【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2020年2月21日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社 （2020年4月1日より、大和アセットマネジメント株式会社（予定））
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワライフスタイル７５
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部　【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワライフスタイル７５

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

(5) 【申込手数料】

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、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

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

(7) 【申込期間】

2020年2月22日から2020年8月26日まで（継続申込期間）
(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

① 受益権の取得申込者は、申込取扱場所において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

② 委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

③ 当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

④ 「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

⑤ 取得申込金額に利息は付きません。

⑥ 振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部　【ファンド情報】

第１　【ファンドの状況】

１　【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

（注1）商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

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

・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行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（　　）	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他（合成インデックス）
資産配分固定型		中近東（中東）			
資産配分変更型	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＞

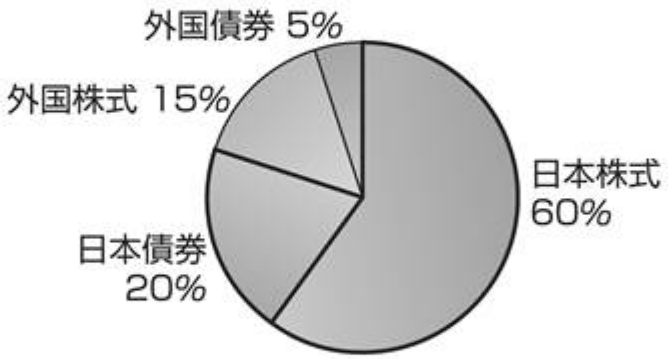
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜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	60%	15%	75%
債 券	20%	5%	25%
合 計	80%	20%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

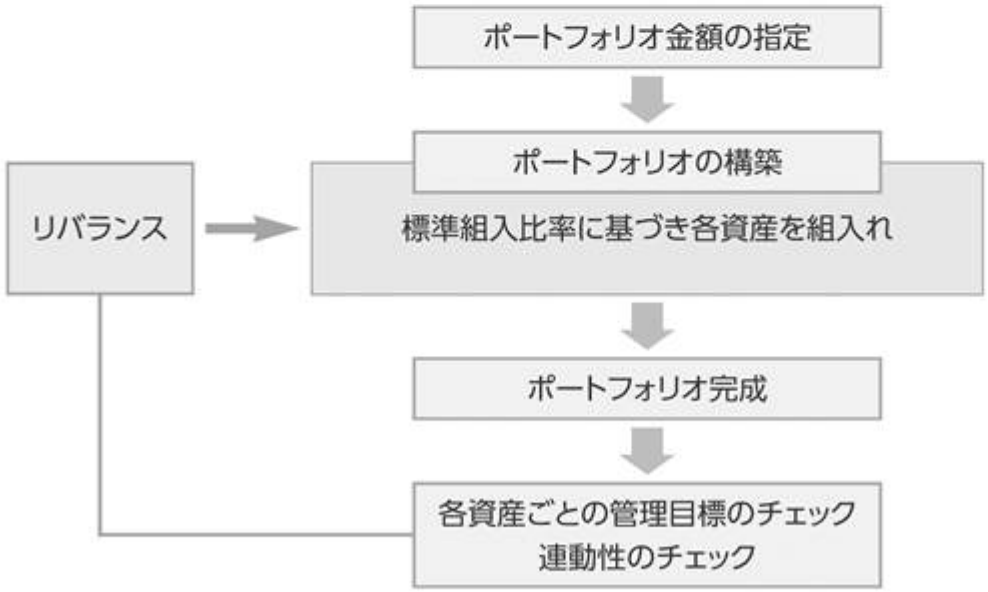
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資者のみな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。

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

〈分配方針〉
①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
②原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

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

各マザーファンドの運用プロセス

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。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．日本債券インデックスマザーファンド

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデル(注)の使用により効率的なＤＢＩ総合指数の複製を行ない同指数と連動するポートフォリオを構築します。またＤＢＩ総合指数の構成銘柄変更等に対しては、マルチファクターモデルを使用しポートフォリオのリバランスを行ないます。

（注）マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。このモデルを用いることにより、イールドカーブファクター、スプレッドファクター、スペシフィックファクターなどについてリスクの計測、分析、推定を行ないポートフォリオを効率的に構築および管理することができます。

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数とは

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスであり、下記の債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

対　象：日本で発行されている確定利付公募債券
残存額：50億円以上
期　間：残存期間1年以上
種　類：国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債

3. 外国株式インデックスマザーファンド

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】

2000年 4月28日	信託契約締結、当初設定、運用開始
2000年12月 1日	ファンドの名称の変更（従来は「ライフスタイル７５」）

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）

お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）

委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに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。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）、 わが国の公社債、外国の株式（預託証書を含みます。）、 外国の公社債　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

＜委託会社の概況（2019年11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

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

②　投資態度

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

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。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60%

日本債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%
外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の5%

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

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

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

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

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

(2) 【投資対象】

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

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

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

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

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

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

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

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

21．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

25．外国の者に対する権利で前24.の有価証券の性質を有するもの

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

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

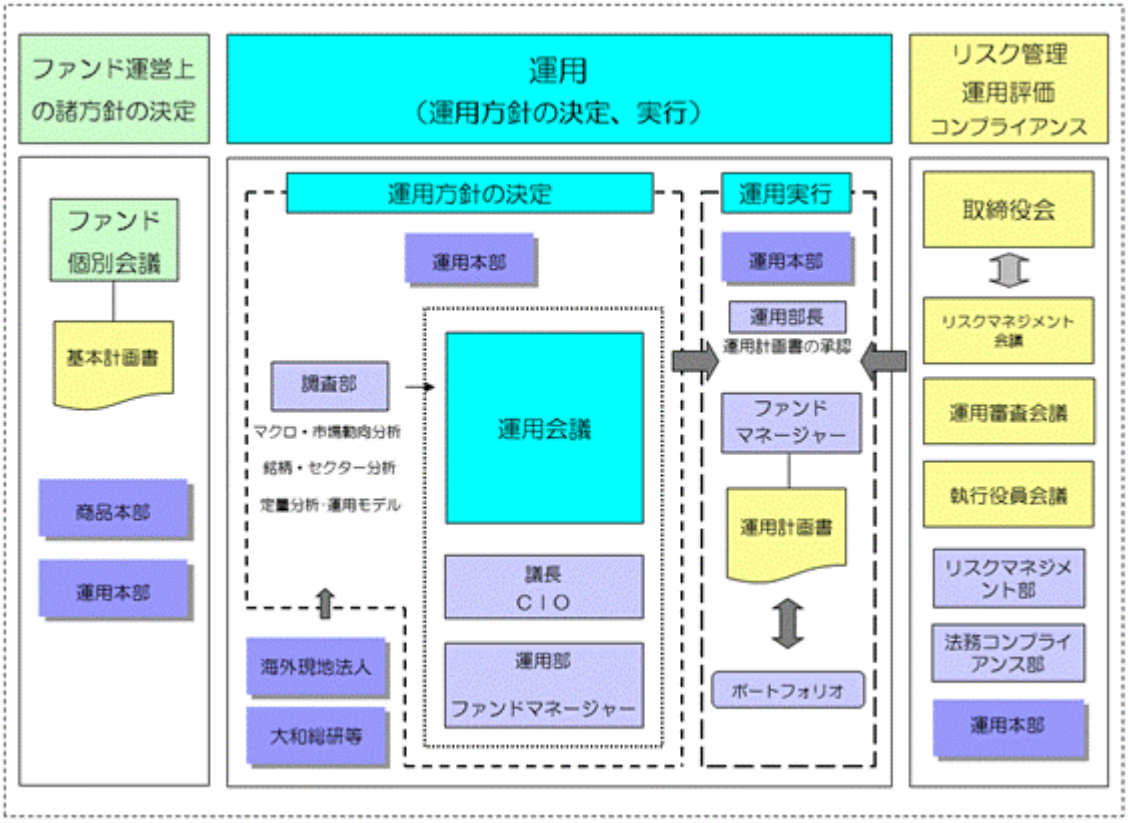
③ 前①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前② 1.から4.の金融商品により運用することの指図ができます。

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

(3) 【運用体制】

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．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

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　運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議
次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。
イ．運用審査会議
経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。
ロ．リスクマネジメント会議
経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。
ハ．執行役員会議
経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

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11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と売買益（評価益を含みます。）等とします。
②　原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
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）
株式への実質投資割合には、制限を設けません。
②　新株引受権証券等（信託約款）
イ．委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託

財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証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て取扱うものとします（以下同じ。）。

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

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

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

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

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

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

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

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)②の1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)②の1.から4.に掲げる金融商品で運用している額（以下本2.において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金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50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

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

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入金日までの間もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

ニ．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

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の指図をすることができます。

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

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

（注）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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

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

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

２．日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

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

(2) 投資対象

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。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

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

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．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は、行ないません。

（注）ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数とは

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスであり、下記の債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

対　象：日本で発行されている確定利付公募債券
残存額：50億円以上
期　間：残存期間1年以上
種　類：国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

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、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

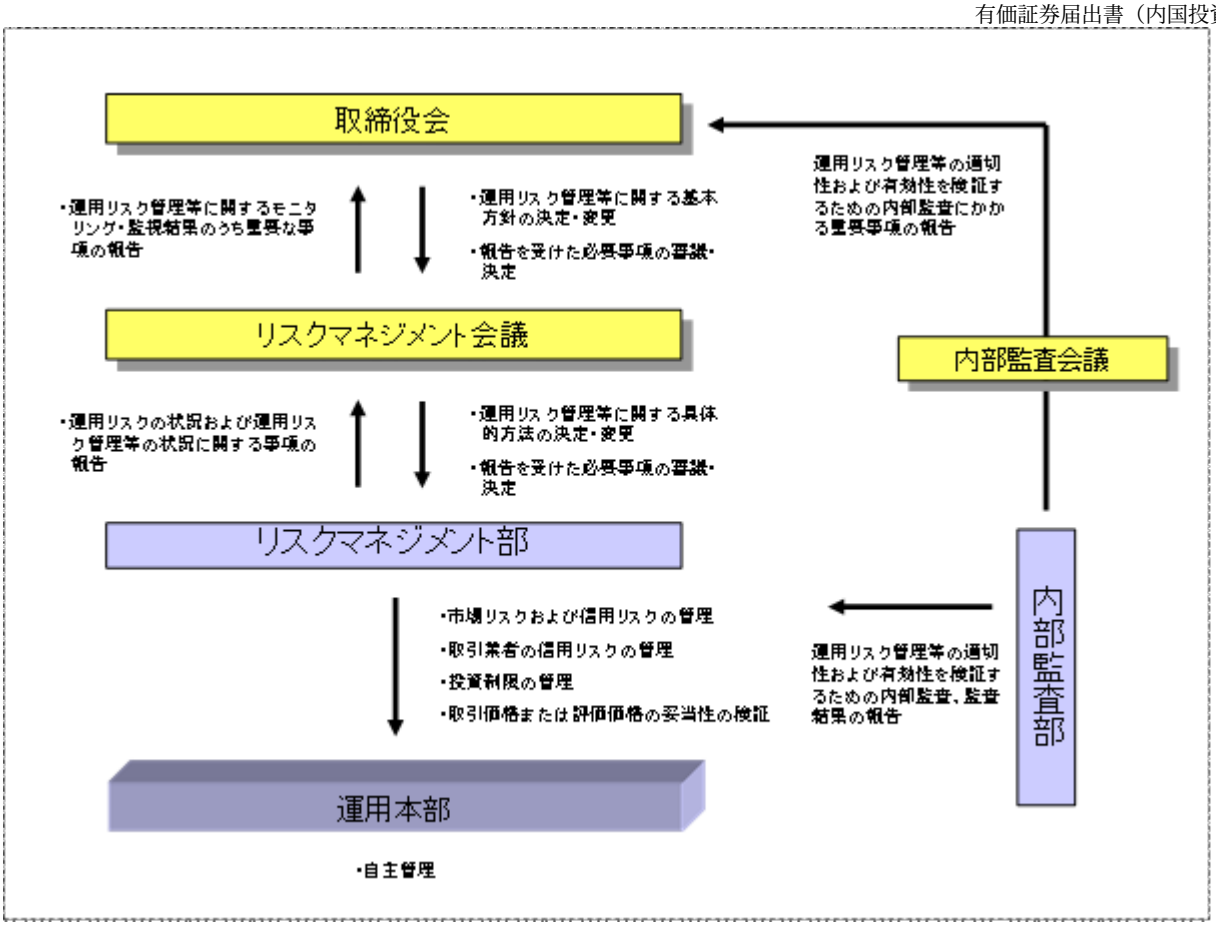
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

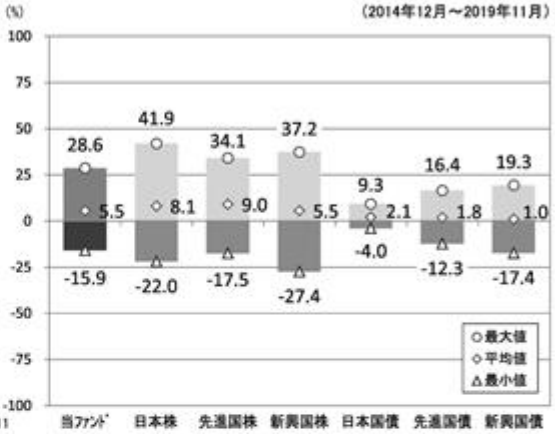
当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

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0.99%（税抜0.90%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

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0.35% （税抜）	年率0.47% （税抜）	年率0.08% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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。

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。

（※）外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

（※）上記は、2019年11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11月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		978,333,716	99.72
	内 日本	978,333,716	99.72
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,773,891	0.28
純資産総額		981,107,607	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11月29日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	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	529,430,598	1.0519 556,935,951	1.1051 585,073,753	59.63
2	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	136,490,382	1.4019 191,357,093	1.4340 195,727,207	19.95
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	53,981,894	2.4448 131,976,475	2.7482 148,353,041	15.12
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	17,095,879	2.7664 47,295,380	2.8767 49,179,715	5.01

(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	99.72%
合計	99.72%

(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10計算期間末(2009年11月30日)	275,496,805	275,496,805	0.7254	0.7254
第11計算期間末(2010年11月30日)	317,352,187	317,352,187	0.7453	0.7453
第12計算期間末(2011年11月30日)	312,447,792	312,447,792	0.6722	0.6722
第13計算期間末(2012年11月30日)	362,100,467	362,100,467	0.7401	0.7401
第14計算期間末(2013年12月2日)	537,151,204	537,151,204	1.0806	1.0806
第15計算期間末(2014年12月1日)	647,563,978	647,563,978	1.2277	1.2277
第16計算期間末(2015年11月30日)	734,908,867	734,908,867	1.3210	1.3210
第17計算期間末(2016年11月30日)	760,338,807	760,338,807	1.2701	1.2701
第18計算期間末(2017年11月30日)	937,336,300	937,336,300	1.4842	1.4842
第19計算期間末(2018年11月30日)	964,868,778	964,868,778	1.4329	1.4329
2018年12月末日	887,925,382	－	1.3235	－
2019年1月末日	938,760,046	－	1.3738	－
2月末日	953,348,103	－	1.4079	－
3月末日	947,621,016	－	1.4119	－
4月末日	962,497,496	－	1.4332	－

5月末日	920,442,773	－	1.3637	－
6月末日	940,538,551	－	1.3946	－
7月末日	950,561,295	－	1.4072	－
8月末日	917,626,136	－	1.3717	－
9月末日	950,370,936	－	1.4239	－
10月末日	989,796,555	－	1.4735	－
11月末日	981,107,607	－	1.4969	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第10計算期間	5.6
第11計算期間	2.7
第12計算期間	△9.8
第13計算期間	10.1
第14計算期間	46.0
第15計算期間	13.6
第16計算期間	7.6
第17計算期間	△3.9
第18計算期間	16.9
第19計算期間	△3.5

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第10計算期間	83,697,312	23,652,130
第11計算期間	81,429,409	35,405,267

第12計算期間	72,376,535	33,373,557
第13計算期間	68,276,957	43,805,781
第14計算期間	106,367,593	98,573,500
第15計算期間	88,503,723	58,126,096
第16計算期間	101,015,060	72,136,389
第17計算期間	85,325,672	42,999,115
第18計算期間	91,122,014	58,225,626
第19計算期間	88,023,270	46,224,810

（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11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		160,131,659,270	98.26
	内 日本	160,131,659,270	98.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,841,155,735	1.74
純資産総額		162,972,815,005	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		3,122,480,000	1.92
	内 日本	3,122,480,000	1.92

(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11月29日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	744,400	7,378.21 5,492,345,754	7,638.00 5,685,727,200	3.49

2	ソニー	日本	株式	電気機器	422,200	6,387.36 2,696,747,091	6,904.00 2,914,868,800	1.79
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,535,800	565.41 2,564,611,998	578.10 2,622,145,980	1.61
4	武田薬品	日本	株式	医薬品	555,700	3,773.00 2,096,659,472	4,455.00 2,475,643,500	1.52
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	438,100	5,278.04 2,312,312,145	5,527.00 2,421,378,700	1.49
6	キーエンス	日本	株式	電気機器	60,500	33,525.42 2,028,288,028	37,440.00 2,265,120,000	1.39
7	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	520,100	4,587.63 2,386,028,969	4,253.00 2,211,985,300	1.36
8	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	455,600	3,791.00 1,727,180,051	3,989.00 1,817,388,400	1.12
9	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	457,200	3,436.49 1,571,163,261	3,962.00 1,811,426,400	1.11
10	任天堂	日本	株式	その他製品	41,000	42,016.42 1,722,673,263	42,350.00 1,736,350,000	1.07
11	本田技研	日本	株式	輸送用機器	525,900	2,891.70 1,520,745,672	3,067.00 1,612,935,300	0.99
12	KDDI	日本	株式	情報・通信業	488,500	2,877.18 1,405,502,885	3,139.00 1,533,401,500	0.94
13	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,953,100	168.50 1,508,645,444	169.20 1,514,864,520	0.93
14	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	484,100	2,817.30 1,363,858,195	3,003.00 1,453,752,300	0.89
15	東京海上HD	日本	株式	保険業	235,600	5,893.97 1,388,621,383	5,952.00 1,402,291,200	0.86
16	日立	日本	株式	電気機器	320,900	4,085.15 1,310,926,693	4,300.00 1,379,870,000	0.85
17	花王	日本	株式	化学	159,900	7,979.32 1,275,894,026	8,612.00 1,377,058,800	0.84
18	信越化学	日本	株式	化学	115,000	11,839.09 1,361,495,754	11,710.00 1,346,650,000	0.83
19	HOYA	日本	株式	精密機器	134,400	8,892.81 1,195,194,299	9,990.00 1,342,656,000	0.82
20	ダイキン工業	日本	株式	機械	85,100	14,512.14 1,234,983,908	15,745.00 1,339,899,500	0.82
21	ファナック	日本	株式	電気機器	63,500	20,500.80 1,301,801,302	20,905.00 1,327,467,500	0.81

22	三菱商事	日本	株式	卸売業	461,500	2,781.65 1,283,734,572	2,866.00 1,322,659,000	0.81
23	第一三共	日本	株式	医薬品	191,100	7,110.44 1,358,806,452	6,862.00 1,311,328,200	0.80
24	日本電産	日本	株式	電気機器	80,300	15,360.72 1,233,465,899	16,190.00 1,300,057,000	0.80
25	村田製作所	日本	株式	電気機器	196,200	5,099.78 1,000,578,075	6,344.00 1,244,692,800	0.76
26	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	55,500	22,500.94 1,248,802,703	22,095.00 1,226,272,500	0.75
27	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	117,500	10,512.51 1,235,220,261	10,070.00 1,183,225,000	0.73
28	三井物産	日本	株式	卸売業	578,000	1,839.48 1,063,224,334	1,939.50 1,121,031,000	0.69
29	伊藤忠	日本	株式	卸売業	460,000	2,302.26 1,059,042,957	2,388.00 1,098,480,000	0.67
30	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	587,300	1,541.37 905,251,915	1,867.50 1,096,782,750	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	98.26%
合計	98.26%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%
鉱業	0.27%
建設業	2.73%
食料品	3.84%
繊維製品	0.58%
パルプ・紙	0.24%
化学	7.04%
医薬品	5.92%
石油・石炭製品	0.49%
ゴム製品	0.75%
ガラス・土石製品	0.83%

鉄鋼	0.76%
非鉄金属	0.75%
金属製品	0.57%
機械	5.03%
電気機器	13.97%
輸送用機器	7.69%
精密機器	2.31%
その他製品	2.29%
電気・ガス業	1.52%
陸運業	4.48%
海運業	0.17%
空運業	0.51%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	8.40%
卸売業	4.87%
小売業	4.59%
銀行業	5.76%
証券、商品先物取引業	0.82%
保険業	2.25%
その他金融業	1.15%
不動産業	2.34%
サービス業	5.05%
合計	98.26%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該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12月	買建	184	3,036,163,990	3,122,480,000	1.92%

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

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2019年11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		71,750,880,410	86.77
	内 日本	71,750,880,410	86.77
地方債証券		4,262,895,800	5.15
	内 日本	4,262,895,800	5.15
特殊債券		3,025,670,900	3.66
	内 日本	3,025,670,900	3.66
社債券		2,904,403,200	3.51
	内 日本	2,904,403,200	3.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		751,121,441	0.91
純資産総額		82,694,971,751	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11月29日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	127 5年国債	日本	国債証券	1,580,000,000	100.55 1,588,818,600	100.35 1,585,530,000	0.100000 2021/03/20	1.92
2	129 5年国債	日本	国債証券	1,340,000,000	100.68 1,349,192,600	100.51 1,346,887,600	0.100000 2021/09/20	1.63
3	131 5年国債	日本	国債証券	1,170,000,000	100.83 1,179,756,000	100.66 1,177,815,600	0.100000 2022/03/20	1.42
4	349 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	101.31 1,063,796,000	102.28 1,074,003,000	0.100000 2027/12/20	1.30
5	342 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	101.41 1,014,120,100	101.91 1,019,120,000	0.100000 2026/03/20	1.23
6	128 5年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	100.60 1,006,000,000	100.43 1,004,340,000	0.100000 2021/06/20	1.21

7	334 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	103.91 935,216,000	103.60 932,400,000	0.600000 2024/06/20	1.13
8	135 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.94 888,342,200	101.01 888,905,600	0.100000 2023/03/20	1.07
9	132 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.89 887,849,800	100.75 886,644,000	0.100000 2022/06/20	1.07
10	351 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	101.19 809,558,000	102.20 817,664,000	0.100000 2028/06/20	0.99
11	126 5年国債	日本	国債証券	790,000,000	100.50 793,960,800	100.27 792,156,700	0.100000 2020/12/20	0.96
12	340 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	103.60 725,233,500	103.52 724,640,000	0.400000 2025/09/20	0.88
13	346 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.87 706,096,400	102.22 715,547,000	0.100000 2027/03/20	0.87
14	344 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.07 707,493,800	102.03 714,224,000	0.100000 2026/09/20	0.86
15	343 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.81 712,739,200	101.99 713,930,000	0.100000 2026/06/20	0.86
16	335 10年国債	日本	国債証券	690,000,000	103.93 717,140,600	103.34 713,059,800	0.500000 2024/09/20	0.86
17	312 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	102.73 719,173,000	101.42 709,968,000	1.200000 2020/12/20	0.86
18	139 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.44 710,096,000	101.25 708,792,000	0.100000 2024/03/20	0.86
19	137 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.31 709,189,900	101.11 707,770,000	0.100000 2023/09/20	0.86
20	136 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.98 706,874,000	101.09 707,630,000	0.100000 2023/06/20	0.86
21	352 10年国債	日本	国債証券	690,000,000	100.67 694,629,300	102.13 704,752,200	0.100000 2028/09/20	0.85
22	345 10年国債	日本	国債証券	650,000,000	102.76 667,943,100	102.14 663,942,500	0.100000 2026/12/20	0.80
23	330 10年国債	日本	国債証券	612,000,000	104.38 638,854,560	103.78 635,188,680	0.800000 2023/09/20	0.77
24	333 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	103.75 622,540,600	103.42 620,526,000	0.600000 2024/03/20	0.75
25	348 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	100.70 604,212,000	102.29 613,776,000	0.100000 2027/09/20	0.74
26	354 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	102.08 612,510,600	102.02 612,120,000	0.100000 2029/03/20	0.74

27	339 10年国債	日本	国債証券	590,000,000	103.99 613,546,300	103.36 609,859,400	0.400000 2025/06/20	0.74
28	140 5年国債	日本	国債証券	600,000,000	102.11 612,660,000	101.30 607,842,000	0.100000 2024/06/20	0.74
29	138 5年国債	日本	国債証券	600,000,000	101.87 611,220,000	101.18 607,098,000	0.100000 2023/12/20	0.73
30	338 10年国債	日本	国債証券	580,000,000	103.22 598,700,800	103.21 598,623,800	0.400000 2025/03/20	0.72

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	86.77%
地方債証券	5.15%
特殊債券	3.66%
社債券	3.51%
合計	99.09%

(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11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		121,701,487,459	90.57
	内 香港	1,541,514,775	1.15
	内 シンガポール	514,629,936	0.38
	内 イスラエル	266,517,166	0.20

	内 ノルウェー	278,948,532	0.21
	内 スウェーデン	1,194,753,426	0.89
	内 デンマーク	829,109,193	0.62
	内 イギリス	7,358,162,724	5.48
	内 アイルランド	265,130,332	0.20
	内 オランダ	1,799,186,710	1.34
	内 ベルギー	449,882,413	0.33
	内 フランス	5,057,340,585	3.76
	内 ドイツ	3,992,808,566	2.97
	内 スイス	4,249,223,624	3.16
	内 ポルトガル	68,588,879	0.05
	内 スペイン	1,273,493,426	0.95
	内 イタリア	1,072,297,754	0.80
	内 フィンランド	421,342,033	0.31
	内 オーストリア	100,807,149	0.08
	内 カナダ	4,639,315,723	3.45
	内 アメリカ	83,437,408,015	62.09
	内 オーストラリア	2,765,796,826	2.06
	内 ニュージーランド	125,229,672	0.09
投資証券		3,654,694,322	2.72
	内 香港	96,378,800	0.07
	内 シンガポール	68,221,735	0.05
	内 イギリス	92,467,690	0.07
	内 フランス	144,328,985	0.11
	内 カナダ	33,712,982	0.03
	内 アメリカ	2,825,911,712	2.10
	内 オーストラリア	393,672,418	0.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,015,839,013	6.71
純資産総額		134,372,020,794	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）		8,935,620,444	6.65
	内 イギリス	482,471,805	0.36
	内 ドイツ	1,256,008,894	0.93
	内 カナダ	337,451,360	0.25
	内 アメリカ	6,668,629,605	4.96
	内 オーストラリア	191,058,780	0.14

為替予約取引(買建)		6,319,793,500	4.70
	内 日本	6,319,793,500	4.70

(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11月29日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	129,800	19,786.64 2,568,320,672	29,344.55 3,808,922,642	2.83
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	205,650	12,294.38 2,528,350,588	16,688.17 3,431,924,052	2.55
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	11,770	185,496.36 2,183,292,748	199,235.95 2,345,007,197	1.75
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	67,650	15,693.59 1,061,671,886	22,131.12 1,497,170,268	1.11
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	91,070	12,054.88 1,097,847,119	14,468.49 1,317,645,712	0.98
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	8,747	119,682.35 1,046,862,210	143,851.18 1,258,266,310	0.94
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	8,400	120,405.89 1,011,409,686	143,756.96 1,207,558,488	0.90
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	74,800	15,834.26 1,184,409,511	15,091.89 1,128,873,372	0.84

9	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	86,900	9,495.10 825,129,418	11,439.62 994,103,326	0.74
10	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	48,950	15,497.70 758,613,824	20,199.57 988,769,304	0.74
11	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	70,767	10,369.19 733,799,578	13,340.02 944,033,592	0.70
12	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	255,401	3,080.27 786,729,041	3,661.49 935,149,536	0.70
13	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	119,655	8,596.84 1,028,658,270	7,526.77 900,615,904	0.67
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	36,350	23,718.09 862,155,961	24,157.98 878,142,573	0.65
15	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	206,591	3,367.32 695,680,882	4,126.02 852,400,581	0.63
16	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	50,912	12,759.68 649,622,775	16,596.14 844,943,128	0.63
17	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	26,776	30,718.21 822,513,384	30,750.20 823,367,494	0.61
18	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	25,500	22,033.28 561,850,035	31,958.65 814,945,626	0.61
19	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	126,650	5,243.32 664,068,824	6,410.35 811,871,537	0.60
20	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	116,904	6,473.90 756,835,090	6,584.55 769,760,935	0.57
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	31,000	19,486.01 604,067,398	24,431.88 757,388,280	0.56
22	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	120,922	5,873.51 710,249,606	5,953.49 719,907,966	0.54
23	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	72,721	8,561.89 622,632,582	9,598.55 698,016,271	0.52
24	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	53,818	13,041.36 701,860,878	12,935.74 696,176,150	0.52

25	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	19,940	28,032.01 558,960,231	33,891.12 675,788,933	0.50
26	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	114,150	5,391.77 615,478,849	5,910.76 674,713,482	0.50
27	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	157,113	4,955.28 778,556,207	4,232.30 664,949,790	0.49
28	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	128,190	4,342.41 556,654,573	4,866.65 623,856,530	0.46
29	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	61,050	8,786.46 536,417,690	10,127.85 618,305,316	0.46
30	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・サービス	14,990	37,713.18 565,320,972	40,318.08 604,368,019	0.45

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	90.57%
投資証券	2.72%
合計	93.29%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	4.83%
素材	4.03%
資本財・サービス	9.59%
一般消費財・サービス	8.93%
生活必需品	7.82%
ヘルスケア	12.29%
金融	15.08%
情報技術	16.44%
コミュニケーション・サービス	7.83%
公益事業	3.28%
不動産	0.47%
合計	90.57%

(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12月	買建	386	6,345,069,837	6,668,629,605	4.96%
	イギリス	FT 100 2019年12月	買建	46	468,406,936	482,471,805	0.36%
	オーストラリア	SPI 200 INDEX 2019年12月	買建	15	184,765,591	191,058,780	0.14%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX 2019年12月	買建	20	322,855,237	337,451,360	0.25%
	ドイツ	SMI 2019年12月	買建	23	253,814,957	265,482,634	0.20%
		EURO STOXX 50 2019年12月	買建	222	961,104,350	990,526,260	0.74%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2019年12月	買建	5,600,000	674,644,200	675,248,000	0.50%
		英ポンド買/円売 2019年12月	買建	1,700,000	237,693,660	240,397,000	0.18%
		スイス・フラン買/円売 2019年12月	買建	2,100,000	230,087,350	230,328,000	0.17%
		豪ドル買/円売 2019年12月	買建	1,300,000	97,567,600	96,343,000	0.07%
		米ドル買/円売 2019年12月	買建	44,300,000	4,777,789,870	4,850,850,000	3.61%
		カナダ・ドル買/円売 2019年12月	買建	2,750,000	225,136,565	226,627,500	0.17%

(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11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		186,743,128,131	98.20
	内 ユーロ	69,328,747,942	36.46
	内 シンガポール	737,052,545	0.39
	内 マレーシア	867,577,418	0.46
	内 ノルウェー	403,600,330	0.21
	内 スウェーデン	619,892,115	0.33
	内 デンマーク	935,872,881	0.49
	内 イギリス	11,914,767,448	6.27
	内 ポーランド	1,043,515,463	0.55
	内 カナダ	3,528,272,325	1.86
	内 アメリカ	91,049,557,374	47.88
	内 メキシコ	1,525,108,911	0.80
	内 南アフリカ	1,021,963,344	0.54
	内 オーストラリア	3,767,200,035	1.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,423,690,879	1.80
純資産総額		190,166,819,010	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）		1,691,579,750	0.89
	内 日本	1,691,579,750	0.89

(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11月29日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)

1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,300,000	103.74 829,771,125	111.30 890,196,035	3.125000 2028/11/15	0.47
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,907,000	99.98 866,157,862	100.76 872,952,697	2.250000 2021/04/30	0.46
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,550,000	98.93 818,377,538	102.03 844,044,159	2.125000 2024/03/31	0.44
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	100.98 741,279,194	109.05 800,513,068	2.875000 2028/08/15	0.42
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	103.10 779,462,565	105.23 795,531,155	2.375000 2029/05/15	0.42
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	100.58 727,330,822	107.30 775,910,931	2.625000 2029/02/15	0.41
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	99.39 707,819,912	108.88 775,392,274	2.875000 2028/05/15	0.41
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,029,000	91.63 705,676,788	99.52 766,423,876	1.625000 2026/05/15	0.40
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	100.02 756,171,718	98.64 745,682,889	1.625000 2029/08/15	0.39
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	97.75 674,746,185	107.72 743,555,015	2.750000 2028/02/15	0.39
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.44 672,593,770	101.91 725,770,359	2.000000 2026/11/15	0.38
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	98.11 662,399,659	103.33 697,623,595	2.375000 2024/08/15	0.37
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	96.78 666,631,128	101.11 696,497,657	2.000000 2022/11/30	0.37
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,084,000	159.73 594,035,167	182.54 678,865,456	4.500000 2041/04/25	0.36
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	94.14 608,576,437	103.82 671,096,632	2.250000 2027/08/15	0.35
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	96.38 625,234,621	102.87 667,355,021	2.250000 2024/11/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	95.58 611,581,887	103.15 660,023,447	2.250000 2025/11/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,800,000	107.44 565,026,273	125.39 659,453,034	3.375000 2048/11/15	0.35
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	95.35 595,459,366	104.63 653,418,469	2.375000 2027/05/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	95.23 603,910,487	102.40 649,390,526	2.125000 2025/05/15	0.34

21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,800,000	99.16 630,161,048	101.61 645,723,194	2.000000 2024/05/31	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.26 593,118,283	101.77 640,358,850	2.000000 2025/08/15	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.71 595,968,573	101.73 640,113,461	2.000000 2025/02/15	0.34
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	93.94 566,093,781	103.82 625,646,762	2.250000 2027/11/15	0.33
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,087,000	118.72 585,131,919	126.71 624,536,276	2.500000 2030/05/25	0.33
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,420,000	107.50 572,985,375	116.88 623,006,167	1.500000 2031/05/25	0.33
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,850,000	109.23 580,450,001	114.74 609,699,975	2.875000 2049/05/15	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,340,000	94.56 553,235,359	103.64 606,346,234	2.250000 2027/02/15	0.32
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	99.33 569,079,526	104.52 598,801,020	2.750000 2024/02/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,600,000	100.86 508,311,782	117.35 591,461,193	3.000000 2049/02/15	0.31

(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	98.20%
合計	98.20%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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 2020年1月	買建	90,000	6,661,404	6,659,100	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2020年1月	買建	281,000	23,091,495	23,106,630	0.01%
		デンマーク・クローネ買/円売 2019年12月	買建	2,774,000	45,109,678	44,772,360	0.02%
		ユーロ買/円売 2020年1月	買建	6,414,000	772,990,906	773,335,980	0.41%
		英ポンド買/円売 2020年1月	買建	305,000	43,044,284	43,078,200	0.02%
		メキシコ・ペソ買/円売 2020年1月	買建	7,582,000	42,179,712	42,155,920	0.02%
		南アフリカ・ランド買/円売 2020年1月	買建	5,300,000	39,084,532	39,008,000	0.02%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2020年1月	買建	2,816,000	33,540,812	33,538,560	0.02%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2020年1月	買建	987,000	27,444,600	27,448,470	0.01%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2020年1月	買建	1,735,000	19,875,892	19,865,750	0.01%
		シンガポール・ドル買/円売 2020年1月	買建	490,000	39,155,018	39,195,100	0.02%
		米ドル買/円売 2020年1月	買建	5,344,000	583,200,285	583,671,680	0.31%
		マレーシア・リンギット買/円売 2019年12月	買建	600,000	15,757,800	15,744,000	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワライフスタイル75

2019年11月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	14,969円
純資産総額	9.8億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.6%
3カ月間	9.1%
6カ月間	9.8%
1年間	4.5%
3年間	17.9%
5年間	22.6%
設定来	49.7%

※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 8 期 07年11月	第 9 期 08年12月	第 10 期 09年11月	第 11 期 10年11月	第 12 期 11年11月	第 13 期 12年11月	第 14 期 13年12月	第 15 期 14年12月	第 16 期 15年11月	第 17 期 16年11月	第 18 期 17年11月	第 19 期 18年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

