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,903,838.690	

		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,423,940.300	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,800,093.750	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,656,311.880	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,600,771.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,790,104.080	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,461,442.950	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,308,371.080	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,722,234.100	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,326,000.000	2,563,321.780	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,398,000.000	3,593,894.700	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,658,354.720	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,357,611.470	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,321,736.280	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,201,527.300	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,856,785.360	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,162,000.000	5,279,332.260	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,629,000.000	4,002,097.490	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,304,850.960	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,647,076.250	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,170,592.130	

		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,018,104.400	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,990,201.600	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,887,010.100	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,191,278.070	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,405,375.430	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,762,698.490	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,704,184.310	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,804,188.060	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,883,772.500	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,843,159.640	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	4,146,862.200	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,604,843.120	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,828,402.100	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,994,168.750	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,985,394.800	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,844,781.030	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,118,071.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,189,546.360	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,754,198.850	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,775,374.720	

		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,447,078.250	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,844,224.280	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,464,064.880	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,851,496.480	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,933,031.200	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,088,953.120	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	4,010,059.530	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,560,174.300	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,079,281.600	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,316,926.120	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,033,231.970	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	3,492,000.000	3,524,720.040	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,097,178.280	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,241,455.140	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,551,396.250	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,365,576.120	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,263,997.600	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,206,721.860	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,967,026.700	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,094,785.330	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,029,000.000	6,855,453.990	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,426,455.500	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,051,390.700	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,357,997.230	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,673,621.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,476,350.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,463,475.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,941,860.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,406,576.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,239,358.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,640,726.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,642,169.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,711,139.400	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,351,424.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,452,545.300	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,993,267.160	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,489,220.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,957,340.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,472,650.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,532,910.000	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,515,472.700	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,393,808.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	2,008,420.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,538,850.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,419,672.800	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,011,866.200	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,519,134.400	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	3,830,230.700	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,012,107.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,324,058.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	5,550,000.000	5,608,941.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,903,828.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,836,686.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	3,778,600.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,002,550.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,014,040.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	2,991,300.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	2,000,000.000	2,011,240.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615	2,700,000.000	2,682,801.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	2,992,500.000	

		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,410,872.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715	2,000,000.000	1,986,640.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,980,653.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815	1,300,000.000	1,291,108.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,902,465.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,031,380.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	3,906,248.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,177,984.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,996,700.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915	2,500,000.000	2,479,775.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,502,925.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,400,000.000	3,435,564.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015	1,000,000.000	994,720.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,512,100.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,572,600.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,100,000.000	3,187,420.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,558,765.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20201115	3,600,000.000	3,588,300.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	1,998,040.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,230,720.000	

		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	1,300,000.000	1,321,931.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,302,231.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,563,140.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,630,750.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,512,975.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,390,486.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,678,000.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,817,477.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	3,884,040.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,225,600.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,968,179.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,007,387.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,521,575.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,900,000.000	4,310,085.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,909,760.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	3,041,820.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,582,600.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,997,223.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	1,400,000.000	1,404,858.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	1,900,000.000	1,998,249.000	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,584,375.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	5,076,350.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,574,200.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,300,000.000	3,313,266.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,134,280.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,351,150.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,300,000.000	3,319,833.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,500,000.000	2,587,500.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,000,000.000	6,382,920.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,200,000.000	4,536,966.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,547,550.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,631,050.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,500,000.000	2,517,075.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,727,944.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,763,656.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,570,665.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20200930	3,300,000.000	3,330,789.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,651,750.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,123,750.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,069,960.000	

		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,652,725.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,300,000.000	3,339,303.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,167,480.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,096,680.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	6,400,000.000	6,949,952.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,400,000.000	5,101,932.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,500,000.000	2,528,025.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,161,940.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	3,000,000.000	3,128,670.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,854,572.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20201231	1,000,000.000	1,008,240.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,558,470.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,580,450.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	2,000,000.000	2,032,720.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,888,750.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,051,660.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,000,000.000	3,026,820.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,108,400.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,597,850.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,600,000.000	4,976,234.000	