※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
国内株式・先物	2,131	59.7%
国内債券	348	19.8%
外国株式・先物	1,258	14.7%
外国債券	770	4.9%
外国リート	67	0.4%
外国投資証券	6	0.0%
コール・ローン、その他		2.6%
合計	4,580	-

通貨別構成	比率
日本円	79.9%
米ドル	12.9%
ユーロ	3.6%
英ポンド	1.2%
カナダ・ドル	0.7%
スイス・フラン	0.5%
豪ドル	0.5%
香港ドル	0.2%
スウェーデン・クローネ	0.2%
その他	0.4%
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

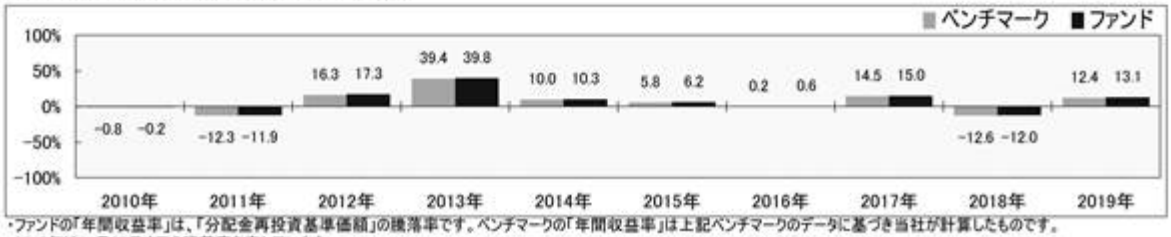
債券格付別構成	比率
AAA	88.2%
AA	5.1%
A	4.4%
BBB	0.2%
BB以下・無格付	2.1%
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
トヨタ自動車	日本	2.1%
TOPIX先物 0112月	日本	1.1%
ソニー	日本	1.1%
三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.0%
武田薬品	日本	0.9%
日本電信電話	日本	0.9%
キーエンス	日本	0.8%
ソフトバンクグループ	日本	0.8%
S&P500 EMINI FUT 201912	アメリカ	0.8%
三井住友フィナンシャルG	日本	0.7%
合計		10.1%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.1%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンド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11月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２ 【管理及び運営】

１ 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

２ 【換金(解約)手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

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

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

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

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

3　【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

・外国の株式：海外取引所に上場されている株式は原則として海外取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場、海外の店頭市場に登録されている株式は原則として当該海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。

・公社債等：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問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12月1日から翌年11月30日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

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

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

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

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知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

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知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

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20期計算期間（2018年12月1日から2019年12月2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】

ダイワライフスタイル７５

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 2018年11月30日現在	第20期 2019年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,117,476	－
コール・ローン	6,062,767	8,770,590
親投資信託受益証券	962,096,913	984,266,121
未収入金	－	5,371,000
流動資産合計	971,277,156	998,407,711
資産合計	971,277,156	998,407,711
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,642,298	6,666,522
未払受託者報酬	420,125	417,795
未払委託者報酬	4,306,592	4,282,825
その他未払費用	39,363	39,548
流動負債合計	6,408,378	11,406,690
負債合計	6,408,378	11,406,690
純資産の部		
元本等		
元本	※1 673,349,184	※1 656,492,017
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	291,519,594	330,509,004
（分配準備積立金）	254,508,184	240,543,622
元本等合計	964,868,778	987,001,021
純資産合計	964,868,778	987,001,021
負債純資産合計	971,277,156	998,407,711

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期 自　2017年12月1日 至　2018年11月30日	第20期 自　2018年12月1日 至　2019年12月2日
営業収益		
受取利息	―	7
有価証券売買等損益	△ 24,427,713	56,872,208
営業収益合計	△ 24,427,713	56,872,215
営業費用		
支払利息	3,295	2,945
受託者報酬	830,997	821,538
委託者報酬	8,518,509	8,421,648
その他費用	78,105	77,459
営業費用合計	9,430,906	9,323,590
営業利益又は営業損失（△）	△ 33,858,619	47,548,625
経常利益又は経常損失（△）	△ 33,858,619	47,548,625
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 33,858,619	47,548,625
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 400,971	△ 927,344
期首剰余金又は期首欠損金（△）	305,785,576	291,519,594
剰余金増加額又は欠損金減少額	41,569,482	30,990,368
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	41,569,482	30,990,368
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,377,816	40,476,927
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	22,377,816	40,476,927
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	291,519,594	330,509,004

(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20期 自　2018年12月1日 至　2019年12月2日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は367日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第19期 2018年11月30日現在	第20期 2019年12月2日現在
1．※1　期首元本額	631,550,724円	673,349,184円
期中追加設定元本額	88,023,270円	77,348,317円
期中一部解約元本額	46,224,810円	94,205,484円
2．計算期間末日における受益権の総数	673,349,184口	656,492,017口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第19期 自　2017年12月1日 至　2018年11月30日	第20期 自　2018年12月1日 至　2019年12月2日

※1　分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（299,354,117円）及び分配準備積立金（254,508,184円）より分配対象額は553,862,301円（1万口当たり8,225.48円）であり、分配を行っておりません。	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（19,406,033円）、投資信託約款に規定される収益調整金（318,858,773円）及び分配準備積立金（221,137,589円）より分配対象額は559,402,395円（1万口当たり8,521.08円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第20期 自　2018年12月1日 至　2019年12月2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20期 2019年12月2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19期 2018年11月30日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第20期 2019年12月2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	△25,285,338	55,136,222
合計	△25,285,338	55,136,222

（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19期 2018年11月30日現在	第20期 2019年12月2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20期 自　2018年12月1日 至　2019年12月2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19期 2018年11月30日現在	第20期 2019年12月2日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4329円 (14,329円)	1.5034円 (15,034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	530,142,751	591,109,167	
	日本債券インデックスマザーファンド	136,814,650	195,685,993	
	外国株式インデックスマザーファンド	54,062,311	148,130,732	
	外国債券インデックスマザーファンド	17,127,861	49,340,229	
親投資信託受益証券　合計			984,266,121	
合計			984,266,121	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		

流動資産			
金銭信託		5,748,360,758	―
コール・ローン		11,179,224,344	15,866,424,459
株式	※2※3	140,729,270,900	162,602,439,840
派生商品評価勘定		26,461,940	76,885,750
未収入金		76,903,429	44,835,510
未収配当金		875,753,046	717,704,956
未収利息		1,251,373	1,374,718
前払金		21,520,000	―
その他未収収益	※4	30,930,674	32,184,457
差入委託証拠金		―	39,360,000
流動資産合計		158,689,676,464	179,381,209,690
資産合計		158,689,676,464	179,381,209,690
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		7,672,420	―
前受金		―	86,417,200
未払金		1,030,901,154	1,370,527,390
未払解約金		23,803,900	123,739,000
受入担保金		15,009,839,092	13,103,577,689
その他未払費用		174,575	10,575
流動負債合計		16,072,391,141	14,684,271,854
負債合計		16,072,391,141	14,684,271,854
純資産の部			
元本等			
元本	※1	134,890,694,102	147,704,616,967
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		7,726,591,221	16,992,320,869
元本等合計		142,617,285,323	164,696,937,836
純資産合計		142,617,285,323	164,696,937,836
負債純資産合計		158,689,676,464	179,381,209,690

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2018年12月1日 至　2019年12月2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11月30日現在	2019年12月2日現在
1．※1　期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	128,627,233,302円	134,890,694,102円
期中追加設定元本額	18,705,077,077円	33,001,020,844円
期中一部解約元本額	12,441,616,277円	20,187,097,979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	4,208,196,163円	3,765,431,907円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	8,873,990,627円	7,517,011,572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	50,893,960円	5,764,295円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	65,059,832円	59,609,321円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,060,778,978円	777,014,581円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	59,055,392円	46,976,403円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,449,339,094円	1,145,153,691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）	4,513,952円	46,927,453円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	39,579,272円	50,758,188円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	19,750,054円	16,362,055円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	687,039円	7,650,621円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	766,287,386円	1,290,732,581円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,279,701,333円	1,996,082,570円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	18,821,903円	64,246,554円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	65,506,653,858円	65,235,675,867円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,604,113,138円	2,856,480,263円
ダイワ・ライフ・バランス５０	2,907,019,868円	3,215,288,075円
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,813,203,474円	2,971,577,942円
年金ダイワ日本株式インデックス	4,626,136,087円	4,856,558,312円

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	15,110,700円	13,563,401円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	52,614,491円	55,375,861円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	16,862,669円	24,888,377円
ダイワつみたてインデックス日本株式	9,822,989円	266,294,654円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	431,467円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	315,899円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	－円	2,320,710円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	350,718円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	359,201円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	712,052円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	4,149,572円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	4,912,940円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	9,756,807円	－円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	184,587,297円	150,205,619円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	162,072,230円	158,266,050円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	9,658,927,568円	8,647,121,514円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	11,433,435円	－円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	14,487,998円	－円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	823,275,779円	730,190,060円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	129,734,372円	124,454,938円

	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	221,128,598円	216,391,069円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	140,301,263円	152,878,769円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	8,504,620,250円	10,075,963,979円
	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	292,440,998円	13,126,419,796円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	1,905,520,921円	2,555,624,273円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,400,114,800円	1,351,353,152円
	ダイワライフスタイル２５	181,369,214円	182,799,162円
	ダイワライフスタイル５０	649,148,174円	662,351,711円
	ダイワライフスタイル７５	544,757,466円	530,142,751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）	13,598,340,190円	12,751,961,504円
計		134,890,694,102円	147,704,616,967円
2.	期末日における受益権の総数	134,890,694,102口	147,704,616,967口
3. ※2	貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 14,441,000,290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 12,524,034,910円
4. ※3	差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 680,300,000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 565,900,000円
5. ※4	その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分28,279,195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29,453,875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12月1日 至　2019年12月2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12月2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11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年12月2日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△9,360,479,994	8,993,918,872
合計	△9,360,479,994	8,993,918,872

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2018年9月20日から2018年11月30日まで、及び2019年9月20日から2019年12月2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11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買　建	1,849,310,000	－	1,868,160,000	18,850,000	2,308,972,800	－	2,385,935,000	76,962,200
合計	1,849,310,000	－	1,868,160,000	18,850,000	2,308,972,800	－	2,385,935,000	76,962,200

（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11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.0573円	1.1150円
（1万口当たり純資産額）	(10,573円)	(11,150円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備考	
		単 価	金 額		
極 洋	3,300	2,905.00	9,586,500	貸付株式数	100株
日本水産	91,300	666.00	60,805,800		
マルハニチロ	13,200	2,938.00	38,781,600		
ホウスイ	600	870.00	522,000	貸付株式数	200株
カネコ種苗	2,800	1,522.00	4,261,600		
サカタのタネ	10,900	3,535.00	38,531,500		
ホクト	7,000	2,001.00	14,007,000	貸付株式数	2,400株
ホクリヨウ	1,400	680.00	952,000		
ヒノキヤグループ	2,300	2,233.00	5,135,900	貸付株式数	800株 (200株)
ショーボンドＨＤ	13,000	4,260.00	55,380,000	貸付株式数	100株
ミライト・ホールディングス	27,200	1,638.00	44,553,600	貸付株式数	10,600株
タマホーム	4,400	1,842.00	8,104,800	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	900	679.00	611,100		
日本アクア	3,600	657.00	2,365,200	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
ファーストコーポレーション	2,800	673.00	1,884,400	貸付株式数	1,000株
ベステラ	1,600	1,258.00	2,012,800		
スペースバリューＨＤ	11,100	515.00	5,716,500		
住石ホールディングス	18,400	150.00	2,760,000	貸付株式数	7,100株
日鉄鉱業	2,100	4,570.00	9,597,000		
三井松島ＨＬＤＧＳ	3,500	1,203.00	4,210,500		
国際石油開発帝石	366,200	1,061.50	388,721,300		
石油資源開発	11,900	2,839.00	33,784,100		
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,400	1,577.00	6,938,800		
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,000.00	1,700,000		
第一カッター興業	1,100	1,827.00	2,009,700		
安藤・間	54,400	905.00	49,232,000		
東急建設	26,800	784.00	21,011,200		
コムシスホールディングス	32,400	3,190.00	103,356,000		

ミサワホーム	6,300	1,198.00	7,547,400		
ビーアールホールディングス	10,000	484.00	4,840,000		
高松コンストラクションＧＰ	5,700	2,733.00	15,578,100		
東建コーポレーション	2,800	7,300.00	20,440,000		
ソネック	900	807.00	726,300	貸付株式数	100株
ヤマウラ	3,900	879.00	3,428,100		
大成建設	70,300	4,345.00	305,453,500		
大　林　組	210,700	1,180.00	248,626,000		
清水建設	213,900	1,065.00	227,803,500		
飛島建設	6,100	1,470.00	8,967,000		
長谷工コーポレーシヨン	81,600	1,428.00	116,524,800		
松井建設	8,300	782.00	6,490,600		
錢　高　組	900	4,005.00	3,604,500	貸付株式数	100株
鹿島建設	165,500	1,460.00	241,630,000		
不動テトラ	5,500	1,543.00	8,486,500		
大末建設	2,500	964.00	2,410,000		
鉄建建設	4,600	2,846.00	13,091,600	貸付株式数	1,600株
西松建設	16,300	2,434.00	39,674,200		
三井住友建設	51,200	610.00	31,232,000	貸付株式数	2,100株
大豊建設	4,800	2,999.00	14,395,200		
前田建設	52,900	994.00	52,582,600	貸付株式数	20,600株
佐田建設	4,600	411.00	1,890,600	貸付株式数	1,600株
ナカノフドー建設	5,800	476.00	2,760,800	貸付株式数	1,200株
奥　村　組	11,400	3,095.00	35,283,000	貸付株式数	100株
東鉄工業	9,000	3,275.00	29,475,000		
イチケン	1,500	1,788.00	2,682,000		
富士ピー・エス	3,100	580.00	1,798,000		
淺沼組	2,400	4,375.00	10,500,000		
戸田建設	87,600	682.00	59,743,200	貸付株式数	33,200株
熊　谷　組	9,800	3,275.00	32,095,000	貸付株式数	2,500株
北野建設	1,300	2,606.00	3,387,800	貸付株式数	100株
植　木　組	900	2,545.00	2,290,500		
矢作建設	9,300	764.00	7,105,200		
ピーエス三菱	6,900	699.00	4,823,100	貸付株式数	3,000株
日本ハウスＨＬＤＧＳ	14,400	482.00	6,940,800		
大東建託	25,300	13,355.00	337,881,500	貸付株式数	10,300株
新日本建設	9,000	928.00	8,352,000	貸付株式数	200株
ＮＩＰＰＯ	17,500	2,256.00	39,480,000		

東亜道路	1,300	3,455.00	4,491,500	貸付株式数	300株
前田道路	22,300	2,602.00	58,024,600		
日本道路	2,000	7,010.00	14,020,000		
東亜建設	6,600	1,577.00	10,408,200	貸付株式数	2,500株
日本国土開発	12,300	626.00	7,699,800	貸付株式数	4,800株
若築建設	3,800	1,701.00	6,463,800		
東洋建設	23,700	504.00	11,944,800		
五洋建設	83,600	637.00	53,253,200	貸付株式数	32,600株
世紀東急	10,100	884.00	8,928,400		
福　田　組	2,400	4,825.00	11,580,000	貸付株式数	600株
日本ドライケミカル	1,600	1,462.00	2,339,200	貸付株式数	200株
住友林業	53,500	1,594.00	85,279,000		
日本基礎技術	7,000	403.00	2,821,000		
巴コーポレーション	9,300	399.00	3,710,700	貸付株式数	100株
大和ハウス	208,600	3,395.00	708,197,000		
ライト工業	12,100	1,587.00	19,202,700		
積水ハウス	230,500	2,394.50	551,932,250		
日特建設	5,500	788.00	4,334,000	貸付株式数	2,400株
北陸電気工事	3,700	1,048.00	3,877,600	貸付株式数	500株
ユアテック	12,100	677.00	8,191,700	貸付株式数	500株
四電工	1,100	2,785.00	3,063,500		
中電工	8,500	2,582.00	21,947,000		
関　電　工	30,000	1,054.00	31,620,000		
きんでん	50,100	1,659.00	83,115,900		
東京エネシス	7,000	938.00	6,566,000		
トーエネック	2,100	3,640.00	7,644,000		
住友電設	6,000	2,469.00	14,814,000		
日本電設工業	11,600	2,268.00	26,308,800		
協和エクシオ	32,000	2,877.00	92,064,000	貸付株式数	10,900株
新日本空調	5,600	2,242.00	12,555,200		
日本工営	4,300	3,380.00	14,534,000	貸付株式数	100株
九電工	14,800	3,545.00	52,466,000		
三機工業	15,200	1,480.00	22,496,000		
日揮ホールディングス	64,900	1,622.00	105,267,800	貸付株式数	3,300株
中外炉工業	2,300	1,708.00	3,928,400		
ヤマト	6,700	722.00	4,837,400		
太平電業	5,100	2,333.00	11,898,300		
高砂熱学	18,300	1,901.00	34,788,300		
三晃金属	900	2,630.00	2,367,000		
ＮＥＣネッツエスアイ	6,200	3,445.00	21,359,000		

朝日工業社	1,400	3,470.00	4,858,000	貸付株式数	100株
明星工業	13,600	930.00	12,648,000	貸付株式数	400株
大　氣　社	10,300	3,705.00	38,161,500	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ダイダン	5,000	2,632.00	13,160,000		
日比谷総合設備	6,800	1,949.00	13,253,200	貸付株式数	1,000株
東芝プラントシステム	16,100	2,664.00	42,890,400		
日本製粉	19,800	1,716.00	33,976,800		
日清製粉Ｇ本社	76,200	2,058.00	156,819,600		
日東富士製粉	500	6,360.00	3,180,000	貸付株式数	100株
昭和産業	6,200	3,230.00	20,026,000	貸付株式数	2,100株
鳥越製粉	6,000	945.00	5,670,000	貸付株式数	100株
中部飼料	8,200	1,390.00	11,398,000		
フィード・ワン	45,400	170.00	7,718,000		
東洋精糖	1,100	1,136.00	1,249,600		
日本甜菜糖	3,500	2,040.00	7,140,000		
三井製糖	5,900	2,320.00	13,688,000		
塩水港精糖	7,300	220.00	1,606,000	貸付株式数	2,800株
日新製糖	3,200	2,019.00	6,460,800	貸付株式数	400株
ＬＩＦＵＬＬ	22,400	555.00	12,432,000	貸付株式数	7,900株
ジェイエイシーリクルートメント	4,300	2,092.00	8,995,600	貸付株式数	1,300株
日本M&Aセンター	48,500	3,750.00	181,875,000	貸付株式数	1,300株
メンバーズ	1,900	2,358.00	4,480,200	貸付株式数	500株
中広	600	546.00	327,600		
アイティメディア	1,900	791.00	1,502,900	貸付株式数	300株
タケエイ	6,200	1,283.00	7,954,600		
Ｅ・Ｊホールディングス	800	1,432.00	1,145,600		
トラスト・テック	7,100	1,353.00	9,606,300		
コシダカホールディングス	15,500	1,609.00	24,939,500	貸付株式数	200株
アルトナー	1,600	754.00	1,206,400		
パソナグループ	7,800	1,707.00	13,314,600	貸付株式数	1,200株
ＣＤＳ	1,600	1,510.00	2,416,000	貸付株式数	600株
リンクアンドモチベーション	14,200	726.00	10,309,200	貸付株式数	5,000株
ＧＣＡ	7,700	953.00	7,338,100		
エス・エム・エス	20,000	3,005.00	60,100,000		
サニーサイドアップ	1,400	1,138.00	1,593,200		
パーソルホールディングス	64,200	2,034.00	130,582,800		

リニカル	3,100	1,180.00	3,658,000	貸付株式数	1,200株 (600株)
クックパッド	22,400	372.00	8,332,800		
エスクリ	2,000	802.00	1,604,000		
アイ・ケイ・ケイ	3,100	723.00	2,241,300	貸付株式数	1,100株
森永製菓	15,800	5,610.00	88,638,000		
中　村　屋	1,800	4,470.00	8,046,000		
江崎グリコ	20,000	5,090.00	101,800,000	貸付株式数	4,600株
名糖産業	3,200	1,315.00	4,208,000		
井村屋グループ	2,900	2,058.00	5,968,200	貸付株式数	500株
不　二　家	3,800	2,214.00	8,413,200		
山崎製パン	50,600	2,036.00	103,021,600	貸付株式数	11,500株
第一屋製パン	1,200	995.00	1,194,000	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	4,970.00	5,467,000		
亀田製菓	3,800	5,030.00	19,114,000		
寿スピリッツ	6,500	7,660.00	49,790,000		
カルビー	30,700	3,560.00	109,292,000		
森永乳業	12,500	4,635.00	57,937,500		
六甲バター	4,500	1,808.00	8,136,000		
ヤクルト	46,400	6,530.00	302,992,000		
明治ホールディングス	44,600	7,530.00	335,838,000		
雪印メグミルク	16,300	2,666.00	43,455,800		
プリマハム	10,600	2,554.00	27,072,400	貸付株式数	2,700株
日本ハム	25,800	4,650.00	119,970,000		
林兼産業	2,300	729.00	1,676,700		
丸大食品	7,200	2,341.00	16,855,200	貸付株式数	2,500株
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5,400	3,005.00	16,227,000		
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	43,400	718.00	31,161,200	貸付株式数	2,100株
学情	2,300	1,589.00	3,654,700	貸付株式数	900株 (900株)
スタジオアリス	3,200	1,949.00	6,236,800	貸付株式数	900株
クロスキャット	1,700	1,000.00	1,700,000		
シミックホールディングス	3,600	1,818.00	6,544,800		
システナ	23,500	1,756.00	41,266,000		
ＮＪＳ	1,400	1,728.00	2,419,200		
デジタルアーツ	3,200	6,320.00	20,224,000	貸付株式数	1,200株
日鉄ソリューションズ	9,900	3,810.00	37,719,000		
綜合警備保障	25,600	5,810.00	148,736,000		
キューブシステム	3,500	798.00	2,793,000		
いちご	84,300	439.00	37,007,700		

エイジア	1,200	1,319.00	1,582,800	貸付株式数	400株
日本駐車場開発	72,400	166.00	12,018,400	貸付株式数	5,700株
コア	2,800	1,445.00	4,046,000	貸付株式数	100株
カカクコム	48,100	2,654.00	127,657,400		
アイロムグループ	2,300	1,456.00	3,348,800	貸付株式数	800株
セントケア・ホールディング	4,400	516.00	2,270,400		
サイネックス	1,100	683.00	751,300	貸付株式数	200株
ルネサンス	3,600	1,746.00	6,285,600		
ディップ	9,000	3,115.00	28,035,000	貸付株式数	3,800株
ＳＢＳホールディングス	5,800	1,967.00	11,408,600	貸付株式数	2,200株
オプトホールディング	3,500	1,783.00	6,240,500	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
新日本科学	6,900	786.00	5,423,400		
ツクイ	15,100	568.00	8,576,800		
キャリアデザインセンター	1,600	1,331.00	2,129,600		
ベネフィット・ワン	17,600	2,425.00	42,680,000	貸付株式数	6,800株
エムスリー	141,600	3,055.00	432,588,000	貸付株式数	55,300株
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	4,200	637.00	2,675,400	貸付株式数	1,500株
ブラス	700	695.00	486,500	貸付株式数	100株
アウトソーシング	36,700	1,202.00	44,113,400	貸付株式数	13,300株
ウェルネット	6,000	821.00	4,926,000	貸付株式数	700株
ワールドホールディングス	2,100	1,969.00	4,134,900	貸付株式数	600株
ディー・エヌ・エー	31,500	1,780.00	56,070,000		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	89,300	1,788.00	159,668,400		
ぐるなび	11,100	1,045.00	11,599,500	貸付株式数	1,500株
タカミヤ	6,900	723.00	4,988,700	貸付株式数	2,600株
ジャパンベストレスキューＳ	4,400	1,081.00	4,756,400	貸付株式数	1,500株
ファンコミュニケーションズ	17,700	505.00	8,938,500	貸付株式数	500株
ライク	2,500	1,697.00	4,242,500	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	2,700	346.00	934,200		
エスプール	12,400	711.00	8,816,400		
ＷＤＢホールディングス	2,900	2,534.00	7,348,600		
ティア	3,700	596.00	2,205,200		
ＣＤＧ	700	1,417.00	991,900	貸付株式数	200株 (200株)

バリューコマース	3,600	2,001.00	7,203,600	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
インフォマート	35,200	1,940.00	68,288,000	貸付株式数	13,400株
サッポロホールディングス	23,100	2,679.00	61,884,900		
アサヒグループホールディン	141,300	5,266.00	744,085,800	貸付株式数	52,100株
キリンＨＤ	286,100	2,441.50	698,513,150		
宝ホールディングス	50,500	1,074.00	54,237,000		
オエノンホールディングス	17,800	405.00	7,209,000	貸付株式数	6,800株
養　命　酒	2,100	2,000.00	4,200,000		
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	47,300	2,646.00	125,155,800	貸付株式数	18,800株
サントリー食品インター	45,100	4,755.00	214,450,500		
ダイドーグループＨＤ	3,500	4,635.00	16,222,500	貸付株式数	1,300株
伊　藤　園	20,500	5,540.00	113,570,000	貸付株式数	8,000株
キーコーヒー	6,600	2,399.00	15,833,400		
ユニカフェ	1,700	1,034.00	1,757,800	貸付株式数	600株
ジャパンフーズ	1,000	1,238.00	1,238,000		
日清オイリオグループ	8,700	3,920.00	34,104,000		
不二製油グループ	16,500	3,075.00	50,737,500	貸付株式数	6,000株
かどや製油	700	3,815.00	2,670,500	貸付株式数	100株
Ｊ－オイルミルズ	3,500	4,365.00	15,277,500		
ローソン	16,700	6,080.00	101,536,000		
サンエー	5,500	5,050.00	27,775,000	貸付株式数	100株
カワチ薬品	5,100	2,305.00	11,755,500	貸付株式数	700株
エービーシー・マート	10,300	7,460.00	76,838,000		
ハードオフコーポレーション	2,600	810.00	2,106,000		
高千穂交易	2,500	1,093.00	2,732,500	貸付株式数	800株
アスクル	6,900	3,005.00	20,734,500	貸付株式数	1,800株 (100株)
ゲオホールディングス	11,900	1,318.00	15,684,200	貸付株式数	4,600株
アダストリア	9,200	2,536.00	23,331,200		
ジーフット	4,100	622.00	2,550,200	貸付株式数	1,500株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,100	671.00	738,100		
伊藤忠食品	1,700	5,220.00	8,874,000		
くら寿司	3,400	4,885.00	16,609,000		
キャンドゥ	3,100	1,635.00	5,068,500	貸付株式数	800株 (600株)

エレマテック	6,100	1,057.00	6,447,700		
パルグループＨＬＤＧＳ	3,400	3,575.00	12,155,000		
ＪＡＬＵＸ	1,900	2,521.00	4,789,900	貸付株式数	700株
エディオン	30,400	1,187.00	36,084,800	貸付株式数	6,000株
あらた	5,300	4,315.00	22,869,500		
サーラコーポレーション	13,500	623.00	8,410,500	貸付株式数	3,200株
ワッツ	2,900	616.00	1,786,400	貸付株式数	500株 (400株)
トーメンデバイス	1,000	2,825.00	2,825,000	貸付株式数	200株
ハローズ	2,500	2,580.00	6,450,000		
ＪＰホールディングス	20,100	294.00	5,909,400	貸付株式数	7,800株
フジオフードシステム	2,800	3,570.00	9,996,000	貸付株式数	1,000株
あみやき亭	1,400	3,645.00	5,103,000		
東京エレクトロンデバイス	2,400	2,255.00	5,412,000		
ひらまつ	12,100	305.00	3,690,500	貸付株式数	4,700株
フィールズ	5,100	499.00	2,544,900		
双日	366,300	351.00	128,571,300		
アルフレッサホールディングス	73,500	2,303.00	169,270,500		
大黒天物産	1,600	3,210.00	5,136,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,800	1,390.00	8,062,000	貸付株式数	100株
ファーマライズＨＤ	1,500	634.00	951,000		
キッコーマン	48,500	5,600.00	271,600,000		
味　の　素	149,000	1,836.00	273,564,000		
キユーピー	37,500	2,456.00	92,100,000	貸付株式数	14,600株
ハウス食品Ｇ本社	25,200	3,840.00	96,768,000	貸付株式数	5,100株
カ　ゴ　メ	25,600	2,688.00	68,812,800		
焼津水産化工	3,200	1,052.00	3,366,400		
アリアケジャパン	6,200	7,880.00	48,856,000	貸付株式数	1,700株
ピエトロ	900	1,640.00	1,476,000		
エバラ食品工業	1,600	2,186.00	3,497,600		
やまみ	300	2,158.00	647,400		
ニチレイ	32,100	2,581.00	82,850,100		
横浜冷凍	18,600	1,080.00	20,088,000	貸付株式数	600株
東洋水産	34,700	4,745.00	164,651,500		
イートアンド	2,300	1,785.00	4,105,500		
大冷	900	1,969.00	1,772,100		
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	3,700	1,207.00	4,465,900	貸付株式数	200株
日清食品ＨＤ	28,700	8,230.00	236,201,000		

永谷園ホールディングス	3,300	2,152.00	7,101,600		
一正蒲鉾	2,600	1,063.00	2,763,800	貸付株式数	800株 (800株)
フジッコ	7,300	2,011.00	14,680,300		
ロックフィールド	7,300	1,480.00	10,804,000	貸付株式数	2,800株
日本たばこ産業	389,500	2,516.50	980,176,750	貸付株式数	8,100株
ケンコーマヨネーズ	3,800	2,602.00	9,887,600	貸付株式数	1,400株
わらべや日洋ＨＤ	4,400	1,819.00	8,003,600		
なとり	3,800	1,700.00	6,460,000		
イフジ産業	1,200	778.00	933,600	貸付株式数	100株
ピックルスコーポレーション	1,500	2,785.00	4,177,500	貸付株式数	100株
北の達人コーポ	23,500	704.00	16,544,000	貸付株式数	9,200株
ユーグレナ	28,800	836.00	24,076,800	貸付株式数	11,200株 (5,200株)
片倉工業	9,500	1,378.00	13,091,000	貸付株式数	700株
グ　ン　ゼ	4,800	5,200.00	24,960,000	貸付株式数	1,500株
ヒューリック	141,600	1,254.00	177,566,400	貸付株式数	49,500株
神　栄	1,000	746.00	746,000	貸付株式数	100株
ラサ商事	3,500	890.00	3,115,000		
アルペン	5,000	1,840.00	9,200,000	貸付株式数	1,600株
ハブ	1,900	1,033.00	1,962,700	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	3,200	703.00	2,249,600		
クオールホールディングス	9,800	1,584.00	15,523,200		
アルコニックス	7,000	1,447.00	10,129,000		
神戸物産	22,800	3,390.00	77,292,000	貸付株式数	8,900株
ソリトンシステムズ	2,900	1,099.00	3,187,100		
ジンズホールディングス	3,500	6,720.00	23,520,000	貸付株式数	100株
ビックカメラ	39,300	1,213.00	47,670,900		
ＤＣＭホールディングス	35,800	1,069.00	38,270,200	貸付株式数	13,100株
ペッパーフードサービス	5,300	1,322.00	7,006,600	貸付株式数	2,000株 (300株)
ＭｏｎｏｔａＲＯ	47,100	3,085.00	145,303,500	貸付株式数	18,200株 (2,500株)
東京一番フーズ	1,600	626.00	1,001,600		
ＤＤホールディングス	2,600	1,567.00	4,074,200	貸付株式数	1,000株
あい　ホールディングス	9,500	1,997.00	18,971,500		
ディーブイエックス	2,300	954.00	2,194,200	貸付株式数	900株
きちりホールディングス	1,700	848.00	1,441,600	貸付株式数	600株
アークランドサービスＨＤ	4,800	1,871.00	8,980,800		

Ｊ．　フロント　リテイリング	79,100	1,473.00	116,514,300	貸付株式数	22,700株
ドトール・日レスＨＤ	10,500	2,233.00	23,446,500		
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	27,400	4,200.00	115,080,000	貸付株式数	10,400株
ブロンコビリー	3,400	2,741.00	9,319,400	貸付株式数	1,300株
ＺＯＺＯ	45,500	2,206.00	100,373,000	貸付株式数	27,400株
トレジャー・ファクトリー	1,900	1,120.00	2,128,000	貸付株式数	600株
物語コーポレーション	1,600	8,630.00	13,808,000	貸付株式数	600株 (100株)
ココカラファイン	6,900	6,440.00	44,436,000	貸付株式数	200株
三越伊勢丹ＨＤ	115,700	990.00	114,543,000		
東洋紡	26,000	1,622.00	42,172,000		
ユニチカ	19,300	376.00	7,256,800	貸付株式数	7,200株
富士紡ホールディングス	3,200	3,480.00	11,136,000		
日清紡ホールディングス	44,800	1,019.00	45,651,200		
倉敷紡績	6,700	2,582.00	17,299,400	貸付株式数	400株
ダイワボウＨＤ	5,600	5,580.00	31,248,000	貸付株式数	600株
シキボウ	3,400	941.00	3,199,400		
日東紡績	10,000	4,100.00	41,000,000		
トヨタ紡織	19,600	1,726.00	33,829,600	貸付株式数	8,600株
マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	15,800	1,874.00	29,609,200		
Ｈａｍｅｅ	2,000	1,398.00	2,796,000		
ラクト・ジャパン	2,500	3,480.00	8,700,000	貸付株式数	1,000株 (500株)
ウエルシアＨＤ	19,700	6,790.00	133,763,000	貸付株式数	7,600株
クリエイトＳＤＨ	9,700	2,676.00	25,957,200		
バイタルＫＳＫＨＤ	12,400	1,108.00	13,739,200	貸付株式数	4,800株
八洲電機	5,100	882.00	4,498,200		
メディアスホールディングス	3,800	830.00	3,154,000	貸付株式数	100株
レスターホールディングス	6,900	2,036.00	14,048,400	貸付株式数	2,600株
ジューテックＨＤ	1,500	1,087.00	1,630,500	貸付株式数	500株
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	7,600	376.00	2,857,600	貸付株式数	2,000株
大光	2,800	693.00	1,940,400	貸付株式数	1,000株
ＯＣＨＩホールディングス	1,900	1,401.00	2,661,900		
ＴＯＫＡＩホールディングス	35,000	1,108.00	38,780,000	貸付株式数	1,400株
黒谷	1,500	450.00	675,000		
ミサワ	1,300	842.00	1,094,600	貸付株式数	400株

ティーライフ	900	869.00	782,100	貸付株式数	300株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,100	820.00	902,000		
エー・ピーカンパニー	1,200	517.00	620,400		
三洋貿易	3,300	2,352.00	7,761,600		
チムニー	2,000	2,308.00	4,616,000	貸付株式数	700株
シュッピン	4,500	1,167.00	5,251,500	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ビューティガレージ	1,100	2,095.00	2,304,500	貸付株式数	400株
ウイン・パートナーズ	4,800	1,486.00	7,132,800		
ネクステージ	9,500	1,195.00	11,352,500	貸付株式数	3,400株
ジョイフル本田	19,300	1,463.00	28,235,900	貸付株式数	5,400株
鳥貴族	2,200	1,897.00	4,173,400	貸付株式数	900株
キリン堂ホールディングス	2,600	2,059.00	5,353,400		
ホットランド	4,400	1,353.00	5,953,200	貸付株式数	1,700株
すかいらーくＨＤ	74,200	2,217.00	164,501,400	貸付株式数	29,000株 (2,800株)
ＳＦＰホールディングス	2,800	2,200.00	6,160,000		
綿半ホールディングス	2,500	2,015.00	5,037,500	貸付株式数	100株
日本毛織	21,600	1,075.00	23,220,000	貸付株式数	2,700株
ダイトウボウ	11,500	85.00	977,500	貸付株式数	2,900株
トーア紡コーポレーション	2,600	581.00	1,510,600	貸付株式数	100株
ダイドーリミテツド	8,500	280.00	2,380,000		
ヨシックス	1,100	2,864.00	3,150,400	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパーマーケ	19,300	981.00	18,933,300		
三栄建築設計	2,700	1,625.00	4,387,500	貸付株式数	300株
野村不動産ＨＬＤＧＳ	40,200	2,653.00	106,650,600		
三重交通グループＨＤ	13,500	604.00	8,154,000	貸付株式数	3,500株
サムティ	9,400	2,028.00	19,063,200		
エー・ディー・ワークス	121,800	31.00	3,775,800		
日本商業開発	4,200	1,606.00	6,745,200	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーション	10,700	1,756.00	18,789,200		
ユニゾホールディングス	10,000	4,900.00	49,000,000	貸付株式数	3,600株
日本管理センター	4,400	1,319.00	5,803,600		
サンセイランディック	2,000	882.00	1,764,000	貸付株式数	500株 (500株)
エストラスト	900	805.00	724,500	貸付株式数	300株
フージャースＨＤ	13,300	707.00	9,403,100	貸付株式数	4,900株
オープンハウス	19,200	2,920.00	56,064,000	貸付株式数	7,500株