	2.5% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,000,000.000	3,029,160.000	
	2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,579,275.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,373,986.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,552,080.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,539,825.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,742,032.000	
	2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,428,288.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	1,300,000.000	1,372,917.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	1,500,000.000	1,534,095.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,558,485.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,867,368.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 751,731,203.380 (81,284,695,022)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20200722	2,280,000.000	2,314,450.800	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,969,284.030	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,513,312.820	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,312,581.800	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,543,787.700	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	1,300,000.000	1,297,322.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,210,000.000	1,213,872.000	

		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,200,000.000	1,272,360.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,430,000.000	1,571,856.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,110,000.000	2,184,483.000	
		0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,011,060.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,300,000.000	2,450,535.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	930,000.000	1,015,932.000	
		1% United Kingdom Gilt 20240422	600,000.000	610,206.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	70,000.000	74,452.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	340,000.000	357,765.000	
		8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,265,757.200	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,393,331.290	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,849,334.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,831,609.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,935,020.800	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,303,517.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	3,080,719.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,385,160.800	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,583,514.240	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,596,000.000	2,567,166.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,330,000.000	1,872,906.000	

		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,563,513.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,873,485.600	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,512,308.780	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,310,000.000	1,906,574.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,374,000.000	2,476,222.800	
		3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,864,466.500	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,403,348.000	
		3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	860,125.420	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,352,000.000	2,173,340.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,327,196.000	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,966,000.000	2,681,427.400	
		2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,075,590.180	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,827,186.100	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,543,240.800	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,033,496.800	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 80,902,818.660 (11,108,766,030)	
	オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,420,000.000	2,634,339.400	
		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,467,231.160	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,409,488.840	

		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,232,936.080	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,656,274.030	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,672,709.120	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,698,000.000	3,000,796.540	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,358,000.000	1,836,178.960	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,390,145.280	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,430,316.300	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	632,100.310	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,213,767.250	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	712,000.000	862,766.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	2,949,273.440	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,078,000.000	2,212,945.320	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,471,438.040	
		2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,840,032.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,108,952.000	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	750,000.000	778,462.500	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	2,125,074.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	1,570,000.000	1,721,928.900	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	290,000.000	324,956.600	
	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 45,972,112.070	

				(3,476,870,836)	
	カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 425,000.000	カナダ・ドル 566,478.250	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	575,846.380	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,369,142.060	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,713,614.770	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,681,766.560	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,923,751.830	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,876,000.000	1,910,668.480	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	991,113.880	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,822,773.490	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	2,146,921.350	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,260,480.410	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,483,722.150	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,197,000.000	1,475,422.200	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,214,794.160	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,831,000.000	1,813,733.670	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,136,327.210	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,837,000.000	1,816,462.340	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,460,538.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,200,220.800	

		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840,000.000	820,957.200	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,400,000.000	1,384,558.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,255,836.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,623,456.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	600,000.000	616,296.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	550,000.000	586,591.500	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200801	300,000.000	300,765.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,100,000.000	1,180,025.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20201101	2,200,000.000	2,216,324.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	600,000.000	624,948.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210201	300,000.000	304,131.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210501	1,050,000.000	1,057,350.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,000,000.000	1,008,430.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210801	400,000.000	401,068.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 40,944,513.690 (3,305,860,035)	
	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	708,326.160	
		3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	856,920.000	
		3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	456,431.040	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	658,511.000	

		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	384,668.500	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	499,405.500	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	420,200.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	509,157.180	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	468,000.000	530,449.920	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	134,000.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	538,934.000	
		2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	224,586.880	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	568,000.000	591,878.720	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	253,375.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	454,429.400	
		1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	199,874.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	300,000.000	295,572.000	
		1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	200,000.000	199,706.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	575,608.000	
		2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	190,000.000	191,474.400	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 8,683,507.700 (687,646,975)	
スウェーデン・クローナ			スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
		5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,095,000.000	9,856,342.450	
		3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	6,469,750.500	

	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,489,688.250	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,652,051.500	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,958,806.300	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	6,182,680.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,885,244.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	2,550,000.000	2,733,957.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 53,228,520.000 (609,998,839)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	21,489,680.640	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	8,232,142.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,302,638.580	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	7,363,000.000	8,432,623.010	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,460,584.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	1,500,000.000	1,519,995.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 53,437,663.730 (870,499,543)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,360,006.540	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,377,813.600	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,448,930.850	