東急不動産ＨＤ	180,400	744.00	134,217,600		
飯田ＧＨＤ	55,300	1,953.00	108,000,900		
イーグランド	1,100	808.00	888,800		
帝国繊維	7,400	2,042.00	15,110,800		
日本コークス工業	58,200	81.00	4,714,200		
ゴルフダイジェスト・オン	3,000	684.00	2,052,000	貸付株式数	1,100株
ミタチ産業	2,000	751.00	1,502,000	貸付株式数	200株
ＢＥＥＮＯＳ	2,300	1,539.00	3,539,700	貸付株式数	900株
あさひ	4,900	1,263.00	6,188,700	貸付株式数	1,900株
日本調剤	2,000	3,780.00	7,560,000		
コスモス薬品	2,900	22,250.00	64,525,000	貸付株式数	1,100株
シップヘルスケアＨＤ	10,600	4,580.00	48,548,000		
トーエル	3,200	793.00	2,537,600	貸付株式数	100株
ソフトクリエイトＨＤ	2,900	1,784.00	5,173,600	貸付株式数	200株
オンリー	1,100	801.00	881,100		
セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ	259,000	4,113.00	1,065,267,000	貸付株式数	106,600株
クリエイト・レストランツ・ホール	17,800	1,841.00	32,769,800	貸付株式数	2,700株
明治電機工業	2,100	1,560.00	3,276,000		
ツルハホールディングス	14,400	13,070.00	188,208,000	貸付株式数	5,600株
デリカフーズＨＬＤＧＳ	2,400	689.00	1,653,600	貸付株式数	200株
スターティアホールディングス	1,500	595.00	892,500	貸付株式数	400株
サンマルクホールディングス	5,200	2,332.00	12,126,400		
フェリシモ	1,400	1,038.00	1,453,200		
トリドールホールディングス	8,200	2,879.00	23,607,800	貸付株式数	3,000株 (3,000株)
帝　人	53,700	2,096.00	112,555,200	貸付株式数	21,000株
東　レ	476,500	738.00	351,657,000		
ク　ラ　レ	103,500	1,348.00	139,518,000		
旭　化　成	436,200	1,224.50	534,126,900		
サカイオーベックス	1,700	1,855.00	3,153,500		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	5,900	717.00	4,230,300	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
稲葉製作所	3,700	1,431.00	5,294,700		
宮地エンジニアリングＧ	2,000	2,085.00	4,170,000	貸付株式数	700株
トーカロ	18,400	1,112.00	20,460,800		
アルファＣＯ	2,300	1,311.00	3,015,300		
ＳＵＭＣＯ	79,600	1,691.00	134,603,600	貸付株式数	30,800株

川田テクノロジーズ	1,400	6,850.00	9,590,000		
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	1,900	3,715.00	7,058,500	貸付株式数	700株 (400株)
信和	2,800	1,100.00	3,080,000	貸付株式数	100株
ビーロット	1,500	2,031.00	3,046,500	貸付株式数	600株
ファーストブラザーズ	1,500	1,278.00	1,917,000	貸付株式数	100株
ハウスドゥ	3,700	1,619.00	5,990,300	貸付株式数	800株
シーアールイー	1,800	1,066.00	1,918,800	貸付株式数	100株
プロパティエージェント	1,000	1,156.00	1,156,000	貸付株式数	300株
ケイアイスター不動産	2,100	1,996.00	4,191,600		
アグレ都市デザイン	1,100	532.00	585,200		
ジェイ・エス・ビー	700	4,620.00	3,234,000		
テンポイノベーション	700	2,146.00	1,502,200	貸付株式数	100株
グロバルリンクマネジメント	1,100	679.00	746,900		
住江織物	1,900	2,852.00	5,418,800	貸付株式数	700株
日本フエルト	3,700	499.00	1,846,300		
イチカワ	900	1,479.00	1,331,100	貸付株式数	100株
エコナックホールディングス	11,400	133.00	1,516,200	貸付株式数	200株
日東製網	800	1,632.00	1,305,600		
芦森工業	1,400	1,392.00	1,948,800		
アツギ	5,400	829.00	4,476,600		
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	1,100	933.00	1,026,300		
ジャパンミート	3,300	2,165.00	7,144,500		
コメダホールディングス	14,400	2,125.00	30,600,000	貸付株式数	400株
サツドラホールディングス	1,000	1,773.00	1,773,000	貸付株式数	300株
デファクトスタンダード	600	447.00	268,200		
アレンザホールディングス	3,300	878.00	2,897,400	貸付株式数	900株
串カツ田中ＨＬＤＧＳ	1,000	2,366.00	2,366,000	貸付株式数	300株
バロックジャパン	4,600	946.00	4,351,600	貸付株式数	1,700株
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	6,600	8,290.00	54,714,000	貸付株式数	2,500株
ダイニック	2,500	768.00	1,920,000		
共和レザー	3,600	803.00	2,890,800	貸付株式数	1,200株
力の源ＨＤ	3,000	872.00	2,616,000		
スシローグローバルＨＬＤＧＳ	7,300	8,560.00	62,488,000		
ＬＩＸＩＬビバ	6,500	1,917.00	12,460,500		
セーレン	16,200	1,560.00	25,272,000		
ソトー	2,600	973.00	2,529,800	貸付株式数	1,000株

東海染工	900	1,128.00	1,015,200		
小松マテーレ	10,800	830.00	8,964,000		
ワコールホールディングス	17,200	3,085.00	53,062,000		
ホギメディカル	7,500	3,610.00	27,075,000		
レナウン	16,900	115.00	1,943,500	貸付株式数	500株
クラウディアＨＬＤＧＳ	1,700	488.00	829,600		
ＴＳＩホールディングス	22,000	553.00	12,166,000		
マツオカコーポレーション	1,900	2,197.00	4,174,300		
ワールド	9,300	2,766.00	25,723,800		
ＴＩＳ	22,000	6,610.00	145,420,000		
ネオス	2,600	828.00	2,152,800	貸付株式数	1,000株
電算システム	2,500	2,985.00	7,462,500	貸付株式数	900株
グリー	45,500	523.00	23,796,500		
コーエーテクモＨＤ	13,500	2,684.00	36,234,000		
三菱総合研究所	2,800	4,190.00	11,732,000		
ボルテージ	1,300	533.00	692,900	貸付株式数	400株
電算	700	2,175.00	1,522,500	貸付株式数	100株 (100株)
ＡＧＳ	3,700	795.00	2,941,500		
ファインデックス	5,500	1,194.00	6,567,000		
ブレインパッド	1,300	5,750.00	7,475,000	貸付株式数	400株
ＫＬａｂ	12,700	850.00	10,795,000	貸付株式数	4,900株
ポールトゥウィン・ピットクル	8,000	1,074.00	8,592,000		
イーブックイニシアティブ	900	2,054.00	1,848,600	貸付株式数	300株
ネクソン	187,700	1,501.00	281,737,700	貸付株式数	73,400株
アイスタイル	17,000	809.00	13,753,000	貸付株式数	6,000株
エムアップ	1,900	2,585.00	4,911,500	貸付株式数	800株
エイチーム	4,500	1,138.00	5,121,000	貸付株式数	1,700株
エニグモ	4,600	1,057.00	4,862,200	貸付株式数	1,800株
テクノスジャパン	5,100	525.00	2,677,500	貸付株式数	2,000株
ｅｎｉｓｈ	2,900	637.00	1,847,300	貸付株式数	1,100株
コロプラ	21,600	1,273.00	27,496,800	貸付株式数	8,400株 (4,500株)
オルトプラス	4,900	820.00	4,018,000	貸付株式数	1,700株
ブロードリーフ	32,700	709.00	23,184,300	貸付株式数	12,700株
クロス・マーケティングＧ	2,900	369.00	1,070,100	貸付株式数	500株
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	3,500	1,022.00	3,577,000	貸付株式数	1,300株
システム情報	3,300	1,114.00	3,676,200	貸付株式数	1,200株
メディアドゥＨＬＤＧＳ	2,200	3,760.00	8,272,000	貸付株式数	800株

じげん	16,300	554.00	9,030,200		
ブイキューブ	4,000	547.00	2,188,000	貸付株式数	400株
エンカレッジ・テクノロジ	1,100	816.00	897,600	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	1,000	1,295.00	1,295,000	貸付株式数	300株
ディー・エル・イー	4,300	183.00	786,900		
フィックスターズ	7,000	1,628.00	11,396,000	貸付株式数	2,700株
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,200	1,362.00	4,358,400	貸付株式数	800株
オプティム	1,700	3,485.00	5,924,500	貸付株式数	1,000株
セレス	2,100	1,219.00	2,559,900		
特種東海製紙	4,200	4,055.00	17,031,000	貸付株式数	500株
ティーガイア	5,900	2,619.00	15,452,100	貸付株式数	1,700株
セック	1,000	3,885.00	3,885,000	貸付株式数	400株
日本アジアグループ	6,900	384.00	2,649,600		
豆蔵ホールディングス	4,500	1,443.00	6,493,500		
テクマトリックス	4,600	2,325.00	10,695,000		
プロシップ	1,900	1,305.00	2,479,500		
ガンホー・オンライン・エンター	15,900	2,397.00	38,112,300	貸付株式数	6,200株
GMOペイメントゲートウェイ	10,900	7,910.00	86,219,000	貸付株式数	4,200株
ザッパラス	3,500	425.00	1,487,500	貸付株式数	1,300株
システムリサーチ	1,700	1,829.00	3,109,300		
インターネットイニシアティブ	9,800	2,553.00	25,019,400		
さくらインターネット	7,000	664.00	4,648,000		
ヴィンクス	1,900	1,261.00	2,395,900	貸付株式数	700株
GMOクラウド	1,200	2,917.00	3,500,400	貸付株式数	400株
ＳＲＡホールディングス	3,500	2,546.00	8,911,000		
ＭＩＮＯＲＩソリューションズ	1,200	2,696.00	3,235,200		
システムインテグレータ	2,100	884.00	1,856,400		
朝日ネット	4,600	618.00	2,842,800	貸付株式数	300株
ｅＢＡＳＥ	3,900	1,197.00	4,668,300		
アバント	4,700	1,036.00	4,869,200		
アドソル日進	2,300	2,385.00	5,485,500	貸付株式数	900株
フリービット	3,900	933.00	3,638,700	貸付株式数	1,500株
コムチュア	7,400	2,402.00	17,774,800		
サイバーコム	1,200	2,125.00	2,550,000		
アステリア	4,100	647.00	2,652,700		

アイル	2,300	1,628.00	3,744,400		
王子ホールディングス	275,100	632.00	173,863,200		
日本製紙	29,100	1,935.00	56,308,500		
三菱製紙	7,500	508.00	3,810,000		
北越コーポレーション	43,600	569.00	24,808,400		
中越パルプ	2,800	1,646.00	4,608,800		
巴川製紙	2,000	929.00	1,858,000	貸付株式数	800株
大王製紙	28,900	1,494.00	43,176,600	貸付株式数	11,200株
阿波製紙	1,700	618.00	1,050,600	貸付株式数	400株 (100株)
マークラインズ	3,300	2,090.00	6,897,000		
メディカル・データ・ビジ	5,000	984.00	4,920,000		
ｇｕｍｉ	8,400	721.00	6,056,400	貸付株式数	3,000株
ショーケース	1,500	673.00	1,009,500	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,500	1,396.00	2,094,000		
テラスカイ	2,400	2,851.00	6,842,400		
デジタル・インフォメーション	2,900	1,694.00	4,912,600		
ＰＣＩホールディングス	1,300	2,223.00	2,889,900	貸付株式数	500株
パイプドHD	800	1,884.00	1,507,200	貸付株式数	400株
アイビーシー	1,200	1,257.00	1,508,400		
ネオジャパン	1,200	1,035.00	1,242,000	貸付株式数	400株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	600	2,462.00	1,477,200	貸付株式数	200株
ランドコンピュータ	1,000	1,074.00	1,074,000		
ダブルスタンダード	800	5,500.00	4,400,000		
オープンドア	3,300	1,784.00	5,887,200	貸付株式数	1,200株
マイネット	2,100	587.00	1,232,700		
アカツキ	2,300	6,420.00	14,766,000	貸付株式数	900株
ベネフィットジャパン	500	1,485.00	742,500	貸付株式数	100株 (100株)
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	1,400	1,259.00	1,762,600	貸付株式数	500株
ＬＩＮＥ	15,100	5,140.00	77,614,000	貸付株式数	7,100株 (2,100株)
カナミックネットワーク	4,000	726.00	2,904,000		
ノムラシステムコーポレーション	1,400	558.00	781,200	貸付株式数	500株
レンゴー	62,200	826.00	51,377,200		
トーモク	4,100	1,780.00	7,298,000	貸付株式数	1,400株
ザ・パック	5,000	3,910.00	19,550,000		

チェンジ	1,300	2,516.00	3,270,800	貸付株式数	500株
シンクロ・フード	2,800	531.00	1,486,800		
オークネット	4,100	1,345.00	5,514,500	貸付株式数	1,500株
セグエグループ	1,100	857.00	942,700		
エイトレッド	800	1,513.00	1,210,400	貸付株式数	200株 (200株)
AOI TYO HOLDINGS	6,700	691.00	4,629,700		
マクロミル	11,800	1,025.00	12,095,000		
ビーグリー	1,300	1,283.00	1,667,900	貸付株式数	400株
オロ	1,700	4,295.00	7,301,500	貸付株式数	600株
テモナ	800	480.00	384,000	貸付株式数	300株
ニーズウェル	800	693.00	554,400		
サインポスト	1,000	1,833.00	1,833,000	貸付株式数	300株
昭和電工	46,800	2,965.00	138,762,000	貸付株式数	16,400株
住友化学	482,900	503.00	242,898,700		
住友精化	2,900	3,490.00	10,121,000		
日産化学	36,800	4,440.00	163,392,000		
ラサ工業	2,300	1,524.00	3,505,200	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,600	6,550.00	36,680,000		
多木化学	1,900	4,550.00	8,645,000	貸付株式数	700株
テイカ	4,800	1,954.00	9,379,200		
石原産業	11,800	1,184.00	13,971,200		
片倉コープアグリ	1,700	1,184.00	2,012,800		
日本曹達	9,700	2,956.00	28,673,200	貸付株式数	800株
東ソー	101,600	1,659.00	168,554,400		
トクヤマ	19,000	2,976.00	56,544,000		
セントラル硝子	13,400	2,697.00	36,139,800		
東亞合成	41,100	1,275.00	52,402,500	貸付株式数	200株
大阪ソーダ	6,600	3,050.00	20,130,000		
関東電化	15,500	1,053.00	16,321,500		
デンカ	24,000	3,295.00	79,080,000		
イビデン	41,100	2,579.00	105,996,900		
信越化学	115,000	11,905.00	1,369,075,000		
日本カーバイド	2,200	1,487.00	3,271,400		
堺　化　学	4,200	2,514.00	10,558,800		
第一稀元素化学工	7,100	873.00	6,198,300		
エア・ウォーター	53,800	1,752.00	94,257,600	貸付株式数	21,000株
大陽日酸	63,200	2,450.00	154,840,000	貸付株式数	1,000株
日本化学工業	2,000	3,190.00	6,380,000	貸付株式数	800株

東邦アセチレン	1,000	1,354.00	1,354,000		
日本パーカライジング	33,000	1,167.00	38,511,000		
高圧ガス	10,300	803.00	8,270,900		
チタン工業	800	2,678.00	2,142,400	貸付株式数	300株
四国化成	10,100	1,294.00	13,069,400		
戸田工業	1,500	2,214.00	3,321,000	貸付株式数	500株
ステラ　ケミファ	3,600	3,235.00	11,646,000	貸付株式数	1,400株
保土谷化学	2,400	3,900.00	9,360,000		
日本触媒	10,200	6,870.00	70,074,000		
大日精化	5,800	3,230.00	18,734,000		
カネカ	17,000	3,565.00	60,605,000	貸付株式数	6,600株
協和キリン	67,500	2,341.00	158,017,500		
三菱瓦斯化学	62,000	1,724.00	106,888,000		
三井化学	59,600	2,650.00	157,940,000		
ＪＳＲ	61,200	1,930.00	118,116,000		
東京応化工業	11,300	4,075.00	46,047,500		
大阪有機化学	6,000	1,399.00	8,394,000	貸付株式数	700株
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	439,800	818.50	359,976,300		
ＫＨネオケム	11,600	2,514.00	29,162,400	貸付株式数	4,500株
ダイセル	89,900	1,090.00	97,991,000		
住友ベークライト	10,300	4,350.00	44,805,000	貸付株式数	100株
積水化学	141,400	1,920.00	271,488,000		
日本ゼオン	59,300	1,405.00	83,316,500		
アイカ工業	19,700	3,520.00	69,344,000		
宇部興産	33,200	2,404.00	79,812,800		
積水樹脂	11,800	2,286.00	26,974,800	貸付株式数	100株
タキロンシーアイ	14,300	676.00	9,666,800		
旭有機材	3,700	1,720.00	6,364,000		
日立化成	30,400	4,015.00	122,056,000		
ニチバン	3,500	1,946.00	6,811,000		
リケンテクノス	16,400	510.00	8,364,000		
大倉工業	3,100	1,945.00	6,029,500		
積水化成品	8,800	800.00	7,040,000		
群栄化学	1,500	2,499.00	3,748,500		
タイガース　ポリマー	3,400	596.00	2,026,400		
ミライアル	2,300	1,377.00	3,167,100		
ダイキアクシス	2,300	999.00	2,297,700	貸付株式数	900株
ダイキョーニシカワ	13,800	864.00	11,923,200	貸付株式数	1,600株
竹本容器	2,300	1,040.00	2,392,000	貸付株式数	900株

森六ホールディングス	3,500	2,379.00	8,326,500	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
日本化薬	40,600	1,388.00	56,352,800		
カーリットホールディングス	7,000	630.00	4,410,000	貸付株式数	600株
ＥＰＳホールディングス	9,700	1,437.00	13,938,900		
ソルクシーズ	2,800	951.00	2,662,800	貸付株式数	1,000株
レッグス	1,600	1,468.00	2,348,800	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	24,000	924.00	22,176,000		
フェイス	2,300	864.00	1,987,200		
プロトコーポレーション	5,900	1,041.00	6,141,900		
ハイマックス	800	1,902.00	1,521,600		
アミューズ	3,500	3,120.00	10,920,000		
野村総合研究所	110,200	2,309.00	254,451,800	貸付株式数	43,100株
ドリームインキュベータ	1,900	1,670.00	3,173,000		
サイバネットシステム	4,700	784.00	3,684,800		
クイック	4,000	1,683.00	6,732,000		
ＴＡＣ	4,100	228.00	934,800	貸付株式数	1,200株
ＣＥホールディングス	3,800	468.00	1,778,400		
ケネディクス	61,000	586.00	35,746,000		
日本システム技術	1,100	1,263.00	1,389,300	貸付株式数	400株
電通	66,200	4,045.00	267,779,000	貸付株式数	20,700株
インテージホールディングス	8,200	964.00	7,904,800		
テイクアンドギヴニーズ	2,500	1,330.00	3,325,000		
東邦システムサイエンス	1,700	950.00	1,615,000	貸付株式数	200株
ぴあ	1,800	4,820.00	8,676,000	貸付株式数	400株 (400株)
イオンファンタジー	2,500	3,160.00	7,900,000	貸付株式数	200株
ソースネクスト	31,300	491.00	15,368,300	貸付株式数	9,100株
シーティーエス	7,300	753.00	5,496,900	貸付株式数	600株
ネクシィーズグループ	2,200	1,882.00	4,140,400		
インフォコム	7,200	2,468.00	17,769,600		
メディカルシステムネットワーク	6,400	576.00	3,686,400		
日本精化	5,200	1,248.00	6,489,600	貸付株式数	1,900株
扶桑化学工業	6,600	3,075.00	20,295,000	貸付株式数	2,600株
トリケミカル	1,500	7,800.00	11,700,000	貸付株式数	500株
ラクスル	3,500	3,665.00	12,827,500	貸付株式数	1,300株
ＦＩＧ	7,100	313.00	2,222,300	貸付株式数	2,700株

ＡＤＥＫＡ	30,200	1,670.00	50,434,000		
日油	24,700	3,730.00	92,131,000		
ミヨシ油脂	2,500	1,291.00	3,227,500		
新日本理化	10,800	214.00	2,311,200	貸付株式数	1,100株
ハリマ化成グループ	5,400	1,244.00	6,717,600	貸付株式数	600株
アルテリア・ネットワークス	7,300	1,627.00	11,877,100		
ヒト・コミュニケーションズＨＤ	1,500	1,600.00	2,400,000		
花　王	160,900	8,708.00	1,401,117,200	貸付株式数	59,400株
第一工業製薬	2,400	3,725.00	8,940,000		
石原ケミカル	1,800	1,885.00	3,393,000		
日華化学	2,200	889.00	1,955,800	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,000	1,705.00	1,705,000	貸付株式数	200株
三洋化成	3,900	5,490.00	21,411,000		
武田薬品	559,300	4,491.00	2,511,816,300		
アステラス製薬	591,200	1,898.00	1,122,097,600		
大日本住友製薬	49,800	2,123.00	105,725,400		
塩野義製薬	85,900	6,517.00	559,810,300		
田辺三菱製薬	80,900	2,003.00	162,042,700		
わかもと製薬	8,200	274.00	2,246,800	貸付株式数	900株
あすか製薬	7,600	1,322.00	10,047,200		
日本新薬	17,600	9,960.00	175,296,000	貸付株式数	6,800株
ビオフエルミン製薬	1,200	2,331.00	2,797,200		
中外製薬	70,000	9,813.00	686,910,000		
科研製薬	11,500	5,970.00	68,655,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
エーザイ	80,500	8,072.00	649,796,000		
理研ビタミン	3,200	4,065.00	13,008,000		
ロート製薬	34,500	3,505.00	120,922,500		
小野薬品	157,400	2,457.50	386,810,500		
久光製薬	19,800	5,410.00	107,118,000		
有機合成薬品	5,000	307.00	1,535,000	貸付株式数	1,900株
持田製薬	9,300	4,475.00	41,617,500	貸付株式数	3,600株
参天製薬	125,100	2,064.00	258,206,400		
扶桑薬品	2,400	2,103.00	5,047,200		
日本ケミファ	900	2,972.00	2,674,800		
ツムラ	20,800	3,195.00	66,456,000		
日医工	19,000	1,350.00	25,650,000		
テ　ル　モ	190,200	3,910.00	743,682,000	貸付株式数	68,400株

みらかホールディングス	17,900	2,751.00	49,242,900		
キッセイ薬品工業	11,800	3,050.00	35,990,000		
生化学工業	13,000	1,271.00	16,523,000	貸付株式数	2,000株
栄研化学	11,800	1,988.00	23,458,400	貸付株式数	2,700株
日水製薬	2,900	1,308.00	3,793,200		
鳥居薬品	4,200	2,851.00	11,974,200		
ＪＣＲファーマ	4,700	9,350.00	43,945,000		
東和薬品	8,600	2,839.00	24,415,400	貸付株式数	3,300株
富士製薬工業	4,500	1,410.00	6,345,000		
沢井製薬	13,800	6,530.00	90,114,000		
ゼリア新薬工業	12,100	2,178.00	26,353,800	貸付株式数	2,600株
第一三共	192,400	7,012.00	1,349,108,800		
キョーリン製薬ＨＤ	14,700	1,879.00	27,621,300		
大幸薬品	2,700	3,370.00	9,099,000		
ダイト	3,900	3,175.00	12,382,500		
大塚ホールディングス	128,000	4,839.00	619,392,000		
大正製薬ＨＤ	14,200	8,180.00	116,156,000		
ペプチドリーム	34,000	5,110.00	173,740,000	貸付株式数	13,200株
大日本塗料	7,400	1,166.00	8,628,400		
日本ペイントＨＯＬＤ	54,300	5,880.00	319,284,000	貸付株式数	20,000株
関西ペイント	73,900	2,797.00	206,698,300	貸付株式数	9,800株
神東塗料	5,000	205.00	1,025,000	貸付株式数	1,100株
中国塗料	18,600	1,034.00	19,232,400		
日本特殊塗料	4,900	1,376.00	6,742,400		
藤倉化成	8,800	572.00	5,033,600		
太陽ホールディングス	4,800	4,175.00	20,040,000		
ＤＩＣ	27,700	2,998.00	83,044,600		
サカタインクス	14,300	1,197.00	17,117,100		
東洋インキＳＣホールディン	13,800	2,681.00	36,997,800	貸付株式数	100株
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5,000	1,002.00	5,010,000		
アルプス技研	5,700	1,825.00	10,402,500		
サニックス	11,300	379.00	4,282,700	貸付株式数	4,400株 (4,200株)
ダイオーズ	1,200	1,352.00	1,622,400	貸付株式数	300株
日本空調サービス	6,700	783.00	5,246,100		
オリエンタルランド	68,300	15,180.00	1,036,794,000		
フォーカスシステムズ	4,000	902.00	3,608,000	貸付株式数	100株
ダスキン	16,500	3,050.00	50,325,000		
パーク２４	35,600	2,575.00	91,670,000	貸付株式数	13,900株

明光ネットワークジャパン	7,500	1,031.00	7,732,500	貸付株式数	2,800株
ファルコホールディングス	3,500	1,763.00	6,170,500	貸付株式数	100株
クレスコ	2,000	3,580.00	7,160,000		
フジ・メディア・ＨＤ	63,600	1,497.00	95,209,200		
秀英予備校	1,400	468.00	655,200	貸付株式数	600株
田谷	1,200	609.00	730,800		
ラウンドワン	17,900	1,107.00	19,815,300		
リゾートトラスト	29,400	1,846.00	54,272,400		
オービック	22,900	14,610.00	334,569,000		
ジャストシステム	10,700	5,660.00	60,562,000		
ＴＤＣソフト	5,800	899.00	5,214,200		
Ｚホールディングス	905,700	383.00	346,883,100	貸付株式数	1,500株
ビー・エム・エル	8,300	3,205.00	26,601,500		
ワタベウェディング	1,000	591.00	591,000		
トレンドマイクロ	29,300	6,000.00	175,800,000		
りらいあコミュニケーショ	11,600	1,417.00	16,437,200		
ＩＤホールディングス	2,500	1,440.00	3,600,000		
リソー教育	29,300	413.00	12,100,900		
日本オラクル	13,400	10,030.00	134,402,000		
早稲田アカデミー	2,100	966.00	2,028,600		
アルファシステムズ	2,100	2,804.00	5,888,400	貸付株式数	800株
フューチャー	8,000	1,845.00	14,760,000		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,300	1,572.00	6,759,600		
ＳＢテクノロジー	2,400	1,991.00	4,778,400	貸付株式数	400株
トーセ	1,800	936.00	1,684,800	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	71,900	2,131.00	153,218,900	貸付株式数	1,000株
オービックビジネスＣ	6,700	4,890.00	32,763,000	貸付株式数	1,100株
伊藤忠テクノソリュー	30,000	2,951.00	88,530,000		
アイティフォー	8,000	879.00	7,032,000		
東京個別指導学院	2,300	724.00	1,665,200		
東計電算	1,000	3,640.00	3,640,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	36,900	3,830.00	141,327,000	貸付株式数	14,400株
楽天	299,400	942.00	282,034,800	貸付株式数	96,000株
エックスネット	1,000	964.00	964,000		
クリーク・アンド・リバー社	3,300	1,125.00	3,712,500		
テー・オー・ダブリュー	5,600	840.00	4,704,000		
大塚商会	35,700	4,420.00	157,794,000		
サイボウズ	7,700	1,198.00	9,224,600		
ソフトブレーン	3,800	567.00	2,154,600	貸付株式数	1,500株

山田コンサルティングＧＰ	3,100	1,826.00	5,660,600	貸付株式数	1,200株 (1,100株)
セントラルスポーツ	2,400	3,270.00	7,848,000	貸付株式数	200株
パラカ	1,700	2,033.00	3,456,100		
電通国際情報Ｓ	4,100	4,205.00	17,240,500		
デジタルガレージ	11,900	4,135.00	49,206,500	貸付株式数	3,700株
イーエムシステムズ	4,600	2,058.00	9,466,800	貸付株式数	1,800株
ウェザーニューズ	2,200	3,440.00	7,568,000	貸付株式数	800株 (700株)
ＣＩＪ	4,900	1,005.00	4,924,500	貸付株式数	1,900株
ビジネスエンジニアリング	700	3,035.00	2,124,500	貸付株式数	100株
日本エンタープライズ	6,600	232.00	1,531,200	貸付株式数	2,400株
WOWOW	3,200	2,701.00	8,643,200		
スカラ	4,600	787.00	3,620,200		
インテリジェント　ウェイブ	2,400	746.00	1,790,400	貸付株式数	900株
フルキャストホールディングス	6,400	2,485.00	15,904,000		
エン・ジャパン	11,400	5,120.00	58,368,000		
富士フイルムＨＬＤＧＳ	128,900	5,182.00	667,959,800		
コニカミノルタ	146,900	726.00	106,649,400		
資　生　堂	133,600	8,019.00	1,071,338,400		
ライオン	87,400	2,204.00	192,629,600		
高砂香料	4,200	2,582.00	10,844,400		
マンダム	15,100	3,035.00	45,828,500	貸付株式数	5,900株 (2,900株)
ミルボン	9,000	6,310.00	56,790,000	貸付株式数	100株
ファンケル	27,200	2,934.00	79,804,800	貸付株式数	2,200株
コーセー	12,600	17,630.00	222,138,000	貸付株式数	4,900株
コタ	3,500	1,387.00	4,854,500	貸付株式数	1,300株
シーボン	900	2,519.00	2,267,100		
ポーラ・オルビスＨＤ	28,700	2,722.00	78,121,400		
ノエビアホールディングス	6,400	6,280.00	40,192,000		
アジュバンコスメジャパン	1,500	952.00	1,428,000	貸付株式数	400株
エステー	4,300	1,736.00	7,464,800		
アグロカネショウ	2,100	1,435.00	3,013,500	貸付株式数	800株
コ　ニ　シ	10,900	1,487.00	16,208,300		
長谷川香料	8,800	1,982.00	17,441,600		
星光ＰＭＣ	3,800	1,072.00	4,073,600	貸付株式数	1,400株
小林製薬	18,800	9,040.00	169,952,000	貸付株式数	700株

荒川化学工業	6,000	1,581.00	9,486,000		
メック	4,600	1,625.00	7,475,000	貸付株式数	1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,585.00	4,653,000	貸付株式数	300株
タカラバイオ	17,600	2,154.00	37,910,400		
ＪＣＵ	8,100	2,952.00	23,911,200	貸付株式数	500株
新田ゼラチン	4,200	704.00	2,956,800	貸付株式数	300株
ＯＡＴアグリオ	1,100	1,579.00	1,736,900	貸付株式数	400株
デクセリアルズ	17,200	1,095.00	18,834,000		
アース製薬	5,100	5,700.00	29,070,000	貸付株式数	1,900株
北興化学	6,800	588.00	3,998,400		
大成ラミック	2,200	2,850.00	6,270,000		
クミアイ化学	27,700	1,027.00	28,447,900	貸付株式数	1,300株
日本農薬	11,900	588.00	6,997,200	貸付株式数	4,600株
富士興産	2,000	743.00	1,486,000	貸付株式数	400株 (300株)
ニチレキ	7,900	1,300.00	10,270,000		
ユシロ化学	3,700	1,375.00	5,087,500		
ビーピー・カストロール	2,400	1,549.00	3,717,600		
富士石油	17,900	238.00	4,260,200	貸付株式数	7,000株
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,400	1,371.00	3,290,400		
出光興産	75,600	2,966.00	224,229,600		
ＪＸＴＧホールディングス	1,042,600	487.60	508,371,760		
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	19,500	2,394.00	46,683,000	貸付株式数	2,700株
横浜ゴム	39,000	2,303.00	89,817,000		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	38,600	1,580.00	60,988,000	貸付株式数	12,400株
ブリヂストン	206,600	4,421.00	913,378,600		
住友ゴム	60,400	1,412.00	85,284,800		
藤倉コンポジット	5,800	473.00	2,743,400		
オカモト	4,100	4,180.00	17,138,000		
アキレス	4,600	1,826.00	8,399,600		
フ　コ　ク	3,000	714.00	2,142,000		
ニッタ	7,600	3,195.00	24,282,000		
クリエートメディック	2,200	1,066.00	2,345,200		
住友理工	13,000	1,023.00	13,299,000		
三ツ星ベルト	8,800	2,111.00	18,576,800		
バンドー化学	11,800	926.00	10,926,800		
ＡＧＣ	66,400	4,075.00	270,580,000		
日本板硝子	32,200	649.00	20,897,800	貸付株式数	9,300株

石塚硝子	1,300	2,287.00	2,973,100		
有沢製作所	10,500	998.00	10,479,000	貸付株式数	4,000株
日本山村硝子	2,800	1,283.00	3,592,400		
日本電気硝子	27,000	2,380.00	64,260,000		
オハラ	2,700	1,461.00	3,944,700	貸付株式数	200株
住友大阪セメント	12,700	4,690.00	59,563,000		
太平洋セメント	42,500	3,240.00	137,700,000		
リソルホールディングス	700	4,125.00	2,887,500	貸付株式数	200株
日本ヒユーム	6,800	821.00	5,582,800	貸付株式数	200株
日本コンクリート	14,300	272.00	3,889,600	貸付株式数	3,900株
三谷セキサン	3,100	3,590.00	11,129,000		
アジアパイルＨＤ	9,500	550.00	5,225,000	貸付株式数	2,900株
東海カーボン	70,400	1,089.00	76,665,600	貸付株式数	27,500株 (100株)
日本カーボン	3,500	4,285.00	14,997,500	貸付株式数	1,300株
東洋炭素	3,900	2,427.00	9,465,300	貸付株式数	1,400株
ノリタケ	3,700	4,760.00	17,612,000		
ＴＯＴＯ	48,000	4,785.00	229,680,000		
日本碍子	81,900	1,857.00	152,088,300	貸付株式数	100株
日本特殊陶業	52,300	2,228.00	116,524,400	貸付株式数	10,100株
ダントーホールディングス	5,400	115.00	621,000		
ＭＡＲＵＷＡ	2,600	7,550.00	19,630,000		
品川リフラクトリーズ	1,800	3,220.00	5,796,000	貸付株式数	600株
黒崎播磨	1,300	5,820.00	7,566,000		
ヨータイ	5,300	694.00	3,678,200		
イソライト	3,400	694.00	2,359,600		
東京窯業	8,500	341.00	2,898,500	貸付株式数	3,300株
ニッカトー	3,000	762.00	2,286,000		
フジミインコーポレーテッド	6,000	2,889.00	17,334,000		
クニミネ工業	2,800	1,195.00	3,346,000		
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,272.00	1,399,200		
ニチアス	18,400	2,611.00	48,042,400		
日本製鉄	297,500	1,628.50	484,478,750		
神戸製鋼所	121,800	569.00	69,304,200	貸付株式数	47,500株
中山製鋼所	9,200	497.00	4,572,400		
合同製鐵	3,600	2,634.00	9,482,400		
ＪＦＥホールディングス	179,600	1,412.00	253,595,200		
東京製鐵	32,300	836.00	27,002,800		
共英製鋼	7,500	2,100.00	15,750,000		