		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,508,936.200	
		1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,403,526.800	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,570,888.000	
		2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,694,530.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,100,000.000	2,172,891.000	
	ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 33,537,522.990 (416,871,411)	
	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	2,595,108.190	
		2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,401,989.800	
		2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,143,803.300	
		1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,059,420.760	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	2,870,000.000	2,874,161.500	
		2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,353,199.200	
		2.5% Poland Government Bond 20230125	2,850,000.000	2,910,420.000	
		Poland Government Bond 20200725	300,000.000	295,017.000	
		2.5% Poland Government Bond 20240425	2,190,000.000	2,237,654.400	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	750,000.000	762,675.000	
		Poland Government Bond 20210525	800,000.000	775,040.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,059,899.740	
		5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,371,056.000	

	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,187,793.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,413,346.250	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	2,750,000.000	2,794,687.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,739,593.850	
ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 35,974,865.490 (1,023,844,672)	
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	563,677.290	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	821,681.820	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,245,075.320	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,948,054.680	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,576,785.580	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,341,145.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	874,125.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	738,931.350	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	629,253.780	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,001,660.660	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,404,895.770	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,182,204.800	
	3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	660,900.320	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	641,292.000	

		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,087,314.760	
		4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	869,889.280	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	747,797.050	
		3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	703,717.000	
		3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,172,644.830	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	832,857.600	
		3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	709,560.540	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	962,661.600	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	659,438.000	
		3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	354,161.280	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500,000.000	506,405.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	769,005.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	898,401.600	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,119,447.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,214,916.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	500,000.000	504,415.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	748,825.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	400,000.000	436,028.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	250,000.000	254,200.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	410,000.000	416,367.300	

	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	600,000.000	642,870.000	
マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 30,240,605.210 (783,231,674)	
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	13,559,783.600	
	8% Mexican Bonos 20471107	7,000,000.000	6,709,150.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	9,844,400.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	4,800,000.000	4,827,120.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	20,633,000.000	20,744,830.860	
	10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	24,236,673.060	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	24,168,000.000	23,503,138.320	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	10,285,320.960	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	14,344,000.000	14,803,581.760	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	12,194,000.000	12,406,419.480	
	8% Mexican Bonos 20200611	18,928,000.000	18,919,482.400	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	27,826,000.000	27,076,367.560	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	12,674,657.750	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	23,689,574.970	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	17,514,054.060	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	6,662,559.680	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 247,457,114.460 (1,363,488,700)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	437,266.080	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	439,291.260	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	299,316.780	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	431,184.210	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	203,868.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	200,000.000	234,854.000	
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	782,065.900	

		0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	313,989.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	408,927.700	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	522,360.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	519,290.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	955,638.180	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,201,205.540	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	534,000.000	621,036.660	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	150,000.000	171,712.500	
		Austria Government Bond 20230715	900,000.000	917,253.000	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	607,445.600	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	440,000.000	638,514.800	
		Austria Government Bond 20220920	400,000.000	406,968.000	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,066,110.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	300,000.000	311,451.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,486,731.290	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,124,000.000	1,200,533.160	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	656,743.680	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,384,472.470	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	944,000.000	1,040,637.280	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	440,000.000	535,642.800	

		0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	503,352.500	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,489,558.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	650,000.000	677,820.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	571,430.400	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	330,129.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,140,000.000	1,208,582.400	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	600,743.000	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	800,000.000	852,152.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	389,063.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,284,939.760	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,140,120.520	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,072,528.160	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,832,987.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,611,983.040	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,406,981.440	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	3,039,439.000	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,467,413.170	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,200,345.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,707,400.760	
		3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,003,693.280	

		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	2,288,493.180	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,496,070.640	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,452,309.620	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,811,184.300	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,508,871.100	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	3,002,282.990	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,389,161.060	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,338,000.000	3,555,490.120	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,761,282.960	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,523,857.500	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,972,462.520	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,778,135.970	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,736,393.960	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,409,000.000	3,735,515.850	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,760,923.680	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,669,693.020	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,326,056.860	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,337,135.460	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,311,803.440	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,940,459.000	

		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,680,512.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,463,277.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,350,000.000	1,663,551.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,500,000.000	1,607,190.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,500,000.000	1,571,220.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,700,000.000	1,776,313.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20200612	800,000.000	805,008.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20200911	350,000.000	352,835.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20201211	700,000.000	706,874.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210312	400,000.000	404,656.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,465,564.240	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,597,156.920	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,422,050.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,182,283.600	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,146,977.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	730,000.000	748,301.100	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	900,000.000	924,372.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,050,000.000	1,079,578.500	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,333,936.250	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,240,505.500	

		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,621,018.260	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,762,608.830	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,459,000.000	4,019,899.430	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,364,000.000	2,448,420.920	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,497,347.100	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	4,161,742.720	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,958,148.430	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	5,324,926.920	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	2,164,119.810	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,958,674.720	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,247,108.040	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,534,705.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	4,007,883.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,199,000.000	3,949,453.410	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,951,115.360	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,438,000.000	3,672,944.520	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,647,761.420	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,496,468.860	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	4,087,000.000	5,076,176.610	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,792,162.330	

		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,445,999.760	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,601,000.000	2,809,730.250	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,220,390.570	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,420,000.000	5,011,086.600	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,737,000.000	3,910,882.610	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,269,000.000	2,464,020.550	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	887,000.000	997,626.640	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,802,796.800	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,875,152.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,066,960.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,420,000.000	1,660,661.600	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,710,000.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,250,000.000	2,731,140.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,446,032.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,351,576.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	2,400,000.000	2,425,032.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,550,000.000	1,698,536.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,100,000.000	2,223,207.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,400,000.000	2,445,336.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	400,000.000	405,852.000	

		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	800,000.000	862,192.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	1,200,000.000	1,237,176.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	400,000.000	406,120.000	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	710,613.520	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,853,866.140	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,230,302.900	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	917,393.890	
		3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,198,418.040	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,549,000.000	2,690,210.260	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,584,253.440	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,567,995.200	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,540,673.760	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,517,239.800	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,249,000.000	1,996,114.330	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,707,504.340	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,341,865.400	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,415,082.180	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,219,632.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,293,408.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	800,000.000	818,448.000	

		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,241,850.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	719,775.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	400,000.000	408,204.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,455,529.180	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,497,845.100	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,161,578.160	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,880,138.440	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,442,561.210	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,640,745.090	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,651,724.830	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,585,323.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	1,897,032.290	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,516,197.440	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	777,823.560	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,318,478.400	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,323,143.200	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,741,242.840	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,669,429.980	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	851,114.880	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,489,004.160	

		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	676,613.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,344,175.560	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	648,000.000	562,587.120	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,700,000.000	1,642,200.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,010,000.000	2,017,155.600	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,311,895.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,254,900.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	970,000.000	973,191.300	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,496,095.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,300,000.000	1,287,715.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,685,533.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,200,000.000	1,179,576.000	
		0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015	1,900,000.000	1,898,442.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,200,000.000	1,181,580.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,477,230.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	886,392.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,270,529.000	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	1,500,000.000	1,486,110.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,607,117.500	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	1,400,000.000	1,452,458.000	

		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,100,000.000	1,134,034.000	
		2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	700,000.000	723,814.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,000,000.000	1,055,070.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	850,000.000	920,252.500	
		1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,050,000.000	1,044,004.500	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,000,000.000	1,045,360.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	500,000.000	499,905.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	500,000.000	499,995.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,454,000.000	3,058,739.220	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,804,924.970	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,655,000.000	2,199,693.600	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,139,811.140	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,175,271.100	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,909,686.840	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	2,582,386.740	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,547,051.520	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,475,454.860	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,581,841.250	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,316,663.180	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,391,533.100	

		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,264,278.400	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,479,697.910	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,227,123.040	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,880,429.880	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,175,623.700	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,907,351.700	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,113,741.880	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,413,000.000	1,754,352.540	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,475,336.620	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,831,253.060	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,414,695.090	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,103,834.660	
		2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,641,841.380	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,516,844.740	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,806,351.680	
		4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	990,431.180	
		3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	1,834,708.960	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,747,552.940	
		4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,608,920.820	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,320,098.780	