大和工業	14,100	2,755.00	38,845,500		
東京鐵鋼	2,700	1,532.00	4,136,400	貸付株式数	600株
大阪製鐵	3,500	1,449.00	5,071,500		
淀川製鋼所	9,000	2,129.00	19,161,000		
丸一鋼管	21,600	3,180.00	68,688,000		
モリ工業	2,000	2,504.00	5,008,000		
大同特殊鋼	10,900	4,965.00	54,118,500	貸付株式数	4,200株
日本高周波	2,400	432.00	1,036,800		
日本冶金工	5,500	2,330.00	12,815,000		
山陽特殊製鋼	4,800	1,497.00	7,185,600		
愛知製鋼	3,700	3,640.00	13,468,000		
日立金属	71,600	1,537.00	110,049,200		
日本金属	1,600	968.00	1,548,800		
大平洋金属	4,500	2,418.00	10,881,000	貸付株式数	1,700株
新日本電工	42,400	181.00	7,674,400	貸付株式数	16,700株
栗本鉄工所	3,300	1,981.00	6,537,300		
虹　技	1,000	1,450.00	1,450,000	貸付株式数	300株
日本鋳鉄管	700	1,376.00	963,200	貸付株式数	200株
日本製鋼所	20,200	2,265.00	45,753,000		
三菱製鋼	4,900	1,140.00	5,586,000		
日亜鋼業	9,600	342.00	3,283,200		
日本精線	1,100	2,995.00	3,294,500		
エンビプロＨＤ	2,500	762.00	1,905,000	貸付株式数	500株
大紀アルミニウム	10,800	783.00	8,456,400		
日本軽金属ＨＤ	168,200	227.00	38,181,400		
三井金属	17,900	2,761.00	49,421,900		
東邦亜鉛	3,400	2,135.00	7,259,000		
三菱マテリアル	43,900	2,952.00	129,592,800		
住友鉱山	84,900	3,301.00	280,254,900		
ＤＯＷＡホールディングス	16,800	3,950.00	66,360,000		
古河機金	11,800	1,516.00	17,888,800		
エス・サイエンス	29,700	51.00	1,514,700		
大阪チタニウム	6,900	1,573.00	10,853,700		
東邦チタニウム	11,900	970.00	11,543,000	貸付株式数	4,600株
ＵＡＣＪ	10,100	2,487.00	25,118,700	貸付株式数	3,800株 (3,800株)
ＣＫサンエツ	1,400	3,005.00	4,207,000		
古河電工	20,700	3,030.00	62,721,000		
住友電工	248,400	1,674.50	415,945,800		
フジクラ	80,300	459.00	36,857,700		

昭和電線ＨＬＤＧＳ	7,700	1,015.00	7,815,500		
東京特殊電線	1,000	2,237.00	2,237,000		
タツタ電線	13,200	587.00	7,748,400		
カナレ電気	1,100	1,879.00	2,066,900	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	2,500	1,354.00	3,385,000		
リョービ	8,200	2,103.00	17,244,600		
アーレステイ	8,700	534.00	4,645,800		
アサヒＨＤ	11,700	2,607.00	30,501,900		
東洋製罐グループＨＤ	42,300	1,942.00	82,146,600		
ホッカンホールディングス	3,600	1,960.00	7,056,000		
コロナ	3,700	1,190.00	4,403,000		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	12,400	1,891.00	23,448,400		
ＯＳＪＢ　ＨＤ	33,300	271.00	9,024,300		
駒井ハルテック	1,200	1,695.00	2,034,000		
高田機工	600	2,587.00	1,552,200	貸付株式数	200株
三和ホールディングス	63,700	1,220.00	77,714,000		
文化シヤッター	19,600	971.00	19,031,600	貸付株式数	7,600株
三協立山	9,200	1,248.00	11,481,600		
アルインコ	4,800	1,197.00	5,745,600		
東洋シヤッター	1,600	756.00	1,209,600		
ＬＩＸＩＬグループ	98,100	1,885.00	184,918,500		
日本フイルコン	5,000	530.00	2,650,000	貸付株式数	1,900株
ノーリツ	13,800	1,408.00	19,430,400		
長府製作所	6,800	2,461.00	16,734,800		
リンナイ	12,900	8,430.00	108,747,000		
ユニプレス	13,000	1,688.00	21,944,000		
ダイニチ工業	3,500	687.00	2,404,500		
日東精工	9,100	654.00	5,951,400	貸付株式数	1,600株
三洋工業	900	2,039.00	1,835,100		
岡　部	13,500	926.00	12,501,000	貸付株式数	200株
ジーテクト	8,300	1,736.00	14,408,800		
東　プ　レ	12,400	1,729.00	21,439,600		
高周波熱錬	12,700	887.00	11,264,900	貸付株式数	1,000株
東京製綱	4,800	1,156.00	5,548,800		
サンコール	3,700	489.00	1,809,300		
モリテックスチル	5,200	429.00	2,230,800		
パイオラックス	9,800	2,216.00	21,716,800	貸付株式数	500株
エイチワン	6,500	845.00	5,492,500	貸付株式数	600株
日本発条	71,300	982.00	70,016,600	貸付株式数	21,500株
中央発條	800	2,916.00	2,332,800		

アドバネクス	900	1,652.00	1,486,800		
三浦工業	28,700	3,695.00	106,046,500		
タ　ク　マ	22,500	1,278.00	28,755,000		
テクノプロ・ホールディング	12,900	7,480.00	96,492,000		
アトラ	1,500	392.00	588,000	貸付株式数	500株
インターワークス	1,300	522.00	678,600		
アイ・アールジャパンＨＤ	2,600	4,210.00	10,946,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
ＫｅｅＰｅｒ技研	2,300	1,369.00	3,148,700		
ファーストロジック	1,500	636.00	954,000	貸付株式数	400株
三機サービス	1,400	1,025.00	1,435,000	貸付株式数	100株
Ｇｕｎｏｓｙ	4,500	1,658.00	7,461,000	貸付株式数	1,700株
デザインワン・ジャパン	1,200	342.00	410,400	貸付株式数	400株
イー・ガーディアン	3,200	2,244.00	7,180,800	貸付株式数	1,200株
リブセンス	4,100	310.00	1,271,000	貸付株式数	1,600株 (300株)
ジャパンマテリアル	19,800	1,510.00	29,898,000	貸付株式数	2,600株
ベクトル	8,000	1,139.00	9,112,000	貸付株式数	3,100株
ウチヤマホールディングス	3,200	554.00	1,772,800		
チャームケアコーポレーション	2,100	1,953.00	4,101,300	貸付株式数	800株 (100株)
ライクキッズ	1,500	884.00	1,326,000	貸付株式数	500株
キャリアリンク	2,100	559.00	1,173,900	貸付株式数	800株
ＩＢＪ	4,300	1,076.00	4,626,800		
アサンテ	2,600	2,027.00	5,270,200	貸付株式数	900株
Ｎ・フィールド	4,400	703.00	3,093,200	貸付株式数	1,700株
バリューＨＲ	1,300	3,505.00	4,556,500	貸付株式数	400株
Ｍ＆Ａキャピタルパートナー	4,600	4,300.00	19,780,000		
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,400	1,942.00	4,660,800		
ＥＲＩホールディングス	1,800	800.00	1,440,000		
アビスト	1,000	2,688.00	2,688,000	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	4,400	2,251.00	9,904,400	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ウィルグループ	4,200	1,157.00	4,859,400	貸付株式数	1,500株
エスクローＡＪ	8,700	239.00	2,079,300	貸付株式数	3,400株

リクルートホールディングス	460,100	3,978.00	1,830,277,800		
エラン	3,800	1,710.00	6,498,000	貸付株式数	1,400株
ツ　ガ　ミ	13,700	1,131.00	15,494,700	貸付株式数	5,300株
オークマ	7,700	6,150.00	47,355,000		
東芝機械	7,500	2,801.00	21,007,500		
アマダホールディングス	84,300	1,247.00	105,122,100		
アイダエンジニア	17,900	1,002.00	17,935,800		
滝澤鉄工所	2,000	1,397.00	2,794,000		
ＦＵＪＩ	28,500	1,947.00	55,489,500	貸付株式数	11,000株
牧野フライス	7,800	5,410.00	42,198,000		
オーエスジー	30,700	2,257.00	69,289,900	貸付株式数	12,000株
ダイジェット	700	1,471.00	1,029,700		
旭ダイヤモンド	17,300	656.00	11,348,800		
ＤＭＧ森精機	42,100	1,753.00	73,801,300	貸付株式数	16,400株
ソディツク	15,600	1,022.00	15,943,200	貸付株式数	300株
ディスコ	9,000	23,550.00	211,950,000		
日東工器	3,600	2,227.00	8,017,200		
日進工具	1,900	2,325.00	4,417,500		
パンチ工業	5,900	574.00	3,386,600		
冨士ダイス	2,900	662.00	1,919,800		
土木管理総合試験	2,800	447.00	1,251,600	貸付株式数	1,000株
ネットマーケティング	2,300	1,068.00	2,456,400		
日本郵政	526,400	1,036.50	545,613,600		
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	10,800	1,719.00	18,565,200	貸付株式数	1,000株
鎌倉新書	4,800	1,928.00	9,254,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ＳＭＮ	1,000	911.00	911,000		
一蔵	700	750.00	525,000		
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,200	2,682.00	5,900,400	貸付株式数	500株
グローバルキッズＣＯＭＰ	900	755.00	679,500	貸付株式数	300株
エボラブルアジア	2,900	2,203.00	6,388,700		
アトラエ	1,700	3,835.00	6,519,500	貸付株式数	600株
ストライク	2,400	4,380.00	10,512,000		
ソラスト	17,700	1,307.00	23,133,900	貸付株式数	6,900株
セラク	2,000	796.00	1,592,000	貸付株式数	700株
インソース	3,100	3,435.00	10,648,500	貸付株式数	1,000株
豊田自動織機	54,400	6,470.00	351,968,000		
豊和工業	3,600	748.00	2,692,800	貸付株式数	300株

ＯＫＫ	2,800	678.00	1,898,400	貸付株式数	500株
石川製作所	1,600	1,347.00	2,155,200	貸付株式数	600株
東洋機械金属	4,700	573.00	2,693,100		
津田駒工業	1,300	1,295.00	1,683,500		
エンシュウ	1,600	1,366.00	2,185,600	貸付株式数	300株
島精機製作所	10,700	2,779.00	29,735,300	貸付株式数	4,100株
オプトラン	7,400	2,933.00	21,704,200	貸付株式数	2,600株
ＮＣホールディングス	2,000	614.00	1,228,000	貸付株式数	700株
イワキポンプ	3,100	1,146.00	3,552,600		
フリュー	6,400	1,050.00	6,720,000		
ヤマシンフィルタ	14,400	876.00	12,614,400	貸付株式数	4,100株 (2,100株)
日阪製作所	8,100	1,000.00	8,100,000		
やまびこ	12,900	1,141.00	14,718,900	貸付株式数	2,700株
平田機工	3,100	7,970.00	24,707,000	貸付株式数	1,200株
ペガサスミシン製造	6,700	513.00	3,437,100		
マルマエ	2,700	1,043.00	2,816,100	貸付株式数	1,000株
タツモ	3,100	1,198.00	3,713,800	貸付株式数	1,200株
ナブテスコ	39,200	3,410.00	133,672,000		
三井海洋開発	7,100	2,497.00	17,728,700		
レオン自動機	6,500	1,657.00	10,770,500	貸付株式数	100株
ＳＭＣ	21,100	49,930.00	1,053,523,000		
ヤマハモーターロボＨＬＤＧＳ	5,800	564.00	3,271,200	貸付株式数	1,800株
ホソカワミクロン	2,300	4,515.00	10,384,500		
ユニオンツール	2,500	3,290.00	8,225,000		
オイレス工業	8,600	1,692.00	14,551,200		
日精エーエスビー	2,200	4,895.00	10,769,000	貸付株式数	800株
サト－ホールディングス	9,500	3,370.00	32,015,000		
技研製作所	5,800	4,440.00	25,752,000		
日本エアーテック	2,100	707.00	1,484,700		
カ　ワ　タ	1,900	1,144.00	2,173,600	貸付株式数	700株
日精樹脂工業	5,500	1,026.00	5,643,000		
オカダアイヨン	2,100	1,239.00	2,601,900	貸付株式数	200株
ワイエイシイホールディングス	2,900	715.00	2,073,500	貸付株式数	1,100株
小松製作所	304,400	2,587.00	787,482,800	貸付株式数	117,000株
住友重機械	38,400	3,165.00	121,536,000		
日立建機	26,900	2,951.00	79,381,900	貸付株式数	7,600株
日　工	9,100	751.00	6,834,100		

巴工業	2,800	2,282.00	6,389,600		
井関農機	6,700	1,657.00	11,101,900	貸付株式数	2,400株
ＴＯＷＡ	6,800	1,150.00	7,820,000	貸付株式数	2,100株
丸山製作所	1,500	1,238.00	1,857,000		
北川鉄工所	3,000	2,268.00	6,804,000	貸付株式数	100株
シンニッタン	10,300	446.00	4,593,800		
ローツェ	2,900	3,925.00	11,382,500	貸付株式数	1,100株
タカキタ	2,300	556.00	1,278,800	貸付株式数	800株
クボタ	356,600	1,725.50	615,313,300		
荏原実業	1,700	2,266.00	3,852,200		
東洋エンジニア	8,900	722.00	6,425,800	貸付株式数	900株 (700株)
三菱化工機	2,300	1,906.00	4,383,800	貸付株式数	100株
月島機械	12,400	1,706.00	21,154,400		
帝国電機製作所	5,500	1,322.00	7,271,000		
東京機械	2,700	371.00	1,001,700	貸付株式数	400株
新東工業	15,800	1,038.00	16,400,400	貸付株式数	700株
渋谷工業	5,900	3,160.00	18,644,000	貸付株式数	2,200株
アイチ　コーポレーション	11,500	723.00	8,314,500	貸付株式数	4,400株
小森コーポレーション	16,900	1,161.00	19,620,900	貸付株式数	6,200株
鶴見製作所	5,200	2,056.00	10,691,200		
住友精密	1,000	3,450.00	3,450,000		
日本ギア工業	2,000	414.00	828,000	貸付株式数	700株
酒井重工業	1,300	3,065.00	3,984,500		
荏原製作所	29,600	3,345.00	99,012,000		
石井鉄工所	900	2,539.00	2,285,100		
酉島製作所	6,700	962.00	6,445,400	貸付株式数	900株
北越工業	6,900	1,278.00	8,818,200	貸付株式数	400株
ダイキン工業	85,600	15,770.00	1,349,912,000		
オルガノ	2,400	6,540.00	15,696,000	貸付株式数	700株
トーヨーカネツ	2,900	2,284.00	6,623,600		
栗田工業	36,300	3,135.00	113,800,500		
椿本チエイン	9,600	3,820.00	36,672,000		
大同工業	3,200	837.00	2,678,400		
日　機　装	20,100	1,348.00	27,094,800		
木村化工機	5,500	623.00	3,426,500	貸付株式数	2,100株
レイズネクスト	11,300	1,242.00	14,034,600		
アネスト岩田	10,400	1,016.00	10,566,400	貸付株式数	4,000株
ダイフク	34,300	6,590.00	226,037,000	貸付株式数	13,400株
サムコ	1,800	1,216.00	2,188,800		

加藤製作所	3,700	1,841.00	6,811,700		
油研工業	1,100	1,700.00	1,870,000		
タダノ	32,400	1,091.00	35,348,400	貸付株式数	12,600株
フジテック	24,400	1,745.00	42,578,000		
ＣＫＤ	18,700	1,855.00	34,688,500	貸付株式数	2,700株
キトー	5,100	1,651.00	8,420,100		
平和	18,800	2,269.00	42,657,200		
理想科学工業	5,900	1,893.00	11,168,700		
ＳＡＮＫＹＯ	15,000	3,720.00	55,800,000		
日本金銭機械	7,400	929.00	6,874,600	貸付株式数	600株
マースグループＨＬＤＧＳ	4,300	2,036.00	8,754,800	貸付株式数	200株
福島工業	4,200	3,500.00	14,700,000		
オーイズミ	2,800	575.00	1,610,000	貸付株式数	500株
ダイコク電機	3,100	1,682.00	5,214,200		
竹内製作所	11,200	1,692.00	18,950,400		
ア　マ　ノ	17,600	3,285.00	57,816,000		
ＪＵＫＩ	9,300	914.00	8,500,200	貸付株式数	2,700株
サンデンホールディングス	8,800	766.00	6,740,800	貸付株式数	2,900株 (2,900株)
蛇の目ミシン	6,300	409.00	2,576,700		
ブラザー工業	82,100	2,201.00	180,702,100	貸付株式数	32,100株
マックス	10,200	2,106.00	21,481,200		
モリタホールディングス	11,700	1,756.00	20,545,200		
グローリー	18,600	3,330.00	61,938,000		
新晃工業	6,300	1,891.00	11,913,300		
大和冷機工業	9,700	1,292.00	12,532,400		
セガサミーホールディングス	66,700	1,585.00	105,719,500		
日本ピストンリング	2,500	1,441.00	3,602,500		
リ　ケ　ン	3,100	4,295.00	13,314,500	貸付株式数	300株
ＴＰＲ	9,100	2,091.00	19,028,100	貸付株式数	2,700株
ツバキ・ナカシマ	13,700	1,716.00	23,509,200		
ホシザキ	19,700	9,610.00	189,317,000		
大豊工業	5,500	874.00	4,807,000	貸付株式数	800株
日本精工	126,600	1,077.00	136,348,200		
Ｎ　Ｔ　Ｎ	155,700	346.00	53,872,200		
ジェイテクト	64,400	1,384.00	89,129,600		
不　二　越	6,200	5,140.00	31,868,000	貸付株式数	2,400株
ミネベアミツミ	124,700	2,159.00	269,227,300		
日本トムソン	19,800	499.00	9,880,200		

Ｔ　Ｈ　Ｋ	39,100	3,120.00	121,992,000		
ユーシン精機	5,200	1,059.00	5,506,800		
前澤給装工業	2,400	2,147.00	5,152,800		
イーグル工業	8,400	1,086.00	9,122,400	貸付株式数	2,000株
前澤工業	4,400	391.00	1,720,400	貸付株式数	600株
日本ピラー工業	6,800	1,512.00	10,281,600		
キッツ	27,200	762.00	20,726,400	貸付株式数	400株
日　立	323,000	4,309.00	1,391,807,000		
三菱電機	672,200	1,534.50	1,031,490,900		
富士電機	40,500	3,425.00	138,712,500		
東洋電機製造	2,600	1,565.00	4,069,000	貸付株式数	500株
安川電機	72,300	4,065.00	293,899,500	貸付株式数	29,900株
シンフォニア　テクノロジー	8,700	1,377.00	11,979,900		
明　電　舎	12,400	2,148.00	26,635,200		
オリジン	1,800	1,517.00	2,730,600	貸付株式数	200株
山洋電気	3,200	5,460.00	17,472,000		
デンヨー	5,700	2,090.00	11,913,000		
ベイカレントコンサルティング	3,900	5,960.00	23,244,000	貸付株式数	1,200株
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	1,300	1,118.00	1,453,400	貸付株式数	400株
アイモバイル	2,000	713.00	1,426,000	貸付株式数	700株
キャリアインデックス	2,600	434.00	1,128,400	貸付株式数	1,000株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2,100	1,512.00	3,175,200	貸付株式数	100株
船場	1,000	1,146.00	1,146,000		
グレイステクノロジー	2,900	2,961.00	8,586,900	貸付株式数	1,100株
ジャパンエレベーターＳＨＤ	6,800	2,933.00	19,944,400		
フルテック	900	1,395.00	1,255,500	貸付株式数	300株 (300株)
グリーンズ	2,400	1,222.00	2,932,800	貸付株式数	900株
ツナググループＨＬＤＧＳ	800	618.00	494,400		
ソウルドアウト	1,000	1,775.00	1,775,000		
ＭＳ&ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	900	1,067.00	960,300		
日総工産	4,300	1,083.00	4,656,900		
キュービーネットＨＬＤＧＳ	3,900	2,498.00	9,742,200	貸付株式数	1,500株
ＲＰＡホールディングス	3,600	1,253.00	4,510,800	貸付株式数	1,400株

三桜工業	8,500	1,340.00	11,390,000	貸付株式数	3,300株
マキタ	87,600	3,705.00	324,558,000		
東芝テック	8,400	4,460.00	37,464,000		
芝浦メカトロニクス	1,200	3,970.00	4,764,000	貸付株式数	400株
マブチモーター	18,500	4,225.00	78,162,500	貸付株式数	2,000株
日本電産	80,900	16,325.00	1,320,692,500	貸付株式数	31,600株
ユーエムシーエレクトロニクス	4,000	548.00	2,192,000	貸付株式数	1,500株
トレックス・セミコンダクター	3,900	1,469.00	5,729,100	貸付株式数	200株
東光高岳	3,700	1,197.00	4,428,900		
ダブル・スコープ	10,100	833.00	8,413,300	貸付株式数	3,800株 (100株)
宮越ホールディングス	2,500	1,028.00	2,570,000	貸付株式数	900株
ダイヘン	7,400	3,695.00	27,343,000		
ヤーマン	9,800	702.00	6,879,600	貸付株式数	3,800株
ＪＶＣケンウッド	54,900	275.00	15,097,500		
ミマキエンジニアリング	6,000	528.00	3,168,000		
第一精工	2,400	2,645.00	6,348,000	貸付株式数	900株 (500株)
日新電機	15,800	1,152.00	18,201,600		
大崎電気	13,300	745.00	9,908,500		
オムロン	62,500	6,540.00	408,750,000		
日東工業	9,900	2,504.00	24,789,600		
ＩＤＥＣ	9,700	2,365.00	22,940,500	貸付株式数	2,400株
正興電機製作所	1,600	832.00	1,331,200	貸付株式数	600株
不二電機工業	800	1,275.00	1,020,000	貸付株式数	300株 (200株)
ジーエス・ユアサ　コーポ	22,400	2,304.00	51,609,600		
サクサホールディングス	1,500	1,978.00	2,967,000		
メルコホールディングス	2,300	3,100.00	7,130,000	貸付株式数	600株
テクノメディカ	1,500	2,101.00	3,151,500	貸付株式数	200株
日本電気	81,500	4,440.00	361,860,000	貸付株式数	13,200株
富　士　通	64,800	10,050.00	651,240,000		
沖　電　気	27,300	1,530.00	41,769,000		
岩崎通信機	2,900	805.00	2,334,500		
電気興業	3,200	3,115.00	9,968,000		
サンケン電気	7,300	3,170.00	23,141,000	貸付株式数	2,800株
ナカヨ	1,300	1,675.00	2,177,500		
アイホン	3,800	1,906.00	7,242,800		

ルネサスエレクトロニクス	320,700	719.00	230,583,300		
セイコーエプソン	83,400	1,662.00	138,610,800	貸付株式数	1,400株
ワコム	45,300	448.00	20,294,400		
アルバック	13,400	4,300.00	57,620,000	貸付株式数	200株
アクセル	2,800	706.00	1,976,800	貸付株式数	900株
ＥＩＺＯ	5,200	4,180.00	21,736,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	71.00	4,380,700	貸付株式数	55,600株
日本信号	17,100	1,304.00	22,298,400		
京三製作所	15,800	516.00	8,152,800	貸付株式数	300株
能美防災	8,900	2,383.00	21,208,700		
ホーチキ	4,900	1,667.00	8,168,300		
星和電機	3,400	558.00	1,897,200		
エレコム	7,300	4,145.00	30,258,500		
パナソニック	768,000	1,032.00	792,576,000		
シャープ	77,800	1,656.00	128,836,800	貸付株式数	30,400株
アンリツ	43,300	2,072.00	89,717,600	貸付株式数	16,900株
富士通ゼネラル	18,300	2,107.00	38,558,100	貸付株式数	7,300株
ソ　ニ　ー※	424,900	6,998.00	2,973,450,200		
Ｔ　Ｄ　Ｋ	32,400	11,690.00	378,756,000		
帝国通信工業	3,000	1,205.00	3,615,000	貸付株式数	400株
タムラ製作所	22,300	660.00	14,718,000	貸付株式数	2,800株
アルプスアルパイン	59,500	2,487.00	147,976,500		
池上通信機	2,100	1,046.00	2,196,600	貸付株式数	900株
日本電波工業	6,000	668.00	4,008,000	貸付株式数	2,000株
鈴木	3,600	816.00	2,937,600	貸付株式数	1,400株
日本トリム	900	4,960.00	4,464,000	貸付株式数	200株 (200株)
ローランド　ディー.ジー.	3,700	2,175.00	8,047,500	貸付株式数	1,400株
フオスター電機	7,000	2,023.00	14,161,000		
Ｓ　Ｍ　Ｋ	1,700	2,979.00	5,064,300		
ヨコオ	4,300	3,255.00	13,996,500	貸付株式数	600株
ティアック	4,900	231.00	1,131,900	貸付株式数	1,800株
ホシデン	18,300	1,318.00	24,119,400		
ヒロセ電機	10,400	13,710.00	142,584,000		
日本航空電子	15,400	2,104.00	32,401,600		
Ｔ　Ｏ　Ａ	7,200	1,100.00	7,920,000	貸付株式数	300株
マクセルホールディングス	14,500	1,494.00	21,663,000		
古野電気	8,700	1,263.00	10,988,100		
ユニデンホールディングス	1,800	1,837.00	3,306,600		

スミダコーポレーション	5,100	1,325.00	6,757,500	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
アイコム	3,700	2,588.00	9,575,600		
リオン	2,800	2,964.00	8,299,200	貸付株式数	400株
本多通信工業	5,700	545.00	3,106,500		
船井電機	6,800	740.00	5,032,000	貸付株式数	2,600株 (1,800株)
横河電機	61,700	2,014.00	124,263,800		
新電元工業	2,400	3,685.00	8,844,000		
アズビル	42,400	3,185.00	135,044,000	貸付株式数	1,000株
東亜ディーケーケー	3,300	860.00	2,838,000	貸付株式数	1,200株
日本光電工業	27,800	2,969.00	82,538,200		
チ　ノ　ー	2,300	1,422.00	3,270,600		
共和電業	7,000	443.00	3,101,000		
日本電子材料	2,700	868.00	2,343,600		
堀場製作所	13,300	7,350.00	97,755,000		
アドバンテスト	50,000	5,320.00	266,000,000	貸付株式数	7,700株
小野測器	2,800	537.00	1,503,600		
エスペック	5,900	2,132.00	12,578,800		
キーエンス	60,900	37,970.00	2,312,373,000		
日置電機	3,500	3,740.00	13,090,000	貸付株式数	200株
シスメックス	48,000	7,761.00	372,528,000		
日本マイクロニクス	11,700	1,154.00	13,501,800		
メガチップス	6,300	2,462.00	15,510,600	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,500	3,885.00	13,597,500		
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	5,600	644.00	3,606,400	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
澤藤電機	800	2,133.00	1,706,400	貸付株式数	300株
デンソー	148,000	4,953.00	733,044,000		
原田工業	3,200	975.00	3,120,000		
コーセル	8,100	1,251.00	10,133,100	貸付株式数	3,200株
イリソ電子工業	5,600	5,300.00	29,680,000	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	11,000	1,622.00	17,842,000	貸付株式数	1,800株
千代田インテグレ	3,100	2,395.00	7,424,500		
アイ・オー・データ	2,500	1,022.00	2,555,000		
レーザーテック	13,800	9,580.00	132,204,000	貸付株式数	4,900株
スタンレー電気	47,400	3,105.00	147,177,000		
岩崎電気	2,600	1,425.00	3,705,000	貸付株式数	200株
ウシオ電機	38,900	1,643.00	63,912,700	貸付株式数	15,200株

岡谷電機	5,200	381.00	1,981,200	貸付株式数	1,300株
ヘリオステクノＨ	6,100	500.00	3,050,000	貸付株式数	1,300株
エノモト	2,000	1,155.00	2,310,000		
日本セラミック	6,800	2,861.00	19,454,800		
遠藤照明	3,400	704.00	2,393,600		
古河電池	4,800	783.00	3,758,400		
双信電機	3,200	512.00	1,638,400	貸付株式数	1,100株
山一電機	4,800	1,595.00	7,656,000	貸付株式数	100株
図　研	4,400	2,510.00	11,044,000		
日本電子	13,300	3,090.00	41,097,000		
カ　シ　オ	59,500	2,080.00	123,760,000	貸付株式数	23,200株
ファナック	63,900	21,240.00	1,357,236,000		
日本シイエムケイ	15,700	658.00	10,330,600	貸付株式数	2,800株
エンプラス	3,400	3,650.00	12,410,000		
大真空	2,400	1,649.00	3,957,600	貸付株式数	300株
ロ　ー　ム	29,800	9,170.00	273,266,000		
浜松ホトニクス	48,200	4,455.00	214,731,000		
三井ハイテック	7,400	2,051.00	15,177,400	貸付株式数	300株 (200株)
新光電気工業	22,600	1,096.00	24,769,600		
京　セ　ラ	94,500	7,445.00	703,552,500		
協栄産業	800	1,540.00	1,232,000		
太陽誘電	29,900	2,975.00	88,952,500	貸付株式数	11,600株
村田製作所	197,500	6,529.00	1,289,477,500		
双葉電子工業	10,500	1,389.00	14,584,500		
日東電工	46,300	6,210.00	287,523,000		
北陸電気工業	2,700	1,124.00	3,034,800		
東海理化電機	17,700	2,163.00	38,285,100		
ニチコン	22,700	1,235.00	28,034,500		
日本ケミコン	5,100	2,081.00	10,613,100		
Ｋ　Ｏ　Ａ	10,100	1,440.00	14,544,000		
三井Ｅ＆ＳＨＤ	21,700	922.00	20,007,400		
日立造船	53,300	435.00	23,185,500	貸付株式数	3,000株
三菱重工業	112,600	4,244.00	477,874,400		
川崎重工業	52,300	2,481.00	129,756,300		
ＩＨＩ	48,400	2,584.00	125,065,600		
名村造船所	21,500	287.00	6,170,500	貸付株式数	8,400株
サノヤスホールディングス	8,000	181.00	1,448,000	貸付株式数	200株
スプリックス	2,200	1,260.00	2,772,000	貸付株式数	800株
日本車輌	2,400	3,175.00	7,620,000	貸付株式数	800株

三菱ロジスネクスト	10,500	1,226.00	12,873,000	貸付株式数	3,800株
近畿車輌	1,000	1,501.00	1,501,000	貸付株式数	200株
ＦＰＧ	20,800	1,069.00	22,235,200		
島根銀行	1,300	704.00	915,200	貸付株式数	300株 (300株)
じもとホールディングス	45,000	107.00	4,815,000		
全国保証	18,700	4,410.00	82,467,000		
めぶきフィナンシャルＧ	344,400	284.00	97,809,600	貸付株式数	134,800株
東京きらぼしＦＧ	9,000	1,532.00	13,788,000		
九州フィナンシャルＧ	108,900	493.00	53,687,700	貸付株式数	100株
かんぽ生命保険	23,500	1,876.00	44,086,000	貸付株式数	100株
ゆうちょ銀行	187,500	1,070.00	200,625,000		
富山第一銀行	15,900	346.00	5,501,400		
コンコルディア・フィナンシャル	389,900	447.00	174,285,300		
ジェイリース	1,800	324.00	583,200		
西日本フィナンシャルＨＤ	45,300	856.00	38,776,800		
マーキュリアインベストメント	2,900	742.00	2,151,800	貸付株式数	1,100株
イントラスト	2,300	699.00	1,607,700		
日本モーゲージサービス	1,300	1,624.00	2,111,200		
Ｃａｓａ	2,800	1,263.00	3,536,400		
アルヒ	10,500	2,515.00	26,407,500	貸付株式数	4,100株
プレミアグループ	3,600	2,336.00	8,409,600	貸付株式数	1,300株
日産自動車	792,800	688.30	545,684,240		
いすゞ自動車	194,800	1,290.50	251,389,400		
トヨタ自動車 ※	749,200	7,738.00	5,797,309,600		
日野自動車	84,000	1,102.00	92,568,000		
三菱自動車工業	249,200	496.00	123,603,200	貸付株式数	83,400株
エフテック	4,700	755.00	3,548,500		
レシップホールディングス	2,600	659.00	1,713,400		
ＧＭＢ	1,200	795.00	954,000		
ファルテック	1,200	1,260.00	1,512,000		
武蔵精密工業	15,000	1,523.00	22,845,000	貸付株式数	200株
日産車体	13,100	1,138.00	14,907,800	貸付株式数	4,400株
新明和工業	18,000	1,460.00	26,280,000		
極東開発工業	12,500	1,631.00	20,387,500		
日信工業	13,500	2,224.00	30,024,000		
トピー工業	5,600	2,084.00	11,670,400		
ティラド	2,400	2,035.00	4,884,000		

タチエス	11,000	1,442.00	15,862,000		
ＮＯＫ	36,100	1,729.00	62,416,900		
フタバ産業	18,800	826.00	15,528,800		
ＫＹＢ	7,500	3,315.00	24,862,500	貸付株式数	100株
市光工業	10,000	868.00	8,680,000		
大同メタル工業	13,000	728.00	9,464,000		
プレス工業	33,300	444.00	14,785,200		
ミクニ	8,600	345.00	2,967,000		
太平洋工業	14,100	1,513.00	21,333,300		
ケーヒン	15,300	2,572.00	39,351,600		
河西工業	9,100	873.00	7,944,300		
アイシン精機	55,400	4,245.00	235,173,000		
マツダ	197,900	977.00	193,348,300		
今仙電機製作所	6,300	941.00	5,928,300	貸付株式数	500株
本田技研	529,300	3,104.00	1,642,947,200		
スズキ	133,200	4,755.00	633,366,000		
ＳＵＢＡＲＵ	208,700	2,873.50	599,699,450		
安永	3,200	1,293.00	4,137,600	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	87,700	2,307.00	202,323,900		
ショーワ	15,700	2,277.00	35,748,900		
小糸製作所	40,300	5,700.00	229,710,000		
ＴＢＫ	8,000	431.00	3,448,000		
エクセディ	9,200	2,508.00	23,073,600		
ミツバ	12,400	741.00	9,188,400	貸付株式数	2,300株
豊田合成	21,700	2,604.00	56,506,800		
愛三工業	10,600	866.00	9,179,600		
盟和産業	1,000	1,122.00	1,122,000	貸付株式数	300株
日本プラスト	5,200	718.00	3,733,600	貸付株式数	2,000株
ヨロズ	6,300	1,446.00	9,109,800		
エフ・シー・シー	11,000	2,412.00	26,532,000		
新家工業	1,500	1,443.00	2,164,500		
シマノ	25,200	17,920.00	451,584,000	貸付株式数	9,600株
テイ・エス　テック	15,600	3,415.00	53,274,000		
関西みらいＦＧ	38,800	732.00	28,401,600	貸付株式数	1,000株
３３ＦＧ	6,200	1,708.00	10,589,600		
第四北越フィナンシャルＧ	11,500	3,005.00	34,557,500	貸付株式数	100株
ジャムコ	3,400	1,510.00	5,134,000	貸付株式数	400株
小野　建	5,900	1,348.00	7,953,200		
はるやまＨＬＤＧＳ	3,100	846.00	2,622,600		
南　陽	1,400	1,804.00	2,525,600		

ノ　ジ　マ	11,800	2,281.00	26,915,800	貸付株式数	200株
佐鳥電機	4,800	915.00	4,392,000	貸付株式数	1,100株
カッパ・クリエイト	9,300	1,465.00	13,624,500	貸付株式数	3,600株 (3,000株)
エコートレーディング	1,700	542.00	921,400	貸付株式数	500株
伯東	4,000	1,311.00	5,244,000		
コンドーテック	5,100	1,102.00	5,620,200		
中山福	3,800	540.00	2,052,000	貸付株式数	300株
ライトオン	4,900	633.00	3,101,700	貸付株式数	1,900株 (1,400株)
ナガイレーベン	9,600	2,561.00	24,585,600	貸付株式数	2,400株
ジーンズメイト	2,000	338.00	676,000	貸付株式数	700株
三菱食品	7,300	2,932.00	21,403,600		
良品計画	87,900	2,498.00	219,574,200	貸付株式数	32,900株
三城ホールディングス	6,900	287.00	1,980,300	貸付株式数	2,700株
松田産業	4,800	1,567.00	7,521,600		
第一興商	9,800	5,420.00	53,116,000		
メディパルＨＤ	71,400	2,372.00	169,360,800		
アドヴァン	10,100	1,308.00	13,210,800		
ＳＰＫ	1,400	2,850.00	3,990,000		
萩原電気ＨＬＤＧＳ	2,400	2,830.00	6,792,000	貸付株式数	800株
アルビス	2,500	2,293.00	5,732,500		
アズワン	4,300	9,560.00	41,108,000	貸付株式数	1,600株
スズデン	2,300	1,464.00	3,367,200	貸付株式数	800株
尾家産業	1,900	1,347.00	2,559,300	貸付株式数	800株
シモジマ	4,000	1,240.00	4,960,000		
ドウシシャ	6,200	1,810.00	11,222,000		
小津産業	1,400	1,807.00	2,529,800	貸付株式数	500株
コナカ	7,700	406.00	3,126,200	貸付株式数	400株
高速	3,900	1,184.00	4,617,600		
ハウス　ローゼ	800	1,671.00	1,336,800	貸付株式数	100株
Ｇ－７ホールディングス	1,900	4,500.00	8,550,000		
たけびし	2,300	1,461.00	3,360,300	貸付株式数	900株
イオン北海道	6,700	799.00	5,353,300	貸付株式数	200株
コ　ジ　マ	11,400	459.00	5,232,600		
ヒマラヤ	2,300	836.00	1,922,800	貸付株式数	900株
コーナン商事	9,400	2,548.00	23,951,200	貸付株式数	3,300株
ネットワンシステムズ	25,100	3,150.00	79,065,000		
エコス	2,400	1,683.00	4,039,200		
ワタミ	7,800	1,312.00	10,233,600	貸付株式数	2,000株