		4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,527,073.240	
		4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	980,961.200	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,487,842.620	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	853,000.000	1,368,757.920	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,730,689.800	
		3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	800,469.540	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,490,861.580	
		5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	823,009.950	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	585,900.000	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	713,880.560	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	914,333.890	
		0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	533,538.840	
		2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	919,119.850	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,145,373.850	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	612,436.000	
		IRISH TREASURY 20221018	50,000.000	50,619.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	527,910.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	747,257.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	217,314.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	320,208.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	300,000.000	308,466.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,252,993.500	
		3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,309,763.520	
		3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,462,798.330	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	2,050,331.990	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,179,605.000	
		3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	894,090.540	

		3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	991,786.640	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	630,368.220	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	965,151.600	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,052,723.070	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	794,892.420	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,033,494.800	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	844,261.920	
		3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	494,072.190	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	487,028.000	
		1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	655,494.840	
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	480,609.600	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	589,368.560	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	591,797.590	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,551,990.400	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,902,643.300	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,307,350.880	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	2,020,587.520	
		1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,650,000.000	1,679,634.000	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,936,974.100	
		0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,789,155.110	

		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,452,000.000	1,825,178.520	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	950,000.000	1,320,291.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,730,000.000	1,857,068.500	
		0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,124,553.600	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	1,956,258.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,450,000.000	1,692,411.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,221,113.500	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	1,300,000.000	1,308,684.000	
		0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,000,000.000	1,024,460.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,100,000.000	2,265,984.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	850,000.000	1,027,956.000	
		0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	1,400,000.000	1,429,134.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,200,000.000	1,290,384.000	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,200,000.000	1,211,184.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,900,000.000	2,043,260.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	800,000.000	870,568.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	400,000.000	406,072.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,168,082.150	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,425,789.480	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,308,000.000	2,129,267.040	

		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,066,740.680	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	3,000,958.060	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,800,322.030	
		4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,805,057.800	
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,795,749.450	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,749,093.950	
		5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,304,251.320	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,146,525.920	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,280,952.870	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,513,028.300	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,499,000.000	2,592,805.310	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,344,969.800	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,409,599.790	
ユーロ　小計				ユーロ 539,141,072.800 (65,618,859,971)	
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	19,434,000.000	21,595,060.800	
		6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,612,000.000	8,363,659.120	
		6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,636,466.860	
		6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,260,847.600	
		7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	9,999,000.000	8,383,661.550	

		7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	7,439,000.000	7,505,207.100	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	20,052,000.000	17,956,566.000	
		8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,852,443.370	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	11,862,000.000	10,935,815.040	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	11,944,000.000	10,707,198.800	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	10,743,000.000	9,803,094.930	
		8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	6,166,000.000	5,762,866.920	
		9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	7,179,000.000	6,648,471.900	
	南アフリカ・ランド　小計			南アフリカ・ランド 128,411,359.990 (948,959,951)	
国債証券　合計				171,499,593,659 [171,499,593,659]	
合計				171,499,593,659 [171,499,593,659]	

（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	244銘柄	100%	47.3%
イギリス・ポンド	国債証券	42銘柄	100%	6.5%
オーストラリア・ドル	国債証券	22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%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	6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・リンギット	国債証券	35銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	100%	0.8%

ユーロ	国債証券	307銘柄	100%	38.3%
南アフリカ・ランド	国債証券	13銘柄	100%	0.6%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

２ 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2019年6月28日

Ⅰ	資産総額	10,697,586,682円
Ⅱ	負債総額	12,704,816円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,684,881,866円
Ⅳ	発行済数量	6,022,243,875口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7742円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2019年6月28日

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

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

純資産額計算書

2019年6月28日

Ⅰ	資産総額	18,348,364,851円
Ⅱ	負債総額	3,508,736円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	18,344,856,115円
Ⅳ	発行済数量	14,003,785,708口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3100円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2019年6月28日

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

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2019年6月28日

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

第４　【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部　【委託会社等の情報】

第１　【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2019年6月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．ファンド個別会議

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

ロ．投資環境検討会

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年6月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	75	145,253
追加型株式投資信託	721	15,318,969
株式投資信託　　合計	796	15,464,222
単位型公社債投資信託	30	111,005
追加型公社債投資信託	14	1,392,102
公社債投資信託　合計	44	1,503,108
総合計	840	16,967,330

３ 【委託会社等の経理状況】

１．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当事業年度（2018年４月１日から2019年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