マルシェ	1,700	781.00	1,327,700	貸付株式数	600株
リックス	1,500	1,632.00	2,448,000	貸付株式数	300株
システムソフト	15,400	112.00	1,724,800		
パンパシフィックＨＤ	158,700	1,798.00	285,342,600		
丸文	6,000	604.00	3,624,000		
西松屋チェーン	14,500	1,005.00	14,572,500		
ゼンショーホールディングス	31,700	2,514.00	79,693,800		
ハピネット	5,500	1,432.00	7,876,000		
幸楽苑ホールディングス	4,200	2,117.00	8,891,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,400	1,044.00	1,461,600	貸付株式数	500株
橋本総業ＨＬＤＧＳ	1,300	1,763.00	2,291,900	貸付株式数	200株
日本ライフライン	19,600	1,544.00	30,262,400	貸付株式数	6,300株
サイゼリヤ	10,900	2,631.00	28,677,900	貸付株式数	4,100株
タカショー	3,200	500.00	1,600,000		
エクセル	1,900	1,256.00	2,386,400	貸付株式数	900株
ＶＴホールディングス	27,500	473.00	13,007,500	貸付株式数	800株
マルカ	2,300	2,298.00	5,285,400	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,600	3,335.00	18,676,000		
魚力	1,800	1,530.00	2,754,000		
ＩＤＯＭ	17,800	530.00	9,434,000	貸付株式数	6,900株 (2,100株)
日本エム・ディ・エム	3,900	2,327.00	9,075,300	貸付株式数	1,500株
ポプラ	1,900	531.00	1,008,900	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	1,700	2,324.00	3,950,800		
ユナイテッドアローズ	6,900	3,340.00	23,046,000		
進和	3,900	2,352.00	9,172,800	貸付株式数	1,300株
エスケイジャパン	1,400	466.00	652,400		
ダイトロン	2,800	1,697.00	4,751,600		
ハイデイ日高	9,500	2,187.00	20,776,500	貸付株式数	2,600株
シークス	8,400	1,554.00	13,053,600	貸付株式数	3,200株
京都きもの友禅	4,200	350.00	1,470,000	貸付株式数	1,500株
コロワイド	22,000	2,216.00	48,752,000	貸付株式数	7,900株
ピーシーデポコーポ	8,700	478.00	4,158,600	貸付株式数	3,400株
田中商事	2,100	713.00	1,497,300		
オーハシテクニカ	3,700	1,462.00	5,409,400		
壱番屋	4,700	5,280.00	24,816,000	貸付株式数	1,700株
白銅	2,300	1,448.00	3,330,400		

トップカルチャー	2,400	340.00	816,000	貸付株式数	800株 (600株)
ＰＬＡＮＴ	1,700	656.00	1,115,200	貸付株式数	500株
スギホールディングス	13,200	6,170.00	81,444,000	貸付株式数	5,500株
薬王堂ホールディングス	2,900	2,532.00	7,342,800	貸付株式数	900株
島津製作所	80,300	3,315.00	266,194,500		
Ｊ　Ｍ　Ｓ	5,600	743.00	4,160,800		
クボテック	1,700	437.00	742,900	貸付株式数	600株 (100株)
長野計器	4,900	783.00	3,836,700		
ブイ・テクノロジー	3,100	6,010.00	18,631,000	貸付株式数	1,100株
スター精密	10,500	1,549.00	16,264,500	貸付株式数	3,900株
東京計器	4,200	1,015.00	4,263,000		
愛知時計	900	4,305.00	3,874,500		
インターアクション	3,600	2,502.00	9,007,200	貸付株式数	100株
オーバル	6,000	252.00	1,512,000	貸付株式数	2,300株
東京精密	12,200	3,935.00	48,007,000	貸付株式数	1,400株
マニー	26,800	2,935.00	78,658,000	貸付株式数	10,400株
ニコン	108,800	1,506.00	163,852,800	貸付株式数	40,700株
トプコン	33,900	1,471.00	49,866,900		
オリンパス	372,000	1,634.00	607,848,000		
理研計器	5,900	2,325.00	13,717,500		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	11,700	7,600.00	88,920,000	貸付株式数	100株
キヤノン電子	7,000	2,075.00	14,525,000		
タムロン	5,400	2,529.00	13,656,600		
ＨＯＹＡ	135,300	10,025.00	1,356,382,500		
シ　ー　ド	2,900	1,079.00	3,129,100	貸付株式数	1,100株
ノーリツ鋼機	4,500	1,896.00	8,532,000	貸付株式数	1,700株
エー・アンド・デイ	6,100	803.00	4,898,300		
朝日インテック	57,000	3,195.00	182,115,000	貸付株式数	22,100株
キヤノン	361,800	3,046.00	1,102,042,800	貸付株式数	141,500株
リ　コ　ー	171,100	1,124.00	192,316,400		
シチズン時計	78,700	610.00	48,007,000	貸付株式数	28,000株
リズム時計	2,100	939.00	1,971,900		
大研医器	4,600	630.00	2,898,000		
メニコン	9,200	4,350.00	40,020,000		
シンシア	800	608.00	486,400	貸付株式数	200株
中本パックス	1,700	1,490.00	2,533,000	貸付株式数	100株
スノーピーク	3,000	1,096.00	3,288,000	貸付株式数	1,200株

パラマウントベッドＨＤ	7,100	4,310.00	30,601,000		
トランザクション	4,300	1,000.00	4,300,000		
ＳＨＯ‐ＢＩ	2,000	395.00	790,000	貸付株式数	300株
ニホンフラッシュ	3,100	2,819.00	8,738,900	貸付株式数	1,200株 (800株)
前田工繊	7,400	1,950.00	14,430,000	貸付株式数	2,700株
永大産業	8,700	341.00	2,966,700		
アートネイチャー	7,200	773.00	5,565,600		
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	69,500	6,688.00	464,816,000		
アイフィスジャパン	1,700	777.00	1,320,900	貸付株式数	100株
共立印刷	11,600	164.00	1,902,400		
ＳＨＯＥＩ	3,200	5,060.00	16,192,000	貸付株式数	1,200株
フランスベッドＨＬＤＧＳ	9,500	1,022.00	9,709,000		
マーベラス	10,000	758.00	7,580,000	貸付株式数	3,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	11,700	4,270.00	49,959,000		
萩原工業	3,700	1,617.00	5,982,900	貸付株式数	300株 (300株)
エイベックス	11,400	1,334.00	15,207,600		
トッパン・フォームズ	14,400	1,162.00	16,732,800		
フジシールインターナショナル	15,100	2,487.00	37,553,700	貸付株式数	1,800株
タカラトミー	30,100	1,345.00	40,484,500		
廣済堂	4,700	880.00	4,136,000		
エステールホールディングス	1,900	679.00	1,290,100		
アーク	26,100	97.00	2,531,700		
レック	7,200	1,300.00	9,360,000	貸付株式数	2,600株
タカノ	2,600	823.00	2,139,800		
三光合成	7,600	432.00	3,283,200	貸付株式数	500株
プロネクサス	5,800	1,206.00	6,994,800		
ホクシン	4,200	172.00	722,400	貸付株式数	100株
ウッドワン	2,300	1,189.00	2,734,700		
大建工業	4,600	1,974.00	9,080,400		
き　も　と	11,500	191.00	2,196,500		
凸版印刷	94,800	2,178.00	206,474,400		
大日本印刷	87,900	2,940.00	258,426,000		
共同印刷	2,100	2,950.00	6,195,000	貸付株式数	200株

ＮＩＳＳＨＡ	13,800	1,133.00	15,635,400	貸付株式数	5,300株 (2,200株)
光村印刷	600	1,769.00	1,061,400	貸付株式数	200株
藤森工業	6,000	3,530.00	21,180,000		
ヴィア・ホールディングス	8,100	667.00	5,402,700	貸付株式数	200株
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,200	1,702.00	5,446,400		
前澤化成工業	4,200	1,197.00	5,027,400		
未来工業	3,600	2,243.00	8,074,800		
アシックス	55,500	1,786.00	99,123,000	貸付株式数	22,800株
ツ　ツ　ミ	2,100	2,097.00	4,403,700		
ウェーブロックＨＬＤＧＳ	2,300	780.00	1,794,000	貸付株式数	400株
ジェイ　エス　ピー	4,000	1,905.00	7,620,000		
ニ　チ　ハ	9,400	2,777.00	26,103,800		
エフピコ	7,400	6,650.00	49,210,000	貸付株式数	400株 (400株)
小松ウオール工業	2,000	2,408.00	4,816,000		
ヤマハ	40,000	6,130.00	245,200,000		
河合楽器	2,100	3,675.00	7,717,500		
クリナップ	6,200	705.00	4,371,000		
ピジョン	40,600	5,070.00	205,842,000	貸付株式数	15,800株
天馬	4,500	2,012.00	9,054,000		
兼松サステック	400	1,780.00	712,000	貸付株式数	100株
キングジム	5,600	892.00	4,995,200		
象印マホービン	19,700	1,798.00	35,420,600	貸付株式数	7,700株
リンテック	16,000	2,463.00	39,408,000		
信越ポリマー	12,000	968.00	11,616,000		
東　リ	16,700	316.00	5,277,200		
イトーキ	14,300	517.00	7,393,100		
任　天　堂	41,200	43,240.00	1,781,488,000		
三菱鉛筆	11,100	1,737.00	19,280,700		
松　風	3,000	1,700.00	5,100,000	貸付株式数	1,100株
タカラスタンダード	13,900	2,007.00	27,897,300	貸付株式数	4,700株
コ　ク　ヨ	32,300	1,635.00	52,810,500		
ナカバヤシ	6,600	594.00	3,920,400		
ニ　フ　コ	24,600	3,050.00	75,030,000	貸付株式数	9,500株
立川ブラインド	2,900	1,437.00	4,167,300	貸付株式数	1,100株
グローブライド	3,000	2,703.00	8,109,000		
オカムラ	23,500	1,080.00	25,380,000	貸付株式数	7,300株
バルカー	5,400	2,624.00	14,169,600	貸付株式数	800株

ＭＵＴＯＨホールディングス	1,000	1,796.00	1,796,000		
伊　藤　忠	463,000	2,438.00	1,128,794,000	貸付株式数	127,400株
丸　紅	689,400	825.20	568,892,880		
スクロール	10,100	350.00	3,535,000		
高　島	1,100	1,721.00	1,893,100		
ヨンドシーホールディングス	6,700	2,613.00	17,507,100	貸付株式数	2,700株
三陽商会	3,500	1,407.00	4,924,500		
長瀬産業	37,100	1,628.00	60,398,800		
ナイガイ	2,500	441.00	1,102,500	貸付株式数	900株
蝶　理	4,200	1,974.00	8,290,800	貸付株式数	100株
豊田通商	73,900	3,885.00	287,101,500		
オンワードホールディングス	39,700	643.00	25,527,100		
三共生興	10,000	601.00	6,010,000		
兼　松	24,800	1,412.00	35,017,600		
美　津　濃	6,100	2,805.00	17,110,500		
ツカモトコーポレーション	1,200	1,084.00	1,300,800	貸付株式数	100株
ファミリーマート	52,900	2,601.00	137,592,900		
ルックホールディングス	2,200	1,233.00	2,712,600	貸付株式数	800株
三井物産	581,800	1,967.50	1,144,691,500		
日本紙パルプ	3,800	4,060.00	15,428,000		
東京エレクトロン	44,800	22,570.00	1,011,136,000		
日立ハイテクノロジーズ	23,000	7,170.00	164,910,000		
カメイ	8,600	1,227.00	10,552,200		
東都水産	900	2,662.00	2,395,800		
ＯＵＧホールディングス	1,000	2,719.00	2,719,000	貸付株式数	300株
スターゼン	2,500	4,405.00	11,012,500	貸付株式数	900株
セイコーＨＤ	9,500	2,816.00	26,752,000	貸付株式数	3,800株
山　善	25,900	1,045.00	27,065,500		
椿本興業	1,200	4,020.00	4,824,000		
住友商事	417,800	1,656.50	692,085,700		
日本ユニシス	20,600	3,595.00	74,057,000		
内田洋行	2,800	5,240.00	14,672,000		
三菱商事	464,500	2,907.50	1,350,533,750		
第一実業	3,200	3,715.00	11,888,000		
キヤノンマーケティングＪＰＮ	18,900	2,510.00	47,439,000	貸付株式数	5,900株
西華産業	3,700	1,409.00	5,213,300		

佐藤商事	5,400	912.00	4,924,800		
菱洋エレクトロ	6,800	2,046.00	13,912,800	貸付株式数	2,400株
東京産業	5,900	561.00	3,309,900	貸付株式数	1,100株
ユアサ商事	6,300	3,500.00	22,050,000		
神鋼商事	1,700	2,654.00	4,511,800		
小林産業	3,900	313.00	1,220,700		
阪和興業	12,400	2,840.00	35,216,000		
正栄食品	4,300	3,385.00	14,555,500		
カナデン	5,400	1,325.00	7,155,000		
菱電商事	4,800	1,655.00	7,944,000		
ニプロ	46,600	1,327.00	61,838,200	貸付株式数	16,700株
フルサト工業	3,600	1,646.00	5,925,600		
岩谷産業	14,700	3,675.00	54,022,500	貸付株式数	5,600株
すてきナイスグループ	2,500	1,090.00	2,725,000	貸付株式数	600株
昭光通商	2,300	717.00	1,649,100	貸付株式数	200株
ニチモウ	1,000	1,987.00	1,987,000	貸付株式数	300株
極東貿易	1,900	2,194.00	4,168,600		
イ　ワ　キ	8,600	476.00	4,093,600	貸付株式数	1,900株
兼松エレクトロニクス	3,600	3,425.00	12,330,000		
三愛石油	16,300	1,059.00	17,261,700		
稲畑産業	14,600	1,586.00	23,155,600		
ＧＳＩクレオス	1,600	1,118.00	1,788,800	貸付株式数	300株
明和産業	6,100	620.00	3,782,000		
クワザワ	2,400	606.00	1,454,400		
ゴールドウイン	11,900	7,940.00	94,486,000	貸付株式数	4,600株 (3,000株)
ユニ・チャーム	129,600	3,634.00	470,966,400	貸付株式数	51,200株
デサント	12,800	1,810.00	23,168,000		
キ　ン　グ	3,100	530.00	1,643,000		
ワ　キ　タ	14,100	1,095.00	15,439,500	貸付株式数	1,900株
ヤマトインターナシヨナル	4,100	396.00	1,623,600	貸付株式数	100株
東邦ホールディングス	21,200	2,537.00	53,784,400	貸付株式数	8,300株
サンゲツ	18,200	2,135.00	38,857,000		
ミツウロコグループ	9,700	1,420.00	13,774,000	貸付株式数	3,800株
シナネンホールディングス	2,700	1,932.00	5,216,400		
伊藤忠エネクス	14,700	895.00	13,156,500		
サンリオ	18,600	2,234.00	41,552,400	貸付株式数	7,200株
サンワ　テクノス	4,600	1,199.00	5,515,400	貸付株式数	100株
リョーサン	7,300	2,947.00	21,513,100		
新光商事	10,300	900.00	9,270,000		

トーホー	3,000	1,873.00	5,619,000	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
三信電気	3,500	1,700.00	5,950,000		
東陽テクニカ	7,600	1,140.00	8,664,000		
モスフード　サービス	8,700	3,070.00	26,709,000	貸付株式数	3,300株 (100株)
加賀電子	6,600	2,468.00	16,288,800		
三益半導体	5,900	2,012.00	11,870,800		
ソーダニツカ	6,800	611.00	4,154,800		
立花エレテック	4,800	1,758.00	8,438,400		
木曽路	8,600	2,880.00	24,768,000	貸付株式数	1,700株
ＳＲＳホールディングス	7,700	1,044.00	8,038,800	貸付株式数	3,000株
千　趣　会	12,000	432.00	5,184,000	貸付株式数	4,600株
タカキユー	5,000	189.00	945,000	貸付株式数	1,900株 (1,600株)
ケーヨー	13,600	539.00	7,330,400	貸付株式数	2,300株
上新電機	7,800	2,465.00	19,227,000		
日本瓦斯	10,500	3,440.00	36,120,000		
ロイヤルホールディングス	11,600	2,542.00	29,487,200	貸付株式数	4,500株
東　天　紅	500	1,250.00	625,000		
いなげや	8,200	1,480.00	12,136,000		
島　忠	13,900	3,005.00	41,769,500	貸付株式数	4,800株
チヨダ	7,000	1,617.00	11,319,000		
ライフコーポレーション	5,000	2,504.00	12,520,000		
リンガーハット	8,100	2,484.00	20,120,400	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ＭｒＭａｘＨＤ	9,100	499.00	4,540,900		
テンアライド	6,000	441.00	2,646,000	貸付株式数	2,300株
ＡＯＫＩホールディングス	13,200	1,134.00	14,968,800		
オークワ	10,400	1,443.00	15,007,200	貸付株式数	900株
コメリ	10,200	2,363.00	24,102,600		
青山商事	13,700	1,677.00	22,974,900		
しまむら	7,700	8,970.00	69,069,000		
はせがわ	3,500	402.00	1,407,000	貸付株式数	100株
高　島　屋	48,300	1,304.00	62,983,200		
松　屋	13,400	854.00	11,443,600	貸付株式数	2,500株
エイチ・ツー・オーリテイリング	31,400	1,233.00	38,716,200		
近鉄百貨店	2,500	3,610.00	9,025,000	貸付株式数	900株
パ　ル　コ	6,400	1,364.00	8,729,600		

丸井グループ	60,700	2,651.00	160,915,700	貸付株式数	21,500株
クレディセゾン	46,400	1,810.00	83,984,000		
アクシアル　リテイリング	5,500	3,870.00	21,285,000		
井　筒　屋	3,700	241.00	891,700		
イオン	254,800	2,265.00	577,122,000	貸付株式数	90,700株
イ　ズ　ミ	13,500	4,270.00	57,645,000		
フオーバル	2,900	1,059.00	3,071,100		
平　和　堂	13,500	2,115.00	28,552,500		
フ　ジ	8,000	1,971.00	15,768,000		
ヤオコー	7,500	5,110.00	38,325,000	貸付株式数	400株
ゼビオホールディングス	8,000	1,328.00	10,624,000		
ケーズホールディングス	63,900	1,366.00	87,287,400		
ＰＡＬＴＡＣ	10,600	5,400.00	57,240,000	貸付株式数	1,300株
三谷産業	8,700	346.00	3,010,200		
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,400	651.00	2,213,400		
日産東京販売ＨＤ	9,800	278.00	2,724,400		
新生銀行	48,700	1,717.00	83,617,900		
あおぞら銀行	39,600	2,818.00	111,592,800		
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ ※	4,564,700	582.10	2,657,111,870		
りそなホールディングス	728,000	466.80	339,830,400		
三井住友トラストＨＤ	125,400	4,195.00	526,053,000		
三井住友フィナンシャルＧ	458,600	4,008.00	1,838,068,800		
千葉銀行	227,900	624.00	142,209,600		
群馬銀行	130,200	390.00	50,778,000		
武蔵野銀行	9,800	1,961.00	19,217,800		
千葉興業銀行	18,300	344.00	6,295,200	貸付株式数	2,500株
筑波銀行	27,600	243.00	6,706,800		
七十七銀行	22,400	1,794.00	40,185,600		
青森銀行	5,200	2,831.00	14,721,200	貸付株式数	1,500株
秋田銀行	4,300	2,259.00	9,713,700		
山形銀行	7,500	1,659.00	12,442,500		
岩手銀行	4,400	2,965.00	13,046,000		
東邦銀行	59,500	278.00	16,541,000	貸付株式数	19,800株
東北銀行	3,100	1,034.00	3,205,400		
みちのく銀行	4,300	1,567.00	6,738,100	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ふくおかフィナンシャルＧ	55,900	2,092.00	116,942,800	貸付株式数	5,000株
静岡銀行	164,100	839.00	137,679,900		
十六銀行	8,300	2,662.00	22,094,600		

スルガ銀行	63,000	545.00	34,335,000	貸付株式数	15,200株 (7,000株)
八十二銀行	160,100	475.00	76,047,500	貸付株式数	15,000株
山梨中央銀行	7,700	1,154.00	8,885,800		
大垣共立銀行	13,100	2,550.00	33,405,000		
福井銀行	5,700	1,734.00	9,883,800		
北國銀行	6,800	3,510.00	23,868,000		
清水銀行	2,700	2,180.00	5,886,000		
富山銀行	1,300	2,641.00	3,433,300		
滋賀銀行	13,300	2,743.00	36,481,900	貸付株式数	5,100株
南都銀行	11,000	2,763.00	30,393,000		
百五銀行	60,000	354.00	21,240,000	貸付株式数	1,500株
京都銀行	23,700	4,580.00	108,546,000		
紀陽銀行	23,500	1,724.00	40,514,000	貸付株式数	2,100株
ほくほくフィナンシャルG	44,100	1,134.00	50,009,400		
広島銀行	98,100	545.00	53,464,500		
山陰合同銀行	39,400	687.00	27,067,800		
中国銀行	57,100	1,097.00	62,638,700	貸付株式数	22,300株
鳥取銀行	2,200	1,382.00	3,040,400		
伊予銀行	94,600	608.00	57,516,800	貸付株式数	2,100株
百十四銀行	7,100	2,258.00	16,031,800		
四国銀行	10,100	1,045.00	10,554,500	貸付株式数	200株
阿波銀行	10,800	2,706.00	29,224,800	貸付株式数	3,700株
大分銀行	3,800	2,854.00	10,845,200		
宮崎銀行	4,400	2,655.00	11,682,000		
佐賀銀行	4,000	1,740.00	6,960,000		
沖縄銀行	6,100	3,675.00	22,417,500		
琉球銀行	15,300	1,258.00	19,247,400	貸付株式数	2,500株
セブン銀行	221,300	341.00	75,463,300		
みずほフィナンシャルG	9,009,900	169.70	1,528,980,030		
高知銀行	2,500	933.00	2,332,500		
山口フィナンシャルG	82,800	757.00	62,679,600	貸付株式数	30,200株
芙蓉総合リース	7,000	7,230.00	50,610,000		
みずほリース	10,300	3,280.00	33,784,000		
東京センチュリー	13,300	5,990.00	79,667,000	貸付株式数	5,000株
ＳＢＩホールディングス	74,100	2,258.00	167,317,800	貸付株式数	30,300株
日本証券金融	29,200	543.00	15,855,600		
アイフル	101,100	252.00	25,477,200		
日本アジア投資	5,600	290.00	1,624,000	貸付株式数	2,100株
長野銀行	2,100	1,713.00	3,597,300		

名古屋銀行	5,300	3,390.00	17,967,000		
北洋銀行	100,000	241.00	24,100,000		
愛知銀行	2,400	3,845.00	9,228,000		
中京銀行	2,700	2,257.00	6,093,900	貸付株式数	200株
大光銀行	2,200	1,751.00	3,852,200		
愛媛銀行	9,300	1,224.00	11,383,200	貸付株式数	2,900株
トマト銀行	2,500	1,069.00	2,672,500		
京葉銀行	28,400	629.00	17,863,600	貸付株式数	4,500株
栃木銀行	31,800	231.00	7,345,800		
北日本銀行	2,100	2,195.00	4,609,500	貸付株式数	700株
東和銀行	11,700	888.00	10,389,600	貸付株式数	1,100株
福島銀行	6,200	303.00	1,878,600	貸付株式数	2,400株
大東銀行	3,400	631.00	2,145,400	貸付株式数	1,200株
リコーリース	5,200	3,910.00	20,332,000		
イオンフィナンシャルサービス	40,500	1,685.00	68,242,500		
ア　コ　ム	133,000	458.00	60,914,000		
ジャックス	7,300	2,696.00	19,680,800		
オ　リ　コ	179,500	162.00	29,079,000		
日立キャピタル	15,600	2,695.00	42,042,000		
アプラスフィナンシャル	32,500	93.00	3,022,500	貸付株式数	2,400株
オリックス	414,700	1,797.50	745,423,250	貸付株式数	170,000株
三菱ＵＦＪリース	168,200	705.00	118,581,000	貸付株式数	8,500株
ジャフコ	10,200	4,230.00	43,146,000	貸付株式数	100株
九州　リースサービス	3,200	602.00	1,926,400		
トモニホールディングス	51,300	419.00	21,494,700		
大和証券Ｇ本社	532,300	556.10	296,012,030		
野村ホールディングス	1,166,600	562.30	655,979,180	貸付株式数	448,200株
岡三証券グループ	56,700	406.00	23,020,200	貸付株式数	300株
丸三証券	19,700	547.00	10,775,900	貸付株式数	7,700株
東洋証券	23,600	173.00	4,082,800	貸付株式数	9,200株
東海東京ＨＤ	76,400	338.00	25,823,200	貸付株式数	29,200株
光世証券	1,600	677.00	1,083,200	貸付株式数	400株
水戸証券	19,200	283.00	5,433,600	貸付株式数	5,500株
いちよし証券	12,300	682.00	8,388,600		
松井証券	37,900	888.00	33,655,200		
ＳＯＭＰＯホールディングス	124,700	4,371.00	545,063,700		
だいこう証券ビジ	3,200	649.00	2,076,800		
日本取引所グループ	190,200	1,874.00	356,434,800		

マネックスG	50,100	281.00	14,078,100	貸付株式数	19,500株
極東証券	8,900	785.00	6,986,500		
岩井コスモホールディング	6,300	1,282.00	8,076,600	貸付株式数	1,200株
藍澤證券	11,900	738.00	8,782,200	貸付株式数	1,100株
フィデアホール	64,900	134.00	8,696,600		
池田泉州ＨＤ	76,600	203.00	15,549,800		
アニコム　ホールディングス	5,500	3,585.00	19,717,500	貸付株式数	1,900株
ＭＳ＆ＡＤ	173,400	3,560.00	617,304,000		
ＳＯＮＹ　ＦＨ	54,500	2,573.00	140,228,500		
マネーパートナーズＧＰ	7,000	250.00	1,750,000	貸付株式数	1,900株
スパークス・グループ	22,900	249.00	5,702,100		
小林洋行	1,900	267.00	507,300		
第一生命ＨＬＤＧＳ	375,200	1,761.50	660,914,800		
東京海上ＨＤ	237,100	6,020.00	1,427,342,000	貸付株式数	91,100株
アドバンテッジリスクマネ	3,200	990.00	3,168,000	貸付株式数	900株
イー・ギャランティ	7,100	1,416.00	10,053,600	貸付株式数	2,300株
アサックス	3,400	653.00	2,220,200	貸付株式数	1,300株
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,700	2,463.00	6,650,100		
Ｔ＆Ｄホールディングス	205,100	1,295.00	265,604,500		
アドバンスクリエイト	1,600	1,864.00	2,982,400		
三井不動産	331,000	2,731.50	904,126,500		
三菱地所	464,500	2,010.00	933,645,000		
平和不動産	12,200	2,614.00	31,890,800		
東京建物	72,500	1,653.00	119,842,500		
ダイビル	17,100	1,172.00	20,041,200		
京阪神ビルディング	10,800	1,437.00	15,519,600	貸付株式数	1,000株
住友不動産	149,000	3,839.00	572,011,000		
太平洋興発	2,600	808.00	2,100,800	貸付株式数	200株
テーオーシー	13,000	895.00	11,635,000		
東京楽天地	1,100	6,140.00	6,754,000		
スターツコーポレーション	9,000	2,691.00	24,219,000		
フジ住宅	7,700	711.00	5,474,700		
空港施設	6,700	540.00	3,618,000		
明和地所	3,600	589.00	2,120,400		
ゴールドクレスト	5,200	2,162.00	11,242,400	貸付株式数	2,000株
リログループ	35,100	2,986.00	104,808,600	貸付株式数	13,700株
エスリード	2,600	2,171.00	5,644,600		
日神不動産	9,900	496.00	4,910,400		

日本エスコン	12,000	989.00	11,868,000	貸付株式数	1,600株
タカラレーベン	30,300	489.00	14,816,700		
サンヨーハウジ　名古屋	3,700	995.00	3,681,500	貸付株式数	800株
イオンモール	33,200	1,775.00	58,930,000		
毎日コムネット	1,400	832.00	1,164,800		
ファースト住建	2,800	1,319.00	3,693,200		
ランド	359,700	12.00	4,316,400	貸付株式数	36,900株
カチタス	8,200	4,920.00	40,344,000	貸付株式数	500株 (500株)
東祥	4,000	2,454.00	9,816,000	貸付株式数	1,500株
トーセイ	9,100	1,333.00	12,130,300	貸付株式数	100株
穴吹興産	700	3,280.00	2,296,000		
サンフロンティア不動産	9,200	1,274.00	11,720,800		
インテリックス	1,900	711.00	1,350,900		
ランドビジネス	2,800	761.00	2,130,800		
日本社宅サービス	1,700	1,107.00	1,881,900	貸付株式数	400株
グランディハウス	5,100	470.00	2,397,000	貸付株式数	300株
東武鉄道	70,900	4,055.00	287,499,500		
相鉄ホールディングス	21,500	3,040.00	65,360,000		
東急	169,500	2,177.00	369,001,500		
京浜急行	86,300	2,242.00	193,484,600		
小田急電鉄	100,000	2,708.00	270,800,000		
京王電鉄	34,900	7,060.00	246,394,000		
京成電鉄	46,800	4,535.00	212,238,000		
富士急行	9,200	4,265.00	39,238,000	貸付株式数	3,500株 (900株)
新京成電鉄	1,800	2,303.00	4,145,400		
東日本旅客鉄道	118,300	10,085.00	1,193,055,500		
西日本旅客鉄道	59,900	9,675.00	579,532,500		
東海旅客鉄道	55,900	22,245.00	1,243,495,500		
西武ホールディングス	90,200	1,930.00	174,086,000		
鴻池運輸	10,700	1,663.00	17,794,100		
西日本鉄道	18,700	2,629.00	49,162,300		
ハマキョウレックス	5,200	3,665.00	19,058,000		
サカイ引越センター	3,500	6,970.00	24,395,000	貸付株式数	100株
近鉄グループＨＬＤＧＳ	63,700	6,150.00	391,755,000		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	84,900	4,745.00	402,850,500		
南海電鉄	30,200	3,040.00	91,808,000		
京阪ホールディングス	28,300	5,450.00	154,235,000	貸付株式数	2,200株
神戸電鉄	1,600	3,990.00	6,384,000	貸付株式数	100株

名古屋鉄道	52,400	3,495.00	183,138,000	貸付株式数	15,600株
山陽電鉄	4,600	2,248.00	10,340,800		
トランコム	1,800	7,800.00	14,040,000		
日本通運	22,500	7,010.00	157,725,000	貸付株式数	8,100株
ヤマトホールディングス	111,600	1,901.00	212,151,600		
山　九	17,700	5,690.00	100,713,000		
日　新	5,500	1,743.00	9,586,500		
丸　運	3,600	274.00	986,400	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	5,200	3,110.00	16,172,000		
センコーグループＨＬＤＧＳ	35,200	917.00	32,278,400		
トナミホールディングス	1,500	5,120.00	7,680,000		
ニッコンホールディングス	22,800	2,730.00	62,244,000		
日石輸送	700	2,781.00	1,946,700		
福山通運	8,100	4,185.00	33,898,500	貸付株式数	2,600株
セイノーホールディングス	47,700	1,479.00	70,548,300		
エスライン	1,900	997.00	1,894,300	貸付株式数	100株
神奈川中央交通	1,600	4,015.00	6,424,000		
日立物流	11,700	3,110.00	36,387,000	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
丸和運輸機関	6,700	2,570.00	17,219,000	貸付株式数	1,800株 (1,600株)
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	6,400	1,408.00	9,011,200		
日本郵船	53,300	1,925.00	102,602,500		
商船三井	40,300	2,942.00	118,562,600	貸付株式数	5,000株
川崎汽船	19,600	1,879.00	36,828,400	貸付株式数	7,600株
ＮＳユナイテッド海運	3,500	2,319.00	8,116,500		
明治海運	6,700	342.00	2,291,400		
飯野海運	30,400	360.00	10,944,000		
共栄タンカー	600	1,778.00	1,066,800		
九州旅客鉄道	56,800	3,780.00	214,704,000		
ＳＧホールディングス	66,800	2,633.00	175,884,400		
日本航空	116,600	3,391.00	395,390,600		
ＡＮＡホールディングス	116,400	3,758.00	437,431,200		
パスコ	1,200	1,860.00	2,232,000		
西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,200	3,915.00	4,698,000	貸付株式数	400株
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	600	1,502.00	901,200		

ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	3,200	2,539.00	8,124,800	貸付株式数	1,200株
国際紙パルプ商事	15,700	301.00	4,725,700		
総合メディカルＨＤ	5,800	2,065.00	11,977,000		
ブックオフＧＨＤ	3,800	1,066.00	4,050,800	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,200	2,835.00	57,267,000		
三井倉庫ＨＯＬＤ	7,300	1,999.00	14,592,700		
住友倉庫	23,500	1,510.00	35,485,000		
渋沢倉庫	3,500	2,149.00	7,521,500		
ヤマタネ	3,300	1,504.00	4,963,200	貸付株式数	1,000株
東陽倉庫	11,300	336.00	3,796,800		
乾汽船	3,700	1,148.00	4,247,600	貸付株式数	2,000株
日本トランスシティ	14,100	548.00	7,726,800	貸付株式数	1,000株
ケイヒン	1,200	1,328.00	1,593,600		
中央倉庫	3,900	1,238.00	4,828,200	貸付株式数	100株
川西倉庫	1,200	1,054.00	1,264,800		
安田倉庫	5,200	995.00	5,174,000		
ファイズホールディングス	1,300	640.00	832,000	貸付株式数	200株
東洋埠頭	1,900	1,412.00	2,682,800		
宇徳	5,400	537.00	2,899,800		
上　組	36,400	2,444.00	88,961,600		
サンリツ	1,500	700.00	1,050,000	貸付株式数	500株
キムラユニティー	1,700	1,102.00	1,873,400		
キユーソー流通システム	1,600	1,877.00	3,003,200	貸付株式数	600株 (300株)
近鉄エクスプレス	13,500	1,944.00	26,244,000	貸付株式数	3,500株
東海運	3,600	283.00	1,018,800	貸付株式数	100株
エーアイテイー	4,500	968.00	4,356,000		
内外トランスライン	2,200	1,471.00	3,236,200	貸付株式数	800株
ショーエイコーポ	700	736.00	515,200	貸付株式数	200株
日本コンセプト	2,000	1,430.00	2,860,000	貸付株式数	200株
東京放送ＨＤ	40,100	1,750.00	70,175,000		
日本テレビＨＬＤＳ	55,100	1,452.00	80,005,200		
朝日放送グループＨＤ	6,600	749.00	4,943,400	貸付株式数	300株
テレビ朝日ＨＤ	18,100	1,769.00	32,018,900		
スカパーＪＳＡＴＨＤ	43,500	464.00	20,184,000	貸付株式数	1,200株
テレビ東京ＨＤ	5,400	2,303.00	12,436,200		
日本ＢＳ放送	2,200	1,084.00	2,384,800	貸付株式数	700株 (700株)
ビジョン	6,100	1,793.00	10,937,300	貸付株式数	2,200株

スマートバリュー	1,900	814.00	1,546,600	貸付株式数	700株
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	2,500	1,111.00	2,777,500	貸付株式数	900株
ワイヤレスゲート	3,100	659.00	2,042,900	貸付株式数	1,200株
コネクシオ	3,800	1,525.00	5,795,000		
日本通信	51,100	220.00	11,242,000	貸付株式数	22,900株 (1,000株)
クロップス	1,200	750.00	900,000		
日本電信電話	440,900	5,598.00	2,468,158,200		
ＫＤＤＩ	491,600	3,150.00	1,548,540,000		
ソフトバンク	599,600	1,483.50	889,506,600	貸付株式数	234,400株
光通信	6,800	25,880.00	175,984,000		
ＮＴＴドコモ	487,300	3,007.00	1,465,311,100	貸付株式数	190,500株
エムティーアイ	6,400	692.00	4,428,800	貸付株式数	1,100株
ＧＭＯインターネット	26,000	2,269.00	58,994,000		
ファイバーゲート	1,300	1,385.00	1,800,500	貸付株式数	400株
アイドママーケティングコミュ	2,000	727.00	1,454,000		
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	17,800	1,776.00	31,612,800		
学研ホールディングス	2,200	7,490.00	16,478,000		
ゼンリン	13,100	1,907.00	24,981,700	貸付株式数	4,000株
昭文社	3,100	421.00	1,305,100		
インプレスホールディングス	5,300	183.00	969,900		
東京電力ＨＤ	536,700	483.00	259,226,100	貸付株式数	1,900株
中部電力	205,600	1,535.50	315,698,800		
関西電力	254,700	1,251.00	318,629,700		
中国電力	93,000	1,456.00	135,408,000	貸付株式数	36,300株
北陸電力	61,600	790.00	48,664,000		
東北電力	168,000	1,105.00	185,640,000		
四国電力	60,600	1,059.00	64,175,400		
九州電力	138,700	971.00	134,677,700		
北海道電力	63,000	532.00	33,516,000		
沖縄電力	12,500	2,003.00	25,037,500		
電源開発	53,500	2,678.00	143,273,000		
エフオン	3,100	785.00	2,433,500	貸付株式数	1,200株
イーレックス	9,500	1,747.00	16,596,500	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
レノバ	11,100	1,160.00	12,876,000		
東京瓦斯	129,200	2,653.00	342,767,600		

大阪瓦斯	130,400	2,077.00	270,840,800		
東邦瓦斯	33,300	4,170.00	138,861,000		
北海道瓦斯	3,600	1,586.00	5,709,600	貸付株式数	400株
広島ガス	14,100	359.00	5,061,900		
西部瓦斯	7,600	2,520.00	19,152,000		
静岡ガス	19,100	928.00	17,724,800	貸付株式数	100株
メタウォーター	3,200	4,070.00	13,024,000	貸付株式数	1,000株
アイネット	3,400	1,525.00	5,185,000		
松　竹	4,400	16,230.00	71,412,000	貸付株式数	1,600株
東　宝	39,400	4,465.00	175,921,000	貸付株式数	14,700株
エイチ・アイ・エス	10,000	3,070.00	30,700,000	貸付株式数	3,900株
東　映	2,500	17,170.00	42,925,000	貸付株式数	700株
ラックランド	1,300	2,450.00	3,185,000	貸付株式数	400株
ＮＴＴデータ	175,600	1,518.00	266,560,800		
共立メンテナンス	10,600	5,200.00	55,120,000	貸付株式数	4,100株 (1,300株)
イチネンホールディングス	7,200	1,415.00	10,188,000	貸付株式数	1,400株
建設技術研究所	4,400	2,030.00	8,932,000		
スペース	4,100	1,317.00	5,399,700		
長　大	2,400	1,181.00	2,834,400		
アインホールディングス	8,900	6,880.00	61,232,000	貸付株式数	3,400株
燦ホールディングス	2,800	1,348.00	3,774,400		
ピー・シー・エー	800	4,480.00	3,584,000	貸付株式数	300株
スバル興業	400	7,880.00	3,152,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,500	1,393.00	3,482,500	貸付株式数	900株
タナベ経営	1,200	1,279.00	1,534,800	貸付株式数	100株
ビジネスＢ太田昭和	1,100	2,377.00	2,614,700	貸付株式数	200株
ナ　ガ　ワ	2,000	7,530.00	15,060,000	貸付株式数	200株
よみうりランド	1,400	4,540.00	6,356,000		
東京都競馬	4,200	3,475.00	14,595,000	貸付株式数	1,600株
常磐興産	2,600	1,667.00	4,334,200	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,500	3,165.00	33,232,500	貸付株式数	4,100株
東京ドーム	26,100	1,013.00	26,439,300	貸付株式数	8,600株
ＤＴＳ	14,700	2,352.00	34,574,400		
スクウェア・エニックス・ＨＤ	28,100	5,470.00	153,707,000		
シーイーシー	7,100	2,261.00	16,053,100		
カプコン	31,100	2,623.00	81,575,300		
西尾レントオール	6,500	3,085.00	20,052,500		
アイ・エス・ビー	1,300	1,995.00	2,593,500		

アゴーラ・ホスピタリティーG	41,500	34.00	1,411,000		
日本空港ビルデング	21,200	5,830.00	123,596,000	貸付株式数	8,200株
トランス・コスモス	6,100	2,874.00	17,531,400		
乃村工藝社	27,500	1,410.00	38,775,000		
ジャステック	4,200	1,120.00	4,704,000		
ＳＣＳＫ	15,200	5,770.00	87,704,000		
藤田観光	2,800	2,868.00	8,030,400	貸付株式数	100株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	4,000	1,511.00	6,044,000		
日本管財	6,900	1,951.00	13,461,900		
トーカイ	6,200	2,869.00	17,787,800		
白　洋　舎	700	2,864.00	2,004,800	貸付株式数	200株
セコム	68,100	9,486.00	645,996,600		
日本システムウエア	2,200	2,574.00	5,662,800		
セントラル警備保障	3,100	6,460.00	20,026,000	貸付株式数	1,200株
アイネス	6,500	1,365.00	8,872,500		
丹青社	12,100	1,232.00	14,907,200		
メイテツク	7,900	5,830.00	46,057,000		
ＴＫＣ	5,600	5,130.00	28,728,000		
富士ソフト	8,400	4,275.00	35,910,000		
応用地質	6,900	1,400.00	9,660,000		
船井総研ホールディン	13,300	2,546.00	33,861,800		
ＮＳＤ	10,800	3,590.00	38,772,000		
進学会ホールディングス	2,500	533.00	1,332,500	貸付株式数	100株
丸紅建材リース	700	1,756.00	1,229,200	貸付株式数	200株
オ　オ　バ	5,000	798.00	3,990,000	貸付株式数	1,900株
コナミホールディングス	24,000	4,860.00	116,640,000	貸付株式数	800株
いであ	1,200	2,320.00	2,784,000	貸付株式数	400株
学　究　社	1,900	1,332.00	2,530,800		
ベネッセホールディングス	21,400	2,908.00	62,231,200		
イオンディライト	7,900	3,870.00	30,573,000		
ナック	3,600	1,056.00	3,801,600		
福井コンピュータＨＬＤＳ	2,600	3,875.00	10,075,000	貸付株式数	900株 (800株)
ニチイ学館	9,200	1,621.00	14,913,200		
ダイセキ	10,800	3,260.00	35,208,000	貸付株式数	4,100株
ステップ	2,300	1,567.00	3,604,100		
日鉄物産	4,800	5,070.00	24,336,000		
泉州電業	2,000	2,919.00	5,838,000		

元気寿司	1,700	2,994.00	5,089,800		
トラスコ中山	13,800	2,799.00	38,626,200	貸付株式数	5,300株
ヤマダ電機	201,700	557.00	112,346,900		
オートバックスセブン	24,500	1,801.00	44,124,500	貸付株式数	2,100株
モリト	4,800	800.00	3,840,000		
アークランドサカモト	10,300	1,281.00	13,194,300		
ニトリホールディングス	28,700	17,260.00	495,362,000		
グルメ杵屋	4,700	1,195.00	5,616,500		
愛　眼	5,200	247.00	1,284,400		
ケーユーホールディングス	3,500	931.00	3,258,500		
吉野家ホールディングス	21,700	2,756.00	59,805,200	貸付株式数	6,600株 (5,200株)
加藤産業	10,400	3,665.00	38,116,000		
北恵	1,200	918.00	1,101,600		
イノテック	3,900	1,052.00	4,102,800		
イエローハット	12,500	2,004.00	25,050,000		
松屋フーズＨＬＤＧＳ	3,200	4,510.00	14,432,000		
ＪＢＣＣホールディングス	4,500	1,863.00	8,383,500	貸付株式数	300株
ＪＫホールディングス	6,100	647.00	3,946,700		
サガミホールディングス	8,800	1,376.00	12,108,800	貸付株式数	100株
日　伝	5,900	2,096.00	12,366,400		
関西スーパーマーケット	5,500	1,086.00	5,973,000	貸付株式数	200株
ミロク情報サービス	5,800	3,385.00	19,633,000	貸付株式数	2,400株 (100株)
北沢産業	5,000	288.00	1,440,000	貸付株式数	1,100株
杉本商事	3,500	2,005.00	7,017,500	貸付株式数	400株
因幡電機産業	18,800	2,671.00	50,214,800		
王将フードサービス	4,900	6,620.00	32,438,000		
プレナス	7,400	1,936.00	14,326,400	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,900	1,472.00	7,212,800	貸付株式数	1,800株
アークス	13,600	2,284.00	31,062,400		
バローホールディングス	14,700	2,064.00	30,340,800		
東　テ　ク	2,200	2,426.00	5,337,200		
ミスミグループ本社	82,900	2,738.00	226,980,200		
藤　　久	500	817.00	408,500	貸付株式数	100株
アルテック	5,200	229.00	1,190,800		
ベ　ル　ク	3,300	5,230.00	17,259,000		
大　庄	3,500	1,605.00	5,617,500	貸付株式数	100株
タキヒヨー	2,000	1,938.00	3,876,000		

ファーストリテイリング	8,900	67,800.00	603,420,000	貸付株式数	3,300株
ソフトバンクグループ	523,500	4,236.00	2,217,546,000	貸付株式数	40,600株
蔵王産業	1,300	1,444.00	1,877,200		
スズケン	28,000	4,890.00	136,920,000		
サンドラッグ	24,900	3,870.00	96,363,000		
サックスバーホールディング	5,600	905.00	5,068,000		
ジェコス	4,600	955.00	4,393,000	貸付株式数	600株
ヤマザワ	1,500	1,666.00	2,499,000	貸付株式数	400株
や　ま　や	1,400	2,207.00	3,089,800	貸付株式数	500株
グローセル	6,700	456.00	3,055,200		
ベルーナ	14,300	712.00	10,181,600		
合計			162,602,439,840		

（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。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		

流動資産		
金銭信託	77,483,707	―
コール・ローン	150,687,784	277,498,394
国債証券	67,198,735,300	71,946,332,660
地方債証券	4,305,812,600	4,253,511,900
特殊債券	3,325,811,500	3,020,630,000
社債券	3,306,672,600	2,898,205,400
未収入金	202,835,000	1,861,375,540
未収利息	193,828,008	188,754,567
前払費用	4,802,646	12,421,243
流動資産合計	78,766,669,145	84,458,729,704
資産合計	78,766,669,145	84,458,729,704
負債の部		
流動負債		
未払金	―	1,951,218,000
未払解約金	276,774,272	19,276,281
その他未払費用	2,408	134
流動負債合計	276,776,680	1,970,494,415
負債合計	276,776,680	1,970,494,415
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	56,170,487,793	57,670,399,195
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	22,319,404,672	24,817,836,094
元本等合計	78,489,892,465	82,488,235,289
純資産合計	78,489,892,465	82,488,235,289
負債純資産合計	78,766,669,145	84,458,729,704

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2018年12月1日 至　2019年12月2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11月30日現在	2019年12月2日現在
1. ※1　期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	48,889,824,254円	56,170,487,793円
期中追加設定元本額	15,940,542,707円	19,864,910,379円
期中一部解約元本額	8,659,879,168円	18,364,998,977円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	129,097,081円	109,396,910円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	795,274,382円	596,838,676円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	105,597,525円	82,263,337円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,111,264,823円	882,267,553円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	5,920,239,246円	7,293,354,645円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	13,051,578,465円	11,302,866,367円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,124,813,517円	1,855,649,526円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	293,362,664円	265,692,526円

ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	405,138,528円	369,416,535円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	62,288,888円	81,822,975円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	19,210,529,646円	21,258,481,478円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	2,623,576,618円	3,005,941,387円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	1,545,313,319円	1,491,311,778円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,266,064,865円	1,129,962,205円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,443,095,280円	6,866,925,426円
ダイワライフスタイル２５	452,397,864円	450,390,874円
ダイワライフスタイル５０	492,380,016円	491,002,347円
ダイワライフスタイル７５	138,475,066円	136,814,650円
計	56,170,487,793円	57,670,399,195円
2. 期末日における受益権の総数	56,170,487,793口	57,670,399,195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12月1日 至 2019年12月2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12月2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11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年12月2日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△389,359,740	772,340,790
地方債証券	△24,799,600	2,883,500
特殊債券	△18,142,200	△5,121,500
社債券	△16,426,800	3,077,600
合計	△448,728,340	773,180,390

（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11月30日まで、及び2018年12月1日から2019年12月2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11月30日現在	2019年12月2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11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3974円 (13,974円)	1.4303円 (14,303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	３９８　２年国債	250,000,000	250,822,500	
	３９９　２年国債	100,000,000	100,358,000	
	４００　２年国債	200,000,000	200,762,000	
	４０２　２年国債	150,000,000	150,651,000	
	４０５　２年国債	150,000,000	150,756,000	
	４０６　２年国債	700,000,000	703,689,000	
	１２７　５年国債	1,580,000,000	1,585,308,800	
	１２８　５年国債	1,000,000,000	1,004,180,000	
	１２９　５年国債	1,340,000,000	1,346,633,000	
	１３０　５年国債	580,000,000	583,271,200	
	１３１　５年国債	1,170,000,000	1,177,534,800	
	１３２　５年国債	880,000,000	886,292,000	
	１３３　５年国債	430,000,000	433,689,400	
	１３４　５年国債	350,000,000	353,164,000	
	１３５　５年国債	880,000,000	888,456,800	
	１３６　５年国債	700,000,000	707,245,000	
	１３７　５年国債	700,000,000	707,357,000	
	１３８　５年国債	600,000,000	606,600,000	
	１３９　５年国債	700,000,000	708,169,000	
	１４０　５年国債	600,000,000	607,140,000	
	１４１　５年国債	650,000,000	658,164,000	
	１　４０年国債	70,000,000	107,356,900	
	２　４０年国債	110,000,000	164,067,200	
	３　４０年国債	74,000,000	111,342,620	
	４　４０年国債	107,000,000	162,371,430	
	５　４０年国債	125,000,000	184,040,000	
	６　４０年国債	105,000,000	152,618,550	
	７　４０年国債	121,000,000	169,458,080	
	８　４０年国債	230,000,000	301,596,700	
	９　４０年国債	220,000,000	216,568,000	

１０　４０年国債	275,000,000	317,047,500	
１１　４０年国債	320,000,000	358,339,200	
１２　４０年国債	200,000,000	202,662,000	
３１３　１０年国債	200,000,000	203,756,000	
３１４　１０年国債	260,000,000	264,209,400	
３１５　１０年国債	221,000,000	225,671,940	
３１６　１０年国債	250,000,000	254,897,500	
３１７　１０年国債	214,000,000	218,879,200	
３１８　１０年国債	200,000,000	204,200,000	
３１９　１０年国債	100,000,000	102,597,000	
３２０　１０年国債	230,000,000	235,501,600	
３２１　１０年国債	175,000,000	179,712,750	
３２２　１０年国債	130,000,000	133,201,900	
３２３　１０年国債	380,000,000	390,393,000	
３２５　１０年国債	310,000,000	318,494,000	
３２６　１０年国債	30,000,000	30,808,500	
３２７　１０年国債	450,000,000	463,509,000	
３２８　１０年国債	350,000,000	359,040,500	
３２９　１０年国債	500,000,000	517,480,000	
３３０　１０年国債	612,000,000	634,809,240	
３３１　１０年国債	365,000,000	375,811,300	
３３２　１０年国債	250,000,000	257,895,000	
３３３　１０年国債	600,000,000	620,112,000	
３３４　１０年国債	900,000,000	931,527,000	
３３５　１０年国債	690,000,000	712,183,500	
３３６　１０年国債	275,000,000	284,377,500	
３３７　１０年国債	300,000,000	307,176,000	
３３８　１０年国債	580,000,000	597,492,800	
３３９　１０年国債	590,000,000	608,649,900	
３４０　１０年国債	700,000,000	723,149,000	
３４１　１０年国債	440,000,000	452,491,600	
３４２　１０年国債	1,000,000,000	1,016,850,000	
３４３　１０年国債	700,000,000	712,271,000	
３４４　１０年国債	700,000,000	712,502,000	
３４５　１０年国債	650,000,000	662,044,500	
３４６　１０年国債	700,000,000	713,426,000	
３４７　１０年国債	500,000,000	509,730,000	
３４８　１０年国債	600,000,000	611,832,000	
３４９　１０年国債	1,050,000,000	1,070,937,000	

３５０　１０年国債	270,000,000	275,319,000	
３５１　１０年国債	800,000,000	815,192,000	
３５２　１０年国債	690,000,000	702,558,000	
３５３　１０年国債	250,000,000	254,447,500	
３５４　１０年国債	600,000,000	610,110,000	
３５５　１０年国債	460,000,000	467,286,400	
３５６　１０年国債	420,000,000	426,199,200	
１　３０年国債	16,000,000	20,479,360	
２　３０年国債	24,000,000	29,961,120	
３　３０年国債	30,000,000	37,275,900	
４　３０年国債	36,000,000	47,420,640	
５　３０年国債	28,000,000	34,979,280	
６　３０年国債	24,000,000	30,762,480	
７　３０年国債	55,000,000	70,324,100	
８　３０年国債	27,000,000	33,024,780	
９　３０年国債	43,000,000	50,393,420	
１０　３０年国債	45,000,000	51,037,200	
１１　３０年国債	40,000,000	48,650,400	
１２　３０年国債	60,000,000	76,383,000	
１３　３０年国債	75,000,000	94,738,500	
１４　３０年国債	82,000,000	108,499,940	
１５　３０年国債	100,000,000	134,119,000	
１６　３０年国債	250,000,000	336,507,500	
１７　３０年国債	130,000,000	173,678,700	
１８　３０年国債	80,000,000	106,031,200	
１９　３０年国債	57,000,000	75,731,340	
２１　３０年国債	60,000,000	80,150,400	
２２　３０年国債	170,000,000	233,166,900	
２４　３０年国債	92,000,000	126,902,960	
２５　３０年国債	150,000,000	202,593,000	
２６　３０年国債	180,000,000	246,808,800	
２７　３０年国債	150,000,000	209,469,000	
２８　３０年国債	170,000,000	238,790,500	
２９　３０年国債	200,000,000	278,700,000	
３０　３０年国債	220,000,000	304,125,800	
３１　３０年国債	300,000,000	411,516,000	
３２　３０年国債	285,000,000	398,221,950	
３３　３０年国債	311,000,000	418,179,930	
３４　３０年国債	180,000,000	250,707,600	

３５　３０年国債	195,000,000	264,718,350	
３６　３０年国債	350,000,000	477,319,500	
３７　３０年国債	300,000,000	404,580,000	
３８　３０年国債	190,000,000	252,874,800	
３９　３０年国債	192,000,000	260,417,280	
４０　３０年国債	200,000,000	267,228,000	
４１　３０年国債	170,000,000	223,629,900	
４２　３０年国債	176,000,000	231,792,000	
４３　３０年国債	200,000,000	263,710,000	
４４　３０年国債	230,000,000	303,616,100	
４５　３０年国債	200,000,000	255,018,000	
４６　３０年国債	140,000,000	178,655,400	
４７　３０年国債	210,000,000	273,474,600	
４８　３０年国債	290,000,000	363,767,300	
４９　３０年国債	100,000,000	125,663,000	
５０　３０年国債	215,000,000	238,007,150	
５１　３０年国債	240,000,000	235,368,000	
５２　３０年国債	300,000,000	309,129,000	
５３　３０年国債	250,000,000	263,812,500	
５４　３０年国債	218,000,000	241,236,620	
５５　３０年国債	200,000,000	221,220,000	
５６　３０年国債	300,000,000	331,677,000	
５７　３０年国債	230,000,000	254,483,500	
５８　３０年国債	320,000,000	353,881,600	
５９　３０年国債	200,000,000	215,924,000	
６０　３０年国債	180,000,000	204,030,000	
６１　３０年国債	200,000,000	215,612,000	
６２　３０年国債	200,000,000	204,706,000	
６３　３０年国債	230,000,000	228,790,200	
６４　３０年国債	100,000,000	99,338,000	
４９　２０年国債	64,000,000	65,882,240	
５０　２０年国債	107,000,000	109,867,600	
５１　２０年国債	82,000,000	84,754,380	
５２　２０年国債	52,000,000	54,126,280	
５３　２０年国債	66,000,000	69,076,260	
５４　２０年国債	65,000,000	68,163,550	
５５　２０年国債	140,000,000	147,018,200	
５８　２０年国債	200,000,000	211,664,000	
５９　２０年国債	45,000,000	47,591,550	

６０　２０年国債	10,000,000	10,484,000	
６１　２０年国債	100,000,000	103,909,000	
６２　２０年国債	95,000,000	98,321,200	
６３　２０年国債	130,000,000	139,158,500	
６４　２０年国債	90,000,000	97,119,900	
６５　２０年国債	175,000,000	189,759,500	
６６　２０年国債	185,000,000	199,848,100	
６７　２０年国債	55,000,000	59,923,600	
６８　２０年国債	120,000,000	132,298,800	
６９　２０年国債	110,000,000	120,798,700	
７０　２０年国債	83,000,000	92,727,600	
７１　２０年国債	125,000,000	138,506,250	
７２　２０年国債	175,000,000	194,118,750	
７３　２０年国債	120,000,000	133,220,400	
７４　２０年国債	73,000,000	81,413,980	
７５　２０年国債	80,000,000	89,651,200	
７６　２０年国債	51,000,000	56,608,470	
７７　２０年国債	130,000,000	144,989,000	
７８　２０年国債	61,000,000	68,030,250	
７９　２０年国債	50,000,000	56,042,000	
８０　２０年国債	53,000,000	59,701,320	
８１　２０年国債	76,000,000	85,605,640	
８２　２０年国債	87,000,000	98,504,880	
８３　２０年国債	93,000,000	105,800,520	
８５　２０年国債	58,000,000	66,311,400	
８６　２０年国債	80,000,000	92,480,800	
８７　２０年国債	55,000,000	63,231,300	
８８　２０年国債	100,000,000	116,233,000	
８９　２０年国債	78,000,000	90,145,380	
９０　２０年国債	20,000,000	23,227,600	
９１　２０年国債	60,000,000	70,094,400	
９２　２０年国債	310,000,000	359,674,400	
９３　２０年国債	100,000,000	115,853,000	
９４　２０年国債	130,000,000	151,568,300	
９５　２０年国債	50,000,000	59,326,000	
９６　２０年国債	55,000,000	64,419,300	
９７　２０年国債	40,000,000	47,378,400	
９８　２０年国債	320,000,000	376,505,600	
９９　２０年国債	100,000,000	118,181,000	

１００　２０年国債	155,000,000	185,198,650	
１０１　２０年国債	350,000,000	424,056,500	
１０３　２０年国債	170,000,000	205,341,300	
１０４　２０年国債	10,000,000	11,906,400	
１０５　２０年国債	126,000,000	150,668,280	
１０６　２０年国債	150,000,000	180,699,000	
１０７　２０年国債	90,000,000	107,976,600	
１０８　２０年国債	477,000,000	563,575,500	
１０９　２０年国債	55,000,000	65,165,100	
１１０　２０年国債	260,000,000	312,920,400	
１１１　２０年国債	200,000,000	243,392,000	
１１２　２０年国債	150,000,000	181,104,000	
１１３　２０年国債	310,000,000	375,617,700	
１１４　２０年国債	70,000,000	85,067,500	
１１５　２０年国債	180,000,000	220,559,400	
１１６　２０年国債	140,000,000	172,145,400	
１１７　２０年国債	215,000,000	262,147,350	
１１８　２０年国債	95,000,000	115,217,900	
１１９　２０年国債	93,000,000	110,827,170	
１２０　２０年国債	280,000,000	327,759,600	
１２１　２０年国債	170,000,000	204,984,300	
１２２　２０年国債	160,000,000	191,198,400	
１２３　２０年国債	200,000,000	246,258,000	
１２４　２０年国債	193,000,000	235,508,250	
１２５　２０年国債	85,000,000	105,938,050	
１２６　２０年国債	110,000,000	134,615,800	
１２７　２０年国債	165,000,000	200,064,150	
１２８　２０年国債	119,000,000	144,684,960	
１２９　２０年国債	230,000,000	276,995,900	
１３０　２０年国債	140,000,000	169,129,800	
１３１　２０年国債	150,000,000	179,446,500	
１３３　２０年国債	370,000,000	448,070,000	
１３４　２０年国債	80,000,000	97,104,800	
１３５　２０年国債	92,000,000	110,546,280	
１３６　２０年国債	200,000,000	237,874,000	
１３８　２０年国債	100,000,000	118,003,000	
１３９　２０年国債	300,000,000	357,747,000	
１４０　２０年国債	300,000,000	362,250,000	
１４１　２０年国債	200,000,000	242,146,000	

	１４２　２０年国債	240,000,000	293,678,400	
	１４３　２０年国債	210,000,000	251,983,200	
	１４４　２０年国債	300,000,000	356,031,000	
	１４５　２０年国債	380,000,000	462,178,800	
	１４６　２０年国債	230,000,000	280,273,400	
	１４７　２０年国債	150,000,000	181,167,000	
	１４８　２０年国債	330,000,000	394,544,700	
	１４９　２０年国債	272,000,000	325,660,160	
	１５０　２０年国債	200,000,000	237,046,000	
	１５１　２０年国債	370,000,000	428,108,500	
	１５２　２０年国債	350,000,000	405,545,000	
	１５３　２０年国債	400,000,000	470,232,000	
	１５４　２０年国債	380,000,000	441,229,400	
	１５５　２０年国債	275,000,000	310,895,750	
	１５６　２０年国債	200,000,000	206,964,000	
	１５７　２０年国債	400,000,000	400,640,000	
	１５８　２０年国債	100,000,000	104,960,000	
	１５９　２０年国債	280,000,000	298,460,400	
	１６０　２０年国債	210,000,000	227,360,700	
	１６１　２０年国債	260,000,000	276,923,400	
	１６２　２０年国債	350,000,000	372,778,000	
	１６３　２０年国債	290,000,000	308,858,700	
	１６４　２０年国債	400,000,000	418,588,000	
	１６５　２０年国債	200,000,000	209,232,000	
	１６６　２０年国債	300,000,000	324,528,000	
	１６７　２０年国債	300,000,000	313,350,000	
	１６８　２０年国債	300,000,000	307,716,000	
	１６９　２０年国債	300,000,000	301,950,000	
	１７０　２０年国債	90,000,000	90,506,700	
	２７　メキシコ国債	100,000,000	99,011,500	
	１１　フイリピン共和国	100,000,000	103,251,600	
国債証券　合計			71,946,332,660	
地方債証券	６９９　東京都公債	100,000,000	101,743,700	
	７１３　東京都公債	100,000,000	102,016,000	
	７５１　東京都公債	100,000,000	101,818,500	
	１６　東京都２０年	100,000,000	116,982,300	
	２４－１　北海道公債	100,000,000	102,243,700	
	２４－６　北海道公債	100,000,000	102,160,400	
	２２２　神奈川県公債	100,000,000	99,812,500	

	３１　神奈川県２０年	100,000,000	110,833,900	
	３６１　大阪府公債	100,000,000	102,229,200	
	４２０　大阪府公債	200,000,000	200,895,200	
	２４－５　京都府公債	100,000,000	102,155,800	
	２６－１７　兵庫県公債	100,000,000	102,101,000	
	３　兵庫県公債１２年	200,000,000	205,308,600	
	１９兵庫県公債２０年	100,000,000	117,730,400	
	２６－１０　静岡県公債	100,000,000	102,356,000	
	２１－５　愛知県公債	100,000,000	120,402,400	
	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	102,246,600	
	２９－５　広島県公債	100,000,000	101,147,300	
	４　埼玉県３０年	100,000,000	120,503,000	
	２９－１　福岡県公債	100,000,000	100,721,200	
	１６　千葉県２０年	100,000,000	118,079,300	
	２８－２　新潟県公債	100,000,000	100,618,700	
	１０８　共同発行地方	100,000,000	102,210,600	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	102,049,800	
	１２６　共同発行地方	100,000,000	102,935,900	
	１３１　共同発行地方	100,000,000	102,625,200	
	１６８　共同発行地方	100,000,000	100,847,900	
	２３－２　島根県公債	100,000,000	101,940,600	
	２５－６　大阪市公債	200,000,000	205,212,200	
	１１　名古屋市２０年	100,000,000	119,997,500	
	２０－１　神戸市２０年	100,000,000	119,074,400	
	２４－１０　神戸市公債	100,000,000	102,149,900	
	２４－３　横浜市公債	100,000,000	102,080,300	
	２４－５　札幌市公債	100,000,000	102,003,000	
	４　川崎市公債３０年	100,000,000	135,281,100	
	２３－４　福岡市２０年	100,000,000	119,584,300	
	２４－４　福井県公債	100,000,000	101,413,500	
地方債証券　合計			4,253,511,900	
特殊債券	１９　政保政策投資Ｃ	100,000,000	102,115,400	
	８１　道路機構	100,000,000	102,012,500	
	８６　政保道路機構	100,000,000	118,467,900	
	１６８　政保道路機構	100,000,000	102,194,500	
	１７３　政保道路機構	100,000,000	102,265,000	
	１７５　政保道路機構	100,000,000	102,237,500	
	１８６　政保道路機構	100,000,000	102,125,600	
	１９０　政保道路機構	100,000,000	102,053,400	

	２２３　政保道路機構	100,000,000	117,581,200	
	２３６　政保道路機構	100,000,000	101,481,700	
	２６１　政保道路機構	200,000,000	204,111,200	
	２８４　政保道路機構	200,000,000	196,229,200	
	２９８　政保道路機構	100,000,000	104,530,900	
	３　公営企業１５年	100,000,000	103,245,800	
	２９　地方公共団体	100,000,000	101,878,100	
	３３　地方公共団体	100,000,000	102,212,300	
	３９政保地方公共団	100,000,000	102,122,400	
	Ｆ１４３地方公共団体	100,000,000	109,700,500	
	１　地方公共団１５年	100,000,000	110,161,500	
	４８　地方公共団体	100,000,000	102,682,300	
	５１　地方公共団体	100,000,000	102,995,700	
	３１　地方公共団２０	100,000,000	119,825,700	
	６５　地方公共団体	100,000,000	102,357,600	
	７１　地方公共団体	100,000,000	102,164,500	
	２５　日本政策金融	100,000,000	102,315,600	
	２５　政保日本政策	100,000,000	102,556,300	
	１９　利付商工債	100,000,000	99,005,700	
特殊債券　合計			3,020,630,000	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	99,811,500	
	６３　中日本高速道	100,000,000	102,778,000	
	２１　西日本高速道	100,000,000	102,745,300	
	１２　アサヒグループＨＤ	100,000,000	100,305,500	
	１１日本たばこ産業	100,000,000	102,415,100	
	５　野村不動産ＨＤ	100,000,000	103,370,500	
	２３　森ビル	100,000,000	101,800,600	
	１１　セブンアンドアイ	100,000,000	101,155,000	
	４　ＪＸホールデイングス	100,000,000	103,108,000	
	１７　パナソニツク	100,000,000	100,878,000	
	１５　デンソー	100,000,000	100,246,400	
	７　凸版印刷	100,000,000	107,356,300	
	１　三菱ＵＦＪＦＧ　劣後	100,000,000	102,377,800	
	９三菱ＵＦＪ信託ＢＫ劣	100,000,000	102,173,100	
	１１三菱ＵＦＪ信託ＢＫ	100,000,000	103,096,100	
	７８　トヨタファイナンス	100,000,000	100,404,400	
	２　イオンＦＳ	100,000,000	100,554,100	
	１７５　オリックス	100,000,000	103,655,300	
	４４　野村ホールデイング	100,000,000	100,715,400	

	１８　エヌテイテイ都市開	100,000,000	106,548,100	
	１０７東日本旅客鉄	100,000,000	121,036,600	
	４１　東海旅客鉄道	100,000,000	117,722,700	
	５０９　関西電力	100,000,000	100,636,000	
	３７２　中国電力	100,000,000	103,118,000	
	３３２　北海道電力	100,000,000	104,473,200	
	１１　東京電力パワー	100,000,000	100,337,900	
	３０　大阪瓦斯	100,000,000	102,151,300	
	４　フアーストリテイリング	100,000,000	103,235,200	
社債券　合計			2,898,205,400	
合計			82,118,679,960	

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11月30日現在	2019年12月2日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	498,352,197	612,451,738
金銭信託	333,952,924	―
コール・ローン	649,460,746	6,367,531,949
株式	102,418,129,349	121,306,145,522
投資証券	2,814,132,682	3,645,255,546
派生商品評価勘定	45,643,154	373,437,617
未収入金	4,687,255	96,592,173
未収配当金	196,655,015	214,896,369
差入委託証拠金	770,259,958	1,487,858,524
流動資産合計	107,731,273,280	134,104,169,438
資産合計	107,731,273,280	134,104,169,438
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	4,415,029	930,366
未払金	－	76,338,905
未払解約金	33,327,900	58,281,600
その他未払費用	4,482	3,792
流動負債合計	37,747,411	135,554,663
負債合計	37,747,411	135,554,663
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	43,964,024,902	48,893,612,273
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	63,729,500,967	85,075,002,502
元本等合計	107,693,525,869	133,968,614,775
純資産合計	107,693,525,869	133,968,614,775
負債純資産合計	107,731,273,280	134,104,169,438

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2018年12月1日 至　2019年12月2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11月30日現在	2019年12月2日現在
1. ※1　期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	39,734,106,968円	43,964,024,902円
期中追加設定元本額	7,457,653,079円	10,527,862,672円
期中一部解約元本額	3,227,735,145円	5,598,275,301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	507,485,808円	466,203,951円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	14,096,372円	12,135,579円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	197,649,153円	136,414,008円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	25,055,668円	19,175,184円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	627,330,937円	467,869,193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）	812,920円	8,549,100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）	550,738,616円	538,132,530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）	1,489,095,675円	1,863,069,978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）	529,688,114円	538,513,489円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	5,542,491円	2,768,783円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	197,868円	2,115,496円

ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	723,449,418円	1,146,595,215円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	557,965,043円	816,785,041円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	8,203,476円	26,201,082円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	27,624,252,366円	29,501,748,908円
ダイワ・ライフ・バランス３０	569,101,264円	576,429,097円
ダイワ・ライフ・バランス５０	839,595,806円	874,085,645円
ダイワ・ライフ・バランス７０	676,868,528円	675,316,597円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,489,592,147円	1,500,453,033円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	4,144,667円	3,017,912円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	13,247,986円	14,368,992円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	4,228,403円	5,760,550円
ダイワつみたてインデックス外国株式	4,608,188円	136,727,006円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	88,638円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	86,527円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	－円	530,015円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	76,173円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	156,042円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	1,204,032円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	2,140,945円	－円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	237,257,604円	184,271,979円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	353,114,328円	323,611,524円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,137,819,193円	2,650,169,104円

ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	153,703,054円	127,631,309円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	631,981,535円	677,239,222円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	88,367,711円	111,772,535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）	453,744円	2,632,754,719円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,746,321,380円	2,712,848,524円
ダイワライフスタイル２５	19,463,084円	18,663,687円
ダイワライフスタイル５０	70,173,613円	67,445,810円
ダイワライフスタイル７５	58,841,550円	54,062,311円
計	43,964,024,902円	48,893,612,273円
2. 期末日における受益権の総数	43,964,024,902口	48,893,612,273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12月1日 至 2019年12月2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12月2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11月30日現在	2019年12月2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	54,564,220	14,202,028,663
投資証券	△24,568,003	442,369,912
合計	29,996,217	14,644,398,575

（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11月30日まで、及び2018年12月1日から2019年12月2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11月30日 現在				2019年12月2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	2,386,774,786	－	2,428,842,371	42,067,585	8,546,091,477	－	8,919,524,138	373,432,661
合計	2,386,774,786	－	2,428,842,371	42,067,585	8,546,091,477	－	8,919,524,138	373,432,661