３．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （2018年３月31日）		当事業年度 （2019年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		28,709		28,489
有価証券		0		554
前払費用		201		214
未収委託者報酬		12,368		11,468
未収収益		82		98
その他		47		56
流動資産計		41,410		40,882
固定資産				
有形固定資産	※1	213	※1	206
建物		12		10
器具備品		200		195
無形固定資産		2,614		2,821
ソフトウェア		2,456		2,804
ソフトウェア仮勘定		158		17
投資その他の資産		15,066		12,799
投資有価証券		8,600		8,493
関係会社株式		5,129		1,836
出資金		183		183
長期差入保証金		1,072		1,070
繰延税金資産		1,078		1,183
その他		34		31
固定資産計		18,927		15,827
資産合計		60,337		56,709

（単位:百万円）

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

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

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

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

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

（単位:百万円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,532	△11,532	△11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△47	△47	△47
当期変動額合計	△47	△47	1,090
当期末残高	216	216	41,112

当事業年度（自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）

（単位：百万円）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△170	△170	△170
当期変動額合計	△170	△170	△969
当期末残高	46	46	40,142

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	**10～18年**
器具備品	**４～20年**

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（会計方針の変更）

（税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用）

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

（未適用の会計基準等）

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

(1) 概要

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

ステップ１：顧客との契約を識別する。
ステップ２：契約における履行義務を識別する。
ステップ３：取引価格を算定する。
ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

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

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2018年３月31日）	当事業年度 （2019年３月31日）
建物	29百万円	31百万円
器具備品	235百万円	264百万円

※２　関係会社項目

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

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

３　保証債務

前事業年度（2018年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2019年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	１株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2017年６月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 ３月31日	2017年 ６月27日

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

2018年６月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額	12,669百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ １株当たり配当額	4,857円
④ 基準日	2018年３月31日
⑤ 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。

① 剰余金の配当の総額	11,868百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ １株当たり配当額	4,550円
④ 基準日	2019年３月31日
⑤ 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ます。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

（ii）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

②信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（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、記載しておりません。

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、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（2018年３月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	134	55	79
（２）その他			
証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			

証券投資信託	3,299	3,522	△223
小計	3,299	3,522	△223
合計	7,631	7,318	312

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　970百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（2019年３月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	87	55	32
（２）その他			
証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,301	3,560	△258
小計	3,301	3,560	△258
合計	8,380	8,328	52

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１）株式	389	86	-
（２）その他			
証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度171百万円、当事業年度174百万円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

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

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

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（2018年３月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（2019年３月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,701	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証（注１）	1,719	－	－
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有) 直接91.0	経営管理	有償減資（注２）	3,293	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注１) シンガポール通貨庁（MAS）に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

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

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	－	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自　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㈱	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	㈱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㈱	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す。

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

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

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

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 （自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）	当事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）
１株当たり純資産額　15,760.66円	１株当たり純資産額　15,389.06円
１株当たり当期純利益　4,857.40円	１株当たり当期純利益　4,550.81円

(注１)潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

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

(注３)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③ 通常の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④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

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

①　名称　三井住友信託銀行株式会社

②　資本金の額　342,037百万円（2019年3月末日現在）

③　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

① 名　称	② 資本金の額 単位：百万円 （2019年3月 末日現在）	③ 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。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	
岡三証券株式会社	5,000	
岡三オンライン証券株式会社	2,500	
カブドットコム証券株式会社	7,196	
第四証券株式会社	600	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
楽天証券株式会社	7,495	
ワイエム証券株式会社	1,270	
株式会社北九州銀行	10,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社高知銀行	19,544	
株式会社清水銀行	10,816	
株式会社東邦銀行	23,519	
株式会社東北銀行	13,233	
株式会社富山銀行	6,730	
日本生命保険相互会社	1,350,000	（注1）
三井住友信託銀行株式会社	342,037	（注2）
株式会社宮崎太陽銀行	12,252	銀行法に基づき銀行を営んでいます。
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	
株式会社りそな銀行	279,928	（注2）

（注1）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

（注2）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 【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充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】

該当事項はありません。

＜再信託受託会社の概要＞

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

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

第３　【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
2018年7月27日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年8月29日	有価証券届出書、有価証券報告書
2018年10月19日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年2月26日	半期報告書、有価証券届出書

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7月12日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス５０の2018年6月6日から2019年6月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス５０の2019年6月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

(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。