（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11月30日 現在				2019年12月2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	941,976,460	－	941,137,000	△839,460	6,314,295,910	－	6,313,370,500	△925,410
アメリカ・ドル	941,976,460	－	941,137,000	△839,460	4,843,983,500	－	4,843,319,000	△664,500
イギリス・ポンド	－	－	－	－	240,357,900	－	240,312,000	△45,900
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	96,328,960	－	96,317,000	△11,960
カナダ・ドル	－	－	－	－	226,600,550	－	226,572,500	△28,050
スイス・フラン	－	－	－	－	230,248,200	－	230,202,000	△46,200
ユーロ	－	－	－	－	676,776,800	－	676,648,000	△128,800
合計	941,976,460	－	941,137,000	△839,460	6,314,295,910	－	6,313,370,500	△925,410

（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11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4496円 (24,496円)	2.7400円 (27,400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	3,300	123.710	408,243.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,850	227.220	647,577.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5,550	107.030	594,016.500	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,100	72.760	298,316.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,600	151.120	241,792.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	18,500	37.410	692,085.000	
	ABBOTT LABORATORIES	49,916	85.450	4,265,322.200	
	ARCONIC INC	11,133	30.960	344,677.680	
	VERISK ANALYTICS INC	4,350	147.480	641,538.000	

LAS VEGAS SANDS CORP	9,800	62.750	614,950.000	
AMPHENOL CORP-CL A	8,550	104.000	889,200.000	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	17,362	138.150	2,398,560.300	
QORVO INC	3,400	104.210	354,314.000	
AFLAC INC	21,600	54.840	1,184,544.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	3,650	118.440	432,306.000	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,200	69.810	293,202.000	
ADOBE INC	13,750	309.530	4,256,037.500	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,450	46.210	298,054.500	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,100	225.690	699,639.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	11,300	16.500	186,450.000	
GARMIN LTD	3,900	97.690	380,991.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,130	236.330	1,448,702.900	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	20,550	178.550	3,669,202.500	
WR BERKLEY CORP	4,175	68.000	283,900.000	
AUTOZONE INC	730	1,177.920	859,881.600	
DOLLAR TREE INC	6,971	91.460	637,567.660	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	31,400	10.420	327,188.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,200	87.390	279,648.000	
CELANESE CORP	3,500	125.570	439,495.000	
DR HORTON INC	10,116	55.350	559,920.600	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,450	30.880	75,656.000	
DENTSPLY SIRONA INC	7,000	56.540	395,780.000	
AUTODESK INC	6,100	180.900	1,103,490.000	
MOODY'S CORP	4,800	226.670	1,088,016.000	
DEVON ENERGY CORP	11,650	21.890	255,018.500	
ALBEMARLE CORP	3,150	65.380	205,947.000	
ATMOS ENERGY CORP	3,350	106.960	358,316.000	
ALLIANT ENERGY CORP	6,700	53.000	355,100.000	
CITIGROUP INC	65,373	75.120	4,910,819.760	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	12,250	170.780	2,092,055.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	14,250	91.350	1,301,737.500	
ALLEGHANY CORP	410	780.040	319,816.400	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	294.300	323,730.000	
HESS CORP	7,800	62.090	484,302.000	
DAVITA INC	3,500	71.770	251,195.000	

DANAHER CORP	18,200	145.980	2,656,836.000	
FORTIVE CORP	8,700	72.170	627,879.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	16,250	94.170	1,530,262.500	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,900	18.890	92,561.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	5,628	17.300	97,364.400	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,800	42.930	678,294.000	
BUNGE LTD	4,000	53.380	213,520.000	
TE CONNECTIVITY LTD	9,825	92.710	910,875.750	
APPLE INC	129,800	267.250	34,689,050.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,400	84.870	797,778.000	
BOEING CO/THE	14,990	366.180	5,489,038.200	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,465	107.050	477,978.250	
BECTON DICKINSON AND CO	7,649	258.500	1,977,266.500	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	21.280	142,576.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,850	90.840	349,734.000	
CDK GLOBAL INC	3,600	53.550	192,780.000	
NISOURCE INC	11,050	26.450	292,272.500	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,850	76.850	295,872.500	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	24,321	48.970	1,190,999.370	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	116,904	60.240	7,042,296.960	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	36,350	220.300	8,007,905.000	
ANSYS INC	2,450	254.690	623,990.500	
BB&T CORP	21,550	54.720	1,179,216.000	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	19,000	54.220	1,030,180.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	66,850	56.940	3,806,439.000	
JPMORGAN CHASE & CO	91,070	131.760	11,999,383.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,950	123.560	858,742.000	
LKQ CORP	9,400	35.280	331,632.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,350	188.330	254,245.500	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,062	67.820	614,584.840	
CADENCE DESIGN SYS INC	8,300	70.250	583,075.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,810	163.870	624,344.700	
DOLLAR GENERAL CORP	7,500	157.360	1,180,200.000	
SERVICENOW INC	5,160	283.040	1,460,486.400	
CATERPILLAR INC	16,200	144.730	2,344,626.000	
BROWN & BROWN INC	7,000	37.740	264,180.000	
AQUA AMERICA INC	6,300	44.270	278,901.000	

CMS ENERGY CORP	8,200	61.300	502,660.000	
MOSAIC CO/THE	10,950	19.050	208,597.500	
DELTA AIR LINES INC	4,750	57.310	272,222.500	
CORNING INC	23,200	29.040	673,728.000	
CISCO SYSTEMS INC	121,050	45.310	5,484,775.500	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	3,700	63.960	236,652.000	
MORGAN STANLEY	35,650	49.480	1,763,962.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,550	134.750	208,862.500	
MSCI INC	2,450	259.190	635,015.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,000	255.850	255,850.000	
MIDDLEBY CORP	1,600	115.760	185,216.000	
COTY INC-CL A	8,439	11.540	97,386.060	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	6,500	60.050	390,325.000	
BROADCOM INC	11,122	316.210	3,516,887.620	
ACUITY BRANDS INC	1,150	130.780	150,397.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,330	117.140	390,076.200	
ARAMARK	7,050	43.640	307,662.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,050	28.470	172,243.500	
DTE ENERGY COMPANY	5,250	124.940	655,935.000	
CENTENE CORP	12,150	60.470	734,710.500	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,200	118.900	380,480.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	13,050	38.460	501,903.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,350	93.270	498,994.500	
GARTNER INC	2,720	160.460	436,451.200	
SPLUNK INC	4,500	149.220	671,490.000	
DOMINION ENERGY INC	22,641	83.110	1,881,693.510	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,700	59.820	699,894.000	
SMITH (A.O.) CORP	4,150	48.400	200,860.000	
DEERE & CO	8,750	168.050	1,470,437.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	8,184	181.100	1,482,122.400	
VMWARE INC-CLASS A	2,500	155.620	389,050.000	
BURLINGTON STORES INC	1,900	225.000	427,500.000	
NASDAQ INC	3,450	104.800	361,560.000	
VAIL RESORTS INC	1,120	242.670	271,790.400	
EAST WEST BANCORP INC	4,100	45.820	187,862.000	
TARGA RESOURCES CORP	6,550	36.530	239,271.500	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,800	165.460	297,828.000	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,180	109.710	239,167.800	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,050	68.680	72,114.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	9,200	86.890	799,388.000	
COGNEX CORP	5,050	50.180	253,409.000	
TELEFLEX INC	1,330	353.340	469,942.200	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,600	115.620	300,612.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,200	147.030	323,466.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	650	369.380	240,097.000	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,520	322.070	489,546.400	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,800	149.180	566,884.000	
IDEX CORP	2,250	162.740	366,165.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	23,050	67.820	1,563,251.000	
ROLLINS INC	4,325	35.850	155,051.250	
AMETEK INC	6,525	99.010	646,040.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,350	70.240	516,264.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,650	36.990	135,013.500	
HEICO CORP	1,200	129.890	155,868.000	
XPO LOGISTICS INC	2,550	82.690	210,859.500	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,150	259.650	298,597.500	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,500	92.540	694,050.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,100	290.170	319,187.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	12,400	299.810	3,717,644.000	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,400	121.830	292,392.000	
GRUBHUB INC	2,600	43.120	112,112.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,650	211.850	349,552.500	
RPM INTERNATIONAL INC	3,800	73.730	280,174.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	690	813.920	561,604.800	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6,950	20.900	145,255.000	
UGI CORP	5,200	43.550	226,460.000	
CUMMINS INC	4,350	182.860	795,441.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	21,550	54.830	1,181,586.500	
SABRE CORP	7,650	22.430	171,589.500	
CDW CORP/DE	4,350	135.050	587,467.500	
SIGNATURE BANK	1,500	123.360	185,040.000	
COSTAR GROUP INC	990	612.860	606,731.400	

SVB FINANCIAL GROUP	1,490	231.730	345,277.700	
AMERCO	220	362.220	79,688.400	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,850	191.590	354,441.500	
MERCADOLIBRE INC	1,270	580.580	737,336.600	
HANESBRANDS INC	11,000	15.070	165,770.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,300	151.940	349,462.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	8,166	105.000	857,430.000	
IPG PHOTONICS CORP	1,020	142.090	144,931.800	
DEXCOM INC	2,700	227.310	613,737.000	
COPART INC	5,850	89.000	520,650.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,650	77.340	359,631.000	
SEATTLE GENETICS INC	3,250	120.350	391,137.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,270	277.340	629,561.800	
TRANSDIGM GROUP INC	1,330	567.100	754,243.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,600	116.610	303,186.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,900	19.550	193,545.000	
KINDER MORGAN INC	57,581	19.610	1,129,163.410	
HCA HEALTHCARE INC	7,900	138.660	1,095,414.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,150	403.820	464,393.000	
CABOT OIL & GAS CORP	12,050	15.940	192,077.000	
T-MOBILE US INC	10,000	78.550	785,500.000	
ZILLOW GROUP INC - C	3,450	39.150	135,067.500	
COCA-COLA CO/THE	114,150	53.400	6,095,610.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	7,100	50.460	358,266.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,850	74.760	362,586.000	
EATON VANCE CORP	3,050	47.170	143,868.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,650	27.490	237,788.500	
CSX CORP	22,150	71.540	1,584,611.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,680	172.290	461,737.200	
EXPEDIA GROUP INC	4,075	101.660	414,264.500	
AUTOLIV INC	2,400	81.720	196,128.000	
AMAZON.COM INC	11,770	1,800.800	21,195,416.000	
FLOWSERVE CORP	3,550	48.700	172,885.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,000	244.940	1,469,640.000	
EXXON MOBIL CORP	119,655	68.130	8,152,095.150	
FLIR SYSTEMS INC	3,750	53.560	200,850.000	
AES CORP	20,100	18.910	380,091.000	

EVEREST RE GROUP LTD	1,240	271.260	336,362.400	
EOG RESOURCES INC	16,400	70.900	1,162,760.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,850	87.120	422,532.000	
ABIOMED INC	1,290	196.180	253,072.200	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,650	87.910	408,781.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,240	80.770	746,314.800	
FORD MOTOR CO	110,923	9.060	1,004,962.380	
DISCOVERY INC - A	4,690	32.940	154,488.600	
EXACT SCIENCES CORP	3,700	81.010	299,737.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	22.550	110,201.850	
DISCOVERY INC-C	10,089	30.520	307,916.280	
AERCAP HOLDINGS NV	4,000	61.810	247,240.000	
FORTINET INC	4,150	105.110	436,206.500	
MARKEL CORP	410	1,135.550	465,575.500	
NEXTERA ENERGY INC	13,550	233.820	3,168,261.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	43,408	11.380	493,983.040	
INSULET CORP	1,750	185.700	324,975.000	
US BANCORP	42,800	60.030	2,569,284.000	
UNITED RENTALS INC	2,300	153.050	352,015.000	
F5 NETWORKS INC	1,750	145.710	254,992.500	
FASTENAL CO	16,300	35.520	578,976.000	
FISERV INC	16,163	116.240	1,878,787.120	
GENERAL ELECTRIC CO	246,850	11.270	2,781,999.500	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	6,100	53.640	327,204.000	
GENERAL MOTORS CO	36,100	36.000	1,299,600.000	
TRIPADVISOR INC	3,300	28.400	93,720.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,900	181.740	1,254,006.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,290	221.350	2,056,341.500	
ALPHABET INC-CL A	8,400	1,304.090	10,954,356.000	
ALPHABET INC-CL C	8,747	1,304.960	11,414,485.120	
OWENS CORNING	3,150	67.060	211,239.000	
GENERAL MILLS INC	16,850	53.320	898,442.000	
FIRSTENERGY CORP	15,268	47.690	728,130.920	
GENUINE PARTS CO	4,300	104.370	448,791.000	
IHS MARKIT LTD	10,634	72.650	772,560.100	
FIFTH THIRD BANCORP	20,700	30.190	624,933.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	6,410	201.090	1,288,986.900	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	28.740	86,220.000	

HALLIBURTON CO	24,800	20.990	520,552.000	
HOME DEPOT INC	31,000	220.510	6,835,810.000	
ASSURANT INC	1,750	132.870	232,522.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	29,900	14.890	445,211.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,190	251.670	299,487.300	
HERSHEY CO/THE	4,350	148.160	644,496.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,450	36.380	161,891.000	
HUMANA INC	3,830	341.230	1,306,910.900	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,150	115.580	941,977.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,100	172.470	362,187.000	
HENRY SCHEIN INC	4,500	68.900	310,050.000	
HP INC	42,600	20.080	855,408.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	39,400	15.830	623,702.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,800	48.510	232,848.000	
HOLLYFRONTIER CORP	4,700	51.550	242,285.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,000	45.090	270,540.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,500	48.700	121,750.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,900	41.970	499,443.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	19,853	30.500	605,516.500	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	25,000	134.450	3,361,250.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	10,700	46.340	495,838.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,000	63.260	253,040.000	
ZOETIS INC	13,550	120.520	1,633,046.000	
INGERSOLL-RAND PLC	6,979	131.110	915,016.690	
CHENIERE ENERGY INC	6,550	60.540	396,537.000	
ALLEGION PLC	2,650	120.030	318,079.500	
LEGGETT & PLATT INC	3,500	52.320	183,120.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	11,773	21.500	253,119.500	
WASTE CONNECTIONS INC	7,557	90.550	684,286.350	
JUNIPER NETWORKS INC	9,650	25.060	241,829.000	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,200	112.490	247,478.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,420	105.090	359,407.800	
JOHNSON & JOHNSON	74,800	137.490	10,284,252.000	
ABBVIE INC	41,779	87.730	3,665,271.670	

HOLOGIC INC	7,550	51.320	387,466.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	9,950	136.340	1,356,583.000	
KROGER CO	22,950	27.340	627,453.000	
KLA CORP	4,650	163.860	761,949.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	7,170	391.030	2,803,685.100	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,560	306.920	785,715.200	
LOWE'S COS INC	22,450	117.310	2,633,609.500	
ELI LILLY & CO	24,605	117.350	2,887,396.750	
LAM RESEARCH CORP	4,230	266.830	1,128,690.900	
JONES LANG LASALLE INC	1,450	166.330	241,178.500	
LOEWS CORP	7,900	50.900	402,110.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,799	59.050	342,430.950	
MCDONALD'S CORP	21,600	194.480	4,200,768.000	
3M CO	16,250	169.770	2,758,762.500	
FACEBOOK INC-CLASS A	67,650	201.640	13,640,946.000	
MANPOWERGROUP INC	1,780	92.640	164,899.200	
S&P GLOBAL INC	6,980	264.650	1,847,257.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,840	268.400	493,856.000	
CONCHO RESOURCES INC	5,800	72.560	420,848.000	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	6,600	34.240	225,984.000	
PHILLIPS 66	12,850	114.720	1,474,152.000	
TECHNIPFMC PLC	12,100	18.840	227,964.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,450	31.950	461,677.500	
DXC TECHNOLOGY CO	7,788	37.330	290,726.040	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,350	169.250	566,987.500	
MYLAN NV	14,850	18.780	278,883.000	
METLIFE INC	23,500	49.910	1,172,885.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,100	26.370	477,297.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,510	195.130	294,646.300	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	45.020	216,096.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,778	167.300	799,359.400	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	640	719.410	460,422.400	
BAKER HUGHES CO	14,473	22.420	324,484.660	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,380	195.840	661,939.200	
MERCK & CO. INC.	72,721	87.180	6,339,816.780	
DUPONT DE NEMOURS INC	21,168	64.810	1,371,898.080	
MASCO CORP	8,600	46.550	400,330.000	

M & T BANK CORP	3,569	164.740	587,957.060	
MARSH & MCLENNAN COS	14,450	108.070	1,561,611.500	
BLACK KNIGHT INC	4,400	63.010	277,244.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,300	100.440	231,012.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,872	140.360	1,104,913.920	
WORKDAY INC-CLASS A	4,800	179.120	859,776.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,850	84.920	157,102.000	
SQUARE INC - A	10,100	69.120	698,112.000	
TRANSUNION	5,500	86.310	474,705.000	
VISTRA ENERGY CORP	10,050	26.530	266,626.500	
CAPRI HOLDINGS LTD	4,450	37.140	165,273.000	
BEIGENE LTD-ADR	1,050	203.290	213,454.500	
NETAPP INC	7,450	60.590	451,395.500	
NIKE INC -CL B	35,550	93.490	3,323,569.500	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,500	193.500	1,451,250.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,800	94.540	642,872.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,750	89.820	336,825.000	
ALLY FINANCIAL INC	11,450	31.840	364,568.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,450	351.770	1,565,376.500	
APTIV PLC	7,200	93.880	675,936.000	
NEWMONT GOLDCORP CORP	23,161	38.400	889,382.400	
MCKESSON CORP	5,550	144.640	802,752.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,100	56.670	459,027.000	
XYLEM INC	5,150	77.510	399,176.500	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	44,050	82.930	3,653,066.500	
NUCOR CORP	8,700	56.360	490,332.000	
WESTERN UNION CO	12,946	26.880	347,988.480	
GODADDY INC - CLASS A	5,300	66.380	351,814.000	
NEWELL BRANDS INC	12,292	19.220	236,252.240	
EVERGY INC	6,850	63.270	433,399.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	25,724	38.570	992,174.680	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	700	169.300	118,510.000	
OKTA INC	3,000	129.780	389,340.000	
LIBERTY BROADBAND-C	3,150	119.490	376,393.500	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	10,705	27.710	296,635.550	
LINDE PLC	15,296	206.210	3,154,188.160	
WIX.COM LTD	1,450	120.890	175,290.500	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	8,300	24.740	205,342.000	

KKR & CO INC -A	14,700	29.490	433,503.000	
PAYCHEX INC	9,350	86.120	805,222.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,200	442.280	973,016.000	
ALTRIA GROUP INC	52,850	49.700	2,626,645.000	
PFIZER INC	157,113	38.520	6,051,992.760	
CIGNA CORP	10,680	199.920	2,135,145.600	
DELL TECHNOLOGIES -C	4,551	48.490	220,677.990	
ALTICE USA INC- A	4,100	25.580	104,878.000	
XCEL ENERGY INC	14,850	61.490	913,126.500	
STERIS PLC	2,500	151.140	377,850.000	
FOX CORP - CLASS B	4,833	34.980	169,058.340	
FOX CORP - CLASS A	9,999	35.760	357,564.240	
STRYKER CORP	9,500	204.860	1,946,170.000	
DOW INC	21,068	53.370	1,124,399.160	
PARKER HANNIFIN CORP	3,750	198.790	745,462.500	
UBER TECHNOLOGIES INC	5,200	29.600	153,920.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,650	127.840	594,456.000	
POLARIS INC	1,550	97.700	151,435.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	70,767	122.060	8,637,820.020	
EXELON CORP	27,372	44.400	1,215,316.800	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,600	113.940	752,004.000	
NVR INC	100	3,791.890	379,189.000	
CONOCOPHILLIPS	31,900	59.940	1,912,086.000	
TWILIO INC - A	3,150	103.280	325,332.000	
DOCUSIGN INC	2,900	71.210	206,509.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,400	276.810	387,534.000	
MATCH GROUP INC	1,800	70.480	126,864.000	
PEPSICO INC	39,550	135.830	5,372,076.500	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,100	122.550	134,805.000	
DROPBOX INC-CLASS A	5,200	18.490	96,148.000	
MONGODB INC	1,250	148.700	185,875.000	
SNAP INC - A	20,800	15.250	317,200.000	
CORTEVA INC	21,568	26.020	561,199.360	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,800	93.620	1,104,716.000	
AMCOR PLC	47,900	10.260	491,454.000	
ROKU INC	2,400	160.370	384,888.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,150	121.030	623,304.500	

ACCENTURE PLC-CL A	18,080	201.160	3,636,972.800	
PENTAIR PLC	4,705	44.350	208,666.750	
QUALCOMM INC	34,350	83.550	2,869,942.500	
INVESCO LTD	10,950	17.560	192,282.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,050	157.080	322,014.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,350	55.100	460,085.000	
PINTEREST INC- CLASS A	4,500	19.480	87,660.000	
RAYTHEON COMPANY	7,920	217.420	1,721,966.400	
DISH NETWORK CORP-RTS	349	0.680	237.320	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,200	369.000	811,800.000	
REPUBLIC SERVICES INC	6,750	88.650	598,387.500	
BOOKING HOLDINGS INC	1,230	1,904.030	2,341,956.900	
ROSS STORES INC	10,700	116.150	1,242,805.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,650	111.900	296,535.000	
RESMED INC	4,150	149.600	620,840.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,800	106.550	404,890.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,350	58.200	194,970.000	
RALPH LAUREN CORP	1,450	107.340	155,643.000	
PERKINELMER INC	3,100	92.900	287,990.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	30,235	16.640	503,110.400	
CHEVRON CORP	53,818	117.130	6,303,702.340	
EDISON INTERNATIONAL	10,300	69.100	711,730.000	
TESLA INC	3,770	329.940	1,243,873.800	
NORTONLIFELOCK INC	18,450	24.900	459,405.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,422	157.740	697,526.280	
SYNOPSYS INC	4,350	141.040	613,524.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,415	470.010	2,075,094.150	
CBRE GROUP INC - A	9,150	57.020	521,733.000	
TWITTER INC	21,150	30.910	653,746.500	
SOUTHERN CO/THE	29,350	61.990	1,819,406.500	
SYSCO CORP	13,700	80.550	1,103,535.000	
TRAVELERS COS INC/THE	7,303	136.720	998,466.160	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,950	64.530	254,893.500	
STEEL DYNAMICS INC	6,200	33.730	209,126.000	
SCHLUMBERGER LTD	39,202	36.200	1,419,112.400	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,600	51.490	236,854.000	
AT&T INC	206,591	37.380	7,722,371.580	

SOUTHWEST AIRLINES CO	4,050	57.640	233,442.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	12,300	21.470	264,081.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,330	583.130	1,358,692.900	
SEMPRA ENERGY	7,900	147.270	1,163,433.000	
TIFFANY & CO	3,250	133.800	434,850.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,100	59.680	423,728.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	26,500	120.210	3,185,565.000	
SALESFORCE.COM INC	23,421	162.890	3,815,046.690	
WESTROCK CO	7,130	40.330	287,552.900	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	22,984	42.830	984,404.720	
TERADYNE INC	5,000	62.590	312,950.000	
UNION PACIFIC CORP	19,950	175.990	3,511,000.500	
MARATHON OIL CORP	24,800	11.650	288,920.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	19,388	60.640	1,175,688.320	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	23,137	148.340	3,432,142.580	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	19,700	119.730	2,358,681.000	
UNUM GROUP	5,900	30.740	181,366.000	
SPRINT CORP	23,165	5.920	137,136.800	
IQVIA HOLDINGS INC	4,894	145.980	714,426.120	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	58.280	253,518.000	
AMEREN CORPORATION	7,200	74.330	535,176.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	26,776	279.870	7,493,799.120	
VERISIGN INC	3,000	190.740	572,220.000	
VALERO ENERGY CORP	11,742	95.490	1,121,243.580	
ULTA BEAUTY INC	1,610	233.860	376,514.600	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8,188	47.630	389,994.440	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,500	139.490	348,725.000	
ANTHEM INC	7,280	288.660	2,101,444.800	
WALT DISNEY CO/THE	50,912	151.580	7,717,240.960	
WELLS FARGO & CO	120,922	54.460	6,585,412.120	
WASTE MANAGEMENT INC	11,950	112.910	1,349,274.500	
WILLIAMS COS INC	34,700	22.720	788,384.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,450	94.440	325,818.000	
WHIRLPOOL CORP	1,900	143.100	271,890.000	
WALMART INC	40,500	119.090	4,823,145.000	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	86.990	252,271.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,800	145.280	842,624.000	

WYNN RESORTS LTD	2,900	120.850	350,465.000	
XEROX HOLDINGS CORP	5,911	38.930	230,115.230	
WABTEC CORP	5,411	78.570	425,142.270	
TJX COMPANIES INC	34,250	61.130	2,093,702.500	
WATERS CORP	2,050	222.070	455,243.500	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,800	92.800	167,040.000	
ALLERGAN PLC	9,157	184.940	1,693,495.580	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,650	250.940	414,051.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	22,000	59.600	1,311,200.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,723	196.440	731,346.120	
WESTERN DIGITAL CORP	8,400	50.330	422,772.000	
WEC ENERGY GROUP INC	9,080	88.650	804,942.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	14,600	59.310	865,926.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	48,950	184.510	9,031,764.500	
PPL CORP	21,100	34.030	718,033.000	
PULTEGROUP INC	7,500	39.650	297,375.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,750	128.840	869,670.000	
NORTHERN TRUST CORP	6,000	107.240	643,440.000	
NVIDIA CORP	16,300	216.740	3,532,862.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,350	222.700	523,345.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12,743	153.210	1,952,355.030	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,300	39.820	211,046.000	
TYSON FOODS INC-CL A	8,300	89.890	746,087.000	
NETFLIX INC	12,320	314.660	3,876,611.200	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	11,300	313.950	3,547,635.000	
NRG ENERGY INC	7,950	39.730	315,853.500	
GLOBE LIFE INC	2,925	102.760	300,573.000	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,850	109.900	533,015.000	
TEXTRON INC	6,850	46.240	316,744.000	
NEWS CORP - CLASS A	11,737	12.880	151,172.560	
OGE ENERGY CORP	5,950	42.060	250,257.000	
OMNICOM GROUP	6,400	79.480	508,672.000	
ORACLE CORP	67,683	56.140	3,799,723.620	
MASTERCARD INC - A	25,500	292.230	7,451,865.000	

ONEOK INC	11,900	71.050	845,495.000	
CENTURYLINK INC	29,452	14.490	426,759.480	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,020	360.370	1,088,317.400	
YUM! BRANDS INC	8,950	100.670	900,996.500	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	3,050	121.350	370,117.500	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,330	106.910	142,190.300	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,650	50.480	285,212.000	
NOBLE ENERGY INC	14,550	20.760	302,058.000	
BANK OF AMERICA CORP	255,401	33.320	8,509,961.320	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,050	341.990	359,089.500	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,250	80.710	423,727.500	
NORDSTROM INC	3,000	38.170	114,510.000	
AMERICAN EXPRESS CO	20,000	120.120	2,402,400.000	
ANALOG DEVICES INC	10,649	112.950	1,202,804.550	
ADVANCED MICRO DEVICES	29,100	39.150	1,139,265.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,300	51.830	430,189.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	24,522	52.660	1,291,328.520	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,150	98.300	506,245.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,950	120.020	594,099.000	
AVERY DENNISON CORP	2,500	130.370	325,925.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	16,500	64.110	1,057,815.000	
EMERSON ELECTRIC CO	17,400	73.860	1,285,164.000	
AON PLC	6,970	203.610	1,419,161.700	
AMGEN INC	17,300	234.720	4,060,656.000	
TAPESTRY INC	8,350	26.890	224,531.500	
EATON CORP PLC	12,136	92.500	1,122,580.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,680	186.060	870,760.800	
APPLIED MATERIALS INC	27,200	57.900	1,574,880.000	
CME GROUP INC	10,100	202.730	2,047,573.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,694	22.550	263,699.700	
ECOLAB INC	7,550	186.670	1,409,358.500	
EQUIFAX INC	3,350	139.640	467,794.000	
GAP INC/THE	5,950	16.610	98,829.500	
GILEAD SCIENCES INC	35,950	67.240	2,417,278.000	
HORMEL FOODS CORP	8,350	44.530	371,825.500	
STATE STREET CORP	10,943	75.100	821,819.300	
SUNTRUST BANKS INC	12,948	70.840	917,236.320	

SCHWAB (CHARLES) CORP	34,000	49.500	1,683,000.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,600	81.970	1,114,792.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,850	46.570	225,864.500	
CROWN HOLDINGS INC	3,850	75.900	292,215.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,000	55.030	495,270.000	
FEDEX CORP	6,900	160.050	1,104,345.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,504	100.010	1,350,535.040	
FMC CORP	3,950	97.960	386,942.000	
FLEX LTD	14,750	11.870	175,082.500	
CERNER CORP	9,350	71.590	669,366.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,024	141.230	427,079.520	
CITRIX SYSTEMS INC	3,700	112.810	417,397.000	
INTEL CORP	126,650	58.050	7,352,032.500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,500	22.400	257,600.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10,350	61.860	640,251.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	9,450	174.330	1,647,418.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	46,100	6.980	321,778.000	
ILLUMINA INC	4,040	320.760	1,295,870.400	
SEALED AIR CORP	4,400	37.730	166,012.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,210	592.900	1,903,209.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,450	117.880	406,686.000	
SNAP-ON INC	1,550	160.460	248,713.000	
CARMAX INC	4,950	97.260	481,437.000	
COMERICA INC	4,500	70.410	316,845.000	
INGREDION INC	1,900	83.170	158,023.000	
DUKE ENERGY CORP	20,528	88.170	1,809,953.760	
TARGET CORP	14,400	125.010	1,800,144.000	
DOVER CORP	4,250	111.480	473,790.000	
WW GRAINGER INC	1,400	316.950	443,730.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,950	92.090	363,755.500	
CINTAS CORP	2,620	257.060	673,497.200	
CONAGRA BRANDS INC	13,800	28.870	398,406.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,100	83.980	344,318.000	
CLOROX COMPANY	3,750	148.230	555,862.500	
ENTERGY CORP	5,400	116.390	628,506.000	
MICROSOFT CORP	205,650	151.380	31,131,297.000	
INCYTE CORP	5,350	94.160	503,756.000	

CVS HEALTH CORP	36,769	75.270	2,767,602.630	
MEDTRONIC PLC	37,938	111.390	4,225,913.820	
MICRON TECHNOLOGY INC	31,200	47.510	1,482,312.000	
BLACKROCK INC	3,200	494.910	1,583,712.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	14,900	24.560	365,944.000	
HASBRO INC	3,600	101.700	366,120.000	
KELLOGG CO	7,300	65.120	475,376.000	
KEYCORP	29,900	19.390	579,761.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,000	152.420	457,260.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	40,661	52.540	2,136,328.940	
KOHLS CORP	4,950	47.010	232,699.500	
COOPER COS INC/THE	1,400	313.090	438,326.000	
APACHE CORP	10,610	22.280	236,390.800	
CHUBB LTD	12,949	151.480	1,961,514.520	
ARROW ELECTRONICS INC	2,400	79.640	191,136.000	
ALLSTATE CORP	9,600	111.350	1,068,960.000	
EBAY INC	23,350	35.520	829,392.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	31,500	108.010	3,402,315.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	4,150	78.370	325,235.500	
XILINX INC	7,150	92.780	663,377.000	
DISH NETWORK CORP-A	6,450	34.170	220,396.500	
ZIONS BANCORP NA	5,200	49.780	258,856.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,100	195.470	1,192,367.000	
TRIMBLE INC	7,050	40.530	285,736.500	
LENNAR CORP-A	8,100	59.650	483,165.000	
LEAR CORP	1,800	120.310	216,558.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,000	44.300	310,100.000	
PROGRESSIVE CORP	16,800	73.050	1,227,240.000	
PACCAR INC	10,037	81.370	816,710.690	
PVH CORP	2,000	96.960	193,920.000	
BIOGEN INC	5,610	299.810	1,681,934.100	
IDEXX LABORATORIES INC	2,520	251.580	633,981.600	
STARBUCKS CORP	34,250	85.430	2,925,977.500	
PTC INC	3,150	76.600	241,290.000	
PERRIGO CO PLC	3,800	51.230	194,674.000	
EVERSOURCE ENERGY	8,880	82.640	733,843.200	
INTUIT INC	7,340	258.890	1,900,252.600	
BORGWARNER INC	6,300	42.050	264,915.000	

	BEST BUY CO INC	6,900	80.640	556,416.000	
	BALL CORP	9,184	66.060	606,695.040	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	39,297	43.250	1,699,595.250	
	ELECTRONIC ARTS INC	8,650	101.010	873,736.500	
	VULCAN MATERIALS CO	3,650	141.870	517,825.500	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,250	221.750	1,607,687.500	
	VF CORP	9,500	88.540	841,130.000	
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	10,071	40.380	406,666.980	
	VIACOM INC-CLASS B	10,071	24.070	242,408.970	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,720	139.370	239,716.400	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,600	133.730	347,698.000	
	CARNIVAL CORP	11,850	45.080	534,198.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	128,190	44.150	5,659,588.500	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,700	31.750	212,725.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,700	56.220	376,674.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	5.850	52,650.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	35,300	5.500	194,150.000	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 762,122,552.250 (83,589,601,531)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	TUI AG-DI	13,797	10.635	146,731.090	
	BP PLC	575,000	4.802	2,761,150.000	
	UNILEVER PLC	31,760	45.780	1,453,972.800	
	BARCLAYS PLC	496,800	1.715	852,210.720	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	52,700	7.116	375,013.200	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	56,100	1.943	109,030.350	
	PRUDENTIAL PLC	75,700	13.765	1,042,010.500	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	145,791	2.262	329,779.240	
	EVRAZ PLC	15,000	3.704	55,560.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,064	28.740	174,279.360	
	BAE SYSTEMS PLC	94,300	5.734	540,716.200	
	AVIVA PLC	113,866	4.038	459,790.900	
	AVEVA GROUP PLC	2,000	45.580	91,160.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	141,000	17.540	2,473,140.000	
	INFORMA PLC	36,200	7.914	286,486.800	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	10,540	11.328	119,397.120	

MELROSE INDUSTRIES PLC	145,500	2.296	334,068.000	
AUTO TRADER GROUP PLC	28,300	5.620	159,046.000	
DCC PLC	2,800	66.080	185,024.000	
OCADO GROUP PLC	13,500	13.250	178,875.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,100	89.250	187,425.000	
HALMA PLC	11,000	21.060	231,660.000	
GVC HOLDINGS PLC	16,700	8.516	142,217.200	
NMC HEALTH PLC	2,700	25.090	67,743.000	
JD SPORTS FASHION PLC	13,000	7.606	98,878.000	
M&G PLC	75,700	2.360	178,652.000	
RELX PLC	55,546	18.730	1,040,376.580	
DIAGEO PLC	67,500	31.650	2,136,375.000	
RIO TINTO PLC	32,250	42.015	1,354,983.750	
STANDARD CHARTERED PLC	82,100	6.974	572,565.400	
TESCO PLC	281,700	2.294	646,219.800	
SMITH & NEPHEW PLC	26,450	17.310	457,849.500	
GLENCORE PLC	324,525	2.439	791,516.470	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	8,150	18.550	151,182.500	
SMITHS GROUP PLC	11,383	16.610	189,071.630	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	41,983	3.054	128,216.080	
PEARSON PLC	23,563	6.466	152,358.350	
SAINSBURY (J) PLC	54,225	2.143	116,204.170	
NEXT PLC	4,200	67.580	283,836.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	93,200	1.742	162,401.000	
WHITBREAD PLC	3,861	46.010	177,644.610	
BUNZL PLC	9,605	21.230	203,914.150	
VODAFONE GROUP PLC	766,183	1.533	1,175,018.240	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,661	49.800	182,317.800	
KINGFISHER PLC	62,411	2.099	131,000.680	
WPP PLC	38,400	10.005	384,192.000	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	20,627	8.534	176,030.810	
SEVERN TRENT PLC	7,133	22.430	159,993.190	
RENTOKIL INITIAL PLC	54,000	4.449	240,246.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	20,300	60.660	1,231,398.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	15,150	10.885	164,907.750	
SCHRODERS PLC	3,450	32.990	113,815.500	
SSE PLC	30,000	13.000	390,000.000	
WEIR GROUP PLC/THE	7,950	13.955	110,942.250	

BARRATT DEVELOPMENTS PLC	31,000	6.668	206,708.000	
ASTRAZENECA PLC	37,050	74.580	2,763,189.000	
FERGUSON PLC	7,087	67.220	476,388.140	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	183,000	2.809	514,047.000	
3I GROUP PLC	29,391	10.710	314,777.610	
ASHTEAD GROUP PLC	13,650	23.500	320,775.000	
SAGE GROUP PLC/THE	32,314	7.538	243,582.930	
NATIONAL GRID PLC	98,134	8.897	873,098.190	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,081,465	0.611	1,272,815.840	
RSA INSURANCE GROUP PLC	31,760	5.514	175,124.640	
IMPERIAL BRANDS PLC	28,800	17.032	490,521.600	
CENTRICA PLC	176,160	0.802	141,315.550	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,600	45.860	165,096.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	65,010	30.600	1,989,306.000	
BHP GROUP PLC	60,527	17.100	1,035,011.700	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,600	25.690	272,314.000	
HSBC HOLDINGS PLC	571,650	5.763	3,294,418.950	
ANGLO AMERICAN PLC	31,083	20.265	629,896.990	
MONDI PLC	14,250	16.755	238,758.750	
WM MORRISON SUPERMARKETS	66,300	1.983	131,472.900	
CARNIVAL PLC	4,861	32.530	158,128.330	
EASYJET PLC	4,000	13.380	53,520.000	
COMPASS GROUP PLC	46,489	18.945	880,734.100	
PERSIMMON PLC	9,300	25.580	237,894.000	
BT GROUP PLC	246,100	1.915	471,429.160	
COCA-COLA HBC AG-DI	5,800	25.790	149,582.000	
BURBERRY GROUP PLC	12,189	21.040	256,456.560	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	5,136	50.070	257,159.520	
INTERTEK GROUP PLC	4,800	55.160	264,768.000	
ITV PLC	102,100	1.451	148,147.100	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	9,199	68.720	632,155.280	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	123,300	22.110	2,726,163.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	105,718	21.895	2,314,695.610	
MEGGITT PLC	24,100	6.430	154,963.000	
G4S PLC	43,500	2.091	90,958.500	
ADMIRAL GROUP PLC	5,550	21.400	118,770.000	

	ANTOFAGASTA PLC	11,400	8.680	98,952.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	3.169	224,561.670	
	EXPERIAN PLC	26,154	25.630	670,327.020	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 51,516,577.330 (7,294,232,184)	
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	15.900	548,550.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	272.700	272,700.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	17,600	15.960	280,896.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	565.100	339,060.000	
	BANK HAPOALIM BM	30,700	27.650	848,855.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	45,200	24.910	1,125,932.000	
	NICE LTD	1,850	520.000	962,000.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,100	91.000	373,100.000	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 4,751,093.000 (149,944,495)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	78,800	3.260	256,888.000	
	BHP GROUP LTD	83,650	38.230	3,197,939.500	
	SOUTH32 LTD	151,600	2.700	409,320.000	
	ALUMINA LTD	69,300	2.310	160,083.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	26,650	34.510	919,691.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	42,500	9.730	413,525.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	13,300	10.030	133,399.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	79,450	25.890	2,056,960.500	
	WESTPAC BANKING CORP	97,348	24.520	2,386,972.960	
	SANTOS LTD	53,100	8.150	432,765.000	
	AUSNET SERVICES	50,000	1.740	87,000.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	79,850	24.840	1,983,474.000	
	RIO TINTO LTD	10,500	96.900	1,017,450.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	53,500	8.700	465,450.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	5.780	346,800.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	22.320	75,888.000	
	COLES GROUP LTD	34,545	16.260	561,701.700	
	WISETECH GLOBAL LTD	4,500	27.280	122,760.000	

OIL SEARCH LTD	38,400	7.440	285,696.000	
SEEK LTD	9,600	23.190	222,624.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	20,500	18.700	383,350.000	
NEWCREST MINING LTD	23,400	30.760	719,784.000	
INCITEC PIVOT LTD	49,800	3.230	160,854.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	50,150	80.820	4,053,123.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	7,150	34.560	247,104.000	
ORICA LTD	11,500	23.780	273,470.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	38,450	12.680	487,546.000	
CIMIC GROUP LTD	2,800	33.640	94,192.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	36,200	39.760	1,439,312.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	11.380	155,906.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	57,700	4.790	276,383.000	
CROWN RESORTS LTD	11,600	12.910	149,756.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	24,000	7.300	175,200.000	
TELSTRA CORP LTD	120,200	3.860	463,972.000	
AMP LTD	102,000	1.955	199,410.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	13,350	28.960	386,616.000	
MACQUARIE GROUP LTD	9,184	138.050	1,267,851.200	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	17,450	33.920	591,904.000	
CSL LTD	12,750	283.480	3,614,370.000	
WESFARMERS LTD	32,300	42.370	1,368,551.000	
COCHLEAR LTD	1,650	233.990	386,083.500	
BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	14.550	237,165.000	
SUNCORP GROUP LTD	38,257	13.380	511,878.660	
BORAL LTD	35,800	5.140	184,012.000	
ASX LTD	5,800	81.710	473,918.000	
COMPUTERSHARE LTD	13,900	17.730	246,447.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	4.300	60,200.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	70,936	7.890	559,685.040	
SONIC HEALTHCARE LTD	13,250	30.120	399,090.000	
CHALLENGER LTD	17,400	8.140	141,636.000	
WORLEY LTD	9,400	15.000	141,000.000	
AGL ENERGY LTD	19,000	20.410	387,790.000	
BRAMBLES LTD	47,400	12.550	594,870.000	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	44.030	61,642.000	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,250	72.980	310,165.000	

	TPG TELECOM LTD	8,700	6.990	60,813.000	
	REA GROUP LTD	1,600	104.360	166,976.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	3,800	52.490	199,462.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 37,167,875.560 (2,759,714,760)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	8,300	33.260	276,058.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	600	1,420.010	852,006.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,996	13.700	82,145.200	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	7,187	87.270	627,209.490	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13,200	36.500	481,800.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,050	136.970	554,728.500	
	BCE INC	4,530	63.940	289,648.200	
	FRANCO-NEVADA CORP	5,700	130.670	744,819.000	
	SUNCOR ENERGY INC	44,430	41.430	1,840,734.900	
	METRO INC/CN	7,700	58.180	447,986.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	9,500	71.150	675,925.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	34,600	74.940	2,592,924.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	12,550	115.460	1,449,023.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	51,600	76.590	3,952,044.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,300	33.450	277,635.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	40,550	108.730	4,409,001.500	
	TC ENERGY CORP	26,150	67.200	1,757,280.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	14,629	46.380	678,493.020	
	BOMBARDIER INC-B	62,800	1.970	123,716.000	
	BARRICK GOLD CORP	51,400	22.180	1,140,052.000	
	CAE INC	7,900	35.690	281,951.000	
	THOMSON REUTERS CORP	5,812	92.880	539,818.560	
	EMPIRE CO LTD 'A'	5,300	35.570	188,521.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	57.770	92,432.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,650	56.810	264,166.500	
	HYDRO ONE LTD	9,200	25.020	230,184.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	71.600	390,936.000	
	WSP GLOBAL INC	3,000	85.730	257,190.000	
	PARKLAND FUEL CORP	4,400	47.220	207,768.000	
	QUEBECOR INC -CL B	5,300	32.940	174,582.000	

EMERA INC	7,200	54.620	393,264.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,000	39.060	156,240.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	10,600	64.420	682,852.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	7,200	78.920	568,224.000	
STARS GROUP INC/THE	6,300	31.830	200,529.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	15,000	18.630	279,450.000	
AIR CANADA	4,100	50.050	205,205.000	
KINROSS GOLD CORP	37,900	5.740	217,546.000	
BANK OF MONTREAL	18,000	102.220	1,839,960.000	
POWER CORP OF CANADA	9,400	32.240	303,056.000	
METHANEX CORP	1,700	49.430	84,031.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	2,800	445.450	1,247,260.000	
NUTRIEN LTD	16,519	62.700	1,035,741.300	
AURORA CANNABIS INC	19,800	3.320	65,736.000	
CANOPY GROWTH CORP	6,200	24.510	151,962.000	
CRONOS GROUP INC	5,500	9.030	49,665.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,800	55.790	323,582.000	
CAMECO CORP	10,600	12.100	128,260.000	
TELUS CORP	5,400	50.150	270,810.000	
POWER FINANCIAL CORP	8,000	32.480	259,840.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	15,100	20.800	314,080.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	154.760	278,568.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	35,100	37.110	1,302,561.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	800	600.010	480,008.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,200	73.180	673,256.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,237	108.040	241,685.480	
BLACKBERRY LTD	16,000	7.330	117,280.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	17,450	60.610	1,057,644.500	
ENBRIDGE INC	57,100	50.300	2,872,130.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	23,950	76.850	1,840,557.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	56,000	26.130	1,463,280.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	9,500	37.520	356,440.000	
ENCANA CORP	36,800	5.210	191,728.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,900	314.570	1,226,823.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,300	68.000	224,400.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,300	39.000	245,700.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	20,450	120.610	2,466,474.500	

	CGI INC - CLASS A	7,300	110.070	803,511.000	
	HUSKY ENERGY INC	9,358	9.670	90,491.860	
	ONEX CORPORATION	2,600	79.100	205,660.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,800	27.450	378,810.000	
	IGM FINANCIAL INC	2,400	38.200	91,680.000	
	OPEN TEXT CORP	8,100	57.830	468,423.000	
	CI FINANCIAL CORP	7,000	20.920	146,440.000	
	SAPUTO INC	7,100	40.150	285,065.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	12.150	234,495.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	25,600	43.460	1,112,576.000	
	FORTIS INC	13,000	52.040	676,520.000	
	LUNDIN MINING CORP	19,400	7.190	139,486.000	
	CENOVUS ENERGY INC	31,400	11.740	368,636.000	
	DOLLARAMA INC	9,000	48.590	437,310.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,200	50.390	110,858.000	
	ALTAGAS LTD	7,900	19.700	155,630.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,800	21.580	103,584.000	
	KEYERA CORP	6,000	32.410	194,460.000	
	INTER PIPELINE LTD	12,800	22.000	281,600.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 55,981,843.010 (4,625,219,869)	
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	34,800	25.820	898,536.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	49,700	25.250	1,254,925.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	14,970	9.190	137,574.300	
	KEPPEL CORP LTD	42,900	6.720	288,288.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	7.760	108,640.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	13,600	10.340	140,624.000	
	CAPITALAND LTD	77,500	3.680	285,200.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	69,300	1.030	71,379.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	51,400	2.200	113,080.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	30.640	82,728.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	93,700	10.780	1,010,086.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	170,000	0.925	157,250.000	
	VENTURE CORP LTD	8,600	15.870	136,482.000	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	225,450	3.380	762,021.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	44,000	4.130	181,720.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	28,800	2.190	63,072.000	
	SATS LTD	19,600	4.980	97,608.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	23,300	8.850	206,205.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	64,800	2.350	152,280.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	58,900	4.090	240,901.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 6,388,599.300 (512,429,550)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFRY AG-REG	1,250	97.580	121,975.000	
	UBS GROUP AG-REG	110,400	12.120	1,338,048.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	230	620.500	142,715.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,650	61.820	287,463.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	19,940	308.200	6,145,508.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,100	78.900	86,790.000	
	SIKA AG-REG	3,840	174.050	668,352.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	85,300.000	255,900.000	
	ABB LTD-REG	53,800	21.870	1,176,606.000	
	SWISS RE AG	9,000	108.300	974,700.000	
	NESTLE SA-REG	86,900	103.920	9,030,648.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	520	843.200	438,464.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,260	249.300	314,118.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	75,170	13.105	985,102.850	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,400	47.080	301,312.000	
	SGS SA-REG	160	2,602.000	416,320.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	580	239.200	138,736.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,300	178.300	231,790.000	
	TEMENOS AG - REG	1,970	151.700	298,849.000	
	ALCON INC	12,430	55.210	686,260.300	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	850	280.000	238,000.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,472	392.300	1,754,365.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	173.800	241,582.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	20.660	117,762.000	
	NOVARTIS AG-REG	61,050	92.060	5,620,263.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	70	2,010.000	140,700.000	

	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	15,310	76.160	1,166,009.600	
	SWISSCOM AG-REG	770	517.600	398,552.000	
	GEBERIT AG-REG	1,130	536.800	606,584.000	
	GIVAUDAN-REG	260	2,939.000	764,140.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	962.000	278,980.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,690	228.300	385,827.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,200	339.600	747,120.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	53.300	81,016.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	14,290	51.560	736,792.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,040	495.800	515,632.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,670	162.600	271,542.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,330	105.600	246,048.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	7,625.000	259,250.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 38,609,822.750 (4,231,250,475)	
スウェーデン・クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	ICA GRUPPEN AB	2,700	418.000	1,128,600.000	
	ERICSSON LM-B SHS	85,630	86.300	7,389,869.000	
	VOLVO AB-B SHS	41,400	148.050	6,129,270.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,800	428.400	771,120.000	
	SKF AB-B SHARES	10,550	182.900	1,929,595.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,650	246.100	1,636,565.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,900	458.700	2,247,630.000	
	TELE2 AB-B SHS	15,600	141.300	2,204,280.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	48,250	82.120	3,962,290.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	46,550	94.000	4,375,700.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	26,600	124.700	3,317,020.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	23,550	184.840	4,352,982.000	
	SKANSKA AB-B SHS	10,250	211.600	2,168,900.000	
	SANDVIK AB	33,150	174.150	5,773,072.500	
	INVESTOR AB-B SHS	12,700	506.200	6,428,740.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	18,450	350.900	6,474,105.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,550	158.800	1,516,540.000	
	TELIA CO AB	83,000	41.450	3,440,350.000	
	ALFA LAVAL AB	8,800	235.600	2,073,280.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	11,250	309.600	3,483,000.000	

	ASSA ABLOY AB-B	29,350	227.400	6,674,190.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,200	379.600	835,120.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,250	295.200	1,549,800.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	16,850	301.000	5,071,850.000	
	BOLIDEN AB	7,800	247.000	1,926,600.000	
	EPIROC AB-A	20,650	111.800	2,308,670.000	
	EPIROC AB-B	11,600	107.650	1,248,740.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,450	74.780	856,231.000	
	NORDEA BANK ABP	89,700	67.830	6,084,351.000	
	KINNEVIK AB - B	7,300	219.300	1,600,890.000	
	HEXAGON AB-B SHS	7,200	541.400	3,898,080.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,600	222.100	1,021,660.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 103,879,090.500 (1,190,454,377)	
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	50,600	381.200	19,288,720.000	
	DANSKE BANK A/S	18,400	91.560	1,684,704.000	
	ISS A/S	4,400	155.650	684,860.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	8,805.000	836,475.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	259.800	441,660.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,600	645.400	3,614,240.000	
	CARLSBERG AS-B	3,000	975.600	2,926,800.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,400	324.000	2,073,600.000	
	COLOPLAST-B	3,350	801.200	2,684,020.000	
	DSV PANALPINA A/S	6,210	738.400	4,585,464.000	
	DEMANT A/S	3,425	207.500	710,687.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	200	9,478.000	1,895,600.000	
	TRYG A/S	3,300	195.000	643,500.000	
	PANDORA A/S	3,150	273.000	859,950.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,050	515.000	1,570,750.000	
	GENMAB A/S	1,950	1,580.000	3,081,000.000	
	ORSTED A/S	5,500	625.000	3,437,500.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 51,019,530.500 (824,985,808)	
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	4.710	162,495.000	

	MERCURY NZ LTD	23,000	4.800	110,400.000	
	A2 MILK CO LTD	21,400	15.520	332,128.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	4.540	239,208.060	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	29,400	9.030	265,482.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	5.230	105,123.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	18,700	22.150	414,205.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	11,800	15.100	178,180.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 1,807,221.060 (127,644,023)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	41,700	32.600	1,359,420.000	
	DNB ASA	28,100	154.800	4,349,880.000	
	ORKLA ASA	21,950	89.260	1,959,257.000	
	TELENOR ASA	20,800	168.200	3,498,560.000	
	EQUINOR ASA	27,973	169.800	4,749,815.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,960	347.500	1,723,600.000	
	MOWI ASA	12,850	228.600	2,937,510.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	5,550	173.450	962,647.500	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,100	237.600	736,560.000	
	AKER BP ASA	2,900	264.300	766,470.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 23,043,719.900 (274,220,267)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	26,820	68.700	1,842,534.000	
	EVONIK INDUSTRIES AG	5,300	26.340	139,602.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	59,350	6.544	388,386.400	
	COMMERZBANK AG	28,135	5.261	148,018.230	
	VOLKSWAGEN AG	890	173.150	154,103.500	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	5,270	175.480	924,779.600	
	SIEMENS AG-REG	21,750	117.120	2,547,360.000	
	E.ON SE	64,200	9.498	609,771.600	
	UNIPER SE	5,950	29.300	174,335.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,850	73.300	722,005.000	
	GEA GROUP AG	4,500	29.170	131,265.000	
	CONTINENTAL AG	3,170	118.600	375,962.000	
	BASF SE	26,170	68.220	1,785,317.400	

ALLIANZ SE-REG	12,040	217.350	2,616,894.000	
THYSSENKRUPP AG	11,450	11.380	130,301.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,200	95.880	498,576.000	
RWE AG	16,250	26.910	437,287.500	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,650	17.220	114,513.000	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	77.320	91,237.600	
BRENNTAG AG	4,700	48.410	227,527.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	12,200	49.640	605,608.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	30.750	102,090.000	
HOCHTIEF AG	710	111.500	79,165.000	
SAP SE	27,992	123.480	3,456,452.160	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,160	260.600	1,084,096.000	
ZALANDO SE	3,550	39.100	138,805.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	4,500	67.100	301,950.000	
KION GROUP AG	1,850	60.220	111,407.000	
WIRECARD AG	3,470	119.800	415,706.000	
COVESTRO AG	5,200	42.500	221,000.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,050	191.300	200,865.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	4,650	67.180	312,387.000	
DELIVERY HERO SE	3,200	48.000	153,600.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	111.000	138,750.000	
METRO AG	5,000	14.625	73,125.000	
AROUNDTOWN SA	27,100	7.882	213,602.200	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,500	44.020	198,090.000	
KNORR-BREMSE AG	1,450	88.280	128,006.000	
BEIERSDORF AG	3,090	105.850	327,076.500	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,950	39.200	76,440.000	
MERCK KGAA	3,750	106.000	397,500.000	
ADIDAS AG	5,120	282.750	1,447,680.000	
PUMA SE	2,360	68.200	160,952.000	
HENKEL AG & CO KGAA	3,100	87.800	272,180.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	95,950	15.236	1,461,894.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,270	66.560	417,331.200	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	26,100	51.200	1,336,320.000	
QIAGEN N.V.	6,498	38.860	252,512.280	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	37,150	19.388	720,264.200	

HANNOVER RUECK SE	1,730	168.500	291,505.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	29,200	33.840	988,128.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,640	139.250	785,370.000	
LANXESS AG	2,500	60.500	151,250.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,530	245.900	376,227.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	10,600	35.450	375,770.000	
SYMRISE AG	3,920	88.040	345,116.800	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	26,300	2.771	72,877.300	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,550	56.000	86,800.000	
VONOVIA SE	15,300	47.290	723,537.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	26,426	42.145	1,113,723.770	
NN GROUP NV	9,050	34.840	315,302.000	
ARCELORMITTAL	20,300	15.528	315,218.400	
HEINEKEN NV	7,600	94.040	714,704.000	
AEGON NV	53,644	4.092	219,511.240	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	33,633	23.385	786,507.700	
AKZO NOBEL N.V.	6,538	86.920	568,282.960	
KONINKLIJKE DSM NV	5,300	116.300	616,390.000	
WOLTERS KLUWER	8,300	65.160	540,828.000	
ING GROEP NV	111,050	10.444	1,159,806.200	
KONINKLIJKE KPN NV	100,950	2.796	282,256.200	
ASML HOLDING NV	12,060	247.000	2,978,820.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	11,700	15.490	181,233.000	
GALAPAGOS NV	1,300	178.850	232,505.000	
ADYEN NV	300	696.200	208,860.000	
UNILEVER NV	41,600	53.800	2,238,080.000	
PROSUS NV	14,500	61.870	897,115.000	
VOPAK	1,900	48.390	91,941.000	
RANDSTAD NV	3,200	52.860	169,152.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,400	87.000	295,800.000	
ALTICE EUROPE NV	20,500	5.402	110,741.000	
JCDECAUX SA	1,900	26.000	49,400.000	
TOTAL SA	67,950	47.640	3,237,138.000	
MICHELIN (CGDE)	5,000	108.900	544,500.000	
AIR LIQUIDE SA	13,477	123.050	1,658,344.850	
KERING	2,180	546.700	1,191,806.000	

SCHNEIDER ELECTRIC SE	15,650	87.600	1,370,940.000	
BOUYGUES SA	6,700	37.080	248,436.000	
BNP PARIBAS	32,050	50.970	1,633,588.500	
PEUGEOT SA	17,550	21.920	384,696.000	
NATIXIS	29,550	3.793	112,083.150	
THALES SA	3,230	88.920	287,211.600	
DANONE	17,600	74.720	1,315,072.000	
CARREFOUR SA	17,000	14.980	254,660.000	
SUEZ	9,925	13.435	133,342.370	
VIVENDI	26,891	24.920	670,123.720	
L'OREAL	7,170	258.700	1,854,879.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	14,550	36.750	534,712.500	
LEGRAND SA	8,017	71.680	574,658.560	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	39.940	61,907.000	
PERNOD RICARD SA	6,087	166.700	1,014,702.900	
EURAZEO SE	1,254	61.850	77,559.900	
SOCIETE GENERALE SA	22,050	28.560	629,748.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,930	407.300	3,229,889.000	
ACCOR SA	5,350	38.830	207,740.500	
CAPGEMINI SE	4,770	107.350	512,059.500	
VALEO SA	7,150	35.760	255,684.000	
PUBLICIS GROUPE	6,400	39.940	255,616.000	
BUREAU VERITAS SA	8,800	23.760	209,088.000	
EIFFAGE	2,340	99.100	231,894.000	
SODEXO SA	2,700	105.800	285,660.000	
IPSEN	1,150	102.500	117,875.000	
INGENICO GROUP	1,800	96.860	174,348.000	
AMUNDI SA	1,700	68.700	116,790.000	
TELEPERFORMANCE	1,770	215.000	380,550.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,450	55.100	134,995.000	
FAURECIA	2,250	48.140	108,315.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	320	476.600	152,512.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	800	144.100	115,280.000	
SEB SA	650	141.000	91,650.000	
ESSILORLUXOTTICA	8,300	141.000	1,170,300.000	
DASSAULT AVIATION SA	80	1,235.000	98,800.000	
WORLDLINE SA	2,364	58.750	138,885.000	
AXA SA	55,350	24.695	1,366,868.250	

EDENRED	6,900	45.050	310,845.000	
RENAULT SA	5,800	43.455	252,039.000	
HERMES INTERNATIONAL	900	680.000	612,000.000	
STMICROELECTRONICS NV	19,950	22.300	444,885.000	
REMY COINTREAU	630	116.900	73,647.000	
ATOS SE	2,960	77.080	228,156.800	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,980	143.000	569,140.000	
WENDEL	780	122.300	95,394.000	
ORANGE	58,300	15.000	874,500.000	
ALSTOM	4,450	39.580	176,131.000	
CNP ASSURANCES	4,850	17.920	86,912.000	
SANOFI	31,875	84.510	2,693,756.250	
VINCI SA	14,550	98.980	1,440,159.000	
AIRBUS SE	16,550	133.400	2,207,770.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	16,450	23.240	382,298.000	
CREDIT AGRICOLE SA	34,300	12.415	425,834.500	
BIOMERIEUX	1,150	82.050	94,357.500	
ENGIE	52,123	14.360	748,486.280	
EDF	17,050	9.324	158,974.200	
SES	11,000	12.045	132,495.000	
SAFRAN SA	9,320	148.450	1,383,554.000	
ILIAD SA	740	115.550	85,507.000	
ARKEMA	1,920	94.060	180,595.200	
ADP	910	177.500	161,525.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,700	14.890	69,983.000	
SCOR SE	4,950	38.990	193,000.500	
GETLINK SE	12,400	15.310	189,844.000	
BOLLORE	24,100	3.880	93,508.000	
UCB SA	3,550	73.560	261,138.000	
KBC GROUP NV	7,450	66.140	492,743.000	
COLRUYT SA	1,600	47.000	75,200.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,200	92.100	202,620.000	
SOLVAY SA	2,200	104.000	228,800.000	
UMICORE	5,800	38.980	226,084.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	21,600	71.870	1,552,392.000	
AGEAS	5,240	54.480	285,475.200	
PROXIMUS	4,100	27.380	112,258.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	40.960	59,392.000	
PRYSMIAN SPA	6,850	20.690	141,726.500	

ASSICURAZIONI GENERALI	31,543	18.530	584,491.790	
MEDIOBANCA SPA	17,065	10.150	173,209.750	
TENARIS SA	13,300	9.652	128,371.600	
UNICREDIT SPA	57,656	12.562	724,274.670	
TELECOM ITALIA SPA	262,982	0.568	149,426.370	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.559	96,120.050	
INTESA SANPAOLO	426,237	2.300	980,558.210	
ATLANTIA SPA	14,657	20.120	294,898.840	
POSTE ITALIANE SPA	16,000	10.590	169,440.000	
MONCLER SPA	5,150	39.770	204,815.500	
RECORDATI SPA	3,050	38.070	116,113.500	
ENI SPA	72,500	13.714	994,265.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	16,200	8.285	134,217.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	5.150	56,650.000	
LEONARDO SPA	10,975	10.615	116,499.620	
ENEL SPA	230,734	6.856	1,581,912.300	
SNAM SPA	61,600	4.512	277,939.200	
TERNA SPA	42,800	5.830	249,524.000	
EXOR NV	3,230	69.440	224,291.200	
CNH INDUSTRIAL NV	29,800	9.728	289,894.400	
FINECOBANK SPA	18,000	11.260	202,680.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	32,350	13.420	434,137.000	
FERRARI NV	3,495	153.400	536,133.000	
TELEFONICA SA	132,027	6.952	917,851.700	
ENDESA SA	9,250	24.680	228,290.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	191,012	4.781	913,323.870	
IBERDROLA SA	170,334	8.928	1,520,741.950	
BANCO DE SABADELL SA	160,109	1.007	161,229.760	
BANKINTER SA	18,300	6.348	116,168.400	
REPSOL SA	41,800	14.290	597,322.000	
GRIFOLS SA	8,500	31.010	263,585.000	
BANCO SANTANDER SA	477,250	3.537	1,688,033.250	
AMADEUS IT GROUP SA	12,350	72.300	892,905.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	23.600	221,840.000	
MAPFRE SA	30,650	2.559	78,433.350	
CAIXABANK SA	109,300	2.679	292,814.700	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	35.330	278,259.080	

	AENA SME SA	2,000	166.700	333,400.000	
	CELLNEX TELECOM SA	5,800	39.000	226,200.000	
	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	32,300	28.260	912,798.000	
	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	6,650	14.485	96,325.250	
	ENAGAS SA	6,900	22.610	156,009.000	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	12,550	17.750	222,762.500	
	FERROVIAL SA	14,200	26.950	382,690.000	
	BANKIA SA	30,105	1.758	52,939.640	
	UPM-KYMMENE OYJ	15,600	30.320	472,992.000	
	NOKIA OYJ	158,500	3.211	509,022.750	
	WARTSILA OYJ ABP	12,000	9.136	109,632.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	17,050	12.200	208,010.000	
	METSO OYJ	2,800	34.800	97,440.000	
	ELISA OYJ	4,150	48.510	201,316.500	
	SAMPO OYJ-A SHS	12,500	36.700	458,750.000	
	FORTUM OYJ	13,850	21.390	296,251.500	
	KONE OYJ-B	9,900	56.820	562,518.000	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	3,650	24.560	89,644.000	
	NESTE OYJ	12,050	30.680	369,694.000	
	ORION OYJ-CLASS B	2,750	39.500	108,625.000	
	VERBUND AG	2,000	47.180	94,360.000	
	OMV AG	4,450	51.740	230,243.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	8,700	32.500	282,750.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	24.050	68,542.500	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	21.310	72,454.000	
	ANDRITZ AG	2,100	35.400	74,340.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,800	32.200	218,960.000	
	AIB GROUP PLC	23,000	2.970	68,310.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	27,460	4.560	125,217.600	
	KINGSPAN GROUP PLC	4,400	48.920	215,248.000	
	JERONIMO MARTINS	6,000	14.495	86,970.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	74,700	3.670	274,149.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	13,950	14.775	206,111.250	
	KERRY GROUP PLC-A	4,570	116.400	531,948.000	
	CRH PLC	23,100	34.730	802,263.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,200	104.000	228,800.000	

ユーロ　小計				ユーロ 118,633,771.920 (14,338,077,674)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	40,500	54.450	2,205,225.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	51.200	3,328,000.000	
	MTR CORP	45,500	43.900	1,997,450.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	45,500	113.900	5,182,450.000	
	SINO LAND CO	90,000	11.740	1,056,600.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	77,169	71.100	5,486,715.900	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	15,500	70.450	1,091,975.000	
	CLP HOLDINGS LTD	47,000	80.700	3,792,900.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	43,507	37.650	1,638,038.550	
	HONG KONG & CHINA GAS	290,199	14.920	4,329,769.080	
	HANG SENG BANK LTD	22,500	159.600	3,591,000.000	
	WHEELOCK & CO LTD	24,000	48.650	1,167,600.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	183,000	10.220	1,870,260.000	
	WH GROUP LTD	295,000	8.040	2,371,800.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	33,700	247.200	8,330,640.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	16.040	914,280.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	9,300	102.200	950,460.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	19,000	23.150	439,850.000	
	NWS HOLDINGS LTD	42,500	10.500	446,250.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	17,500	25.250	441,875.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	36,640	17.660	647,062.400	
	SJM HOLDINGS LTD	58,000	7.980	462,840.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	32,600	24.350	793,810.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	74,169	52.050	3,860,496.450	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20,000	53.000	1,060,000.000	
	PCCW LTD	117,000	4.720	552,240.000	
	AIA GROUP LTD	373,000	78.400	29,243,200.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	36,000	43.450	1,564,200.000	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	22,000	30.100	662,200.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	34,400	27.900	959,760.000	
	SANDS CHINA LTD	72,000	37.000	2,664,000.000	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	41,000	58.850	2,412,850.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	107,500	26.600	2,859,500.000	
	WYNN MACAU LTD	42,000	17.220	723,240.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 99,098,537.380 (1,388,370,509)	
合計				121,306,145,522 [121,306,145,522]	

(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	3,867	829,123.470	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	8,887	1,343,803.270	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,250	588,795.000	
		VORNADO REALTY TRUST	5,097	329,113.290	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,150	744,880.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	10,700	910,570.000	
		EQUINIX INC	2,288	1,296,952.800	
		AMERICAN TOWER CORP	12,450	2,664,673.500	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	21,943	383,783.070	
		KIMCO REALTY CORP	12,600	272,412.000	
		INVITATION HOMES INC	12,700	387,731.000	
		VICI PROPERTIES INC	13,500	333,855.000	
		VENTAS INC	10,500	612,255.000	
		WEYERHAEUSER CO	21,164	624,549.640	
		AGNC INVESTMENT CORP	15,300	264,996.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	11,750	1,570,505.000	
		IRON MOUNTAIN INC	8,210	263,705.200	
		VEREIT INC	29,300	285,968.000	
		SUN COMMUNITIES INC	2,750	452,952.500	
		PROLOGIS INC	17,812	1,630,688.600	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,070	498,936.400	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,900	323,495.000	
		DUKE REALTY CORP	10,200	358,836.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,950	608,751.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,200	290,554.000	
		WELLTOWER INC	11,450	968,326.500	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	14,350	500,528.000	

	LIBERTY PROPERTY TRUST	4,400	271,128.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,250	442,357.500	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,800	355,584.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	43,700	407,721.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,550	253,617.000	
	REALTY INCOME CORP	8,900	682,007.000	
	PUBLIC STORAGE	4,370	920,671.600	
	REGENCY CENTERS CORP	4,950	321,948.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,400	204,792.000	
	UDR INC	8,100	389,205.000	
	WP CAREY INC	5,100	425,442.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,400	268,992.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	6,050	731,747.500	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,750	397,687.500	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	13,000	269,880.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 25,683,519.840 (2,816,968,456)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,662	207,608.600	
	SEGRO PLC	33,150	296,361.000	
	BRITISH LAND CO PLC	25,550	147,065.800	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 651,035.400 (92,180,102)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	17,000	328,270.000	
	TRANSURBAN GROUP	76,500	1,174,275.000	
	SYDNEY AIRPORT	33,300	305,694.000	
	APA GROUP	35,800	393,800.000	
	SCENTRE GROUP	153,922	606,452.680	
	DEXUS	33,150	405,424.500	
	GPT GROUP	56,160	345,384.000	
	MIRVAC GROUP	111,600	376,092.000	
	STOCKLAND	72,000	363,600.000	
	GOODMAN GROUP	50,100	742,482.000	
	VICINITY CENTRES	99,273	266,051.640	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル	

				5,307,525.820 (394,083,792)	
	カナダ・ドル			カナダ・ドル	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,100	67,263.000	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,400	133,056.000	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,700	79,846.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	127,558.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 407,723.000 (33,686,074)	
	シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	79,600	159,996.000	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	76,000	226,480.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	77,200	194,544.000	
		SUNTEC REIT	63,000	115,920.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	65,500	154,580.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 851,520.000 (68,300,419)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,950	560,505.000	
		ICADE	950	86,307.500	
		GECINA SA	1,400	219,520.000	
		KLEPIERRE	6,250	203,562.500	
		COVIVIO	1,270	127,508.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 1,197,403.000 (144,718,127)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	62,500	5,000,000.000	
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	75,000	575,250.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	107,000	1,228,360.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 6,803,610.000 (95,318,576)	
投資証券　合計				3,645,255,546 [3,645,255,546]	
合計				3,645,255,546 [3,645,255,546]	

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 612銘柄 投資証券 42銘柄	96.7%	3.3%	69.1%
イギリス・ポンド	株式 93銘柄 投資証券 3銘柄	98.8%	1.2%	5.9%
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	87.5%	12.5%	2.5%
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 4銘柄	99.3%	0.7%	3.7%
シンガポール・ドル	株式 20銘柄 投資証券 5銘柄	88.2%	11.8%	0.5%
スイス・フラン	株式 39銘柄	100%	-%	3.4%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	100%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	100%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式 8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 235銘柄 投資証券 5銘柄	99.0%	1.0%	11.6%
香港・ドル	株式 34銘柄 投資証券 3銘柄	93.6%	6.4%	1.2%

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11月30日現在	2019年12月2日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	535,407,915	1,082,925,447
金銭信託	434,501,630	―
コール・ローン	845,004,586	1,729,159,455
国債証券	166,684,616,502	187,330,033,946
派生商品評価勘定	4,699,833	4,341,690
未収入金	61,730,533	2,827,376,943
未収利息	1,269,292,926	1,281,708,922
前払費用	31,365,717	46,960,770
流動資産合計	169,866,619,642	194,302,507,173
資産合計	169,866,619,642	194,302,507,173
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	805,659	1,600,751
未払金	170,363,464	3,832,899,493
未払解約金	115,688,147	3,405,669
その他未払費用	8,906	987
流動負債合計	286,866,176	3,837,906,900
負債合計	286,866,176	3,837,906,900
純資産の部		
元本等		
元本　※1	61,445,933,589	66,118,107,712
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	108,133,819,877	124,346,492,561
元本等合計	169,579,753,466	190,464,600,273
純資産合計	169,579,753,466	190,464,600,273
負債純資産合計	169,866,619,642	194,302,507,173

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2018年12月1日 至　2019年12月2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11月30日現在	2019年12月2日現在
1．※1　期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	59,383,778,765円	61,445,933,589円
期中追加設定元本額	6,447,535,619円	8,771,520,025円
期中一部解約元本額	4,385,380,795円	4,099,345,902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	694,267,908円	653,486,435円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	26,063,629円	22,093,366円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	173,213,023円	128,330,909円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	53,368,772円	41,751,987円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	565,112,790円	442,528,295円
外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	2,177,730円	31,239,348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）	365,893,917円	413,208,724円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	1,077,780,230円	1,427,469,459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）	706,169,298円	787,285,961円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	731,384円	2,452,065円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	27,109円	314,458円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	496,757,292円	600,033,543円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	484,130,513円	772,093,354円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	4,278,927円	14,937,740円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	42,443,714,064円	45,506,848,020円
ダイワ・ライフ・バランス３０	739,083,378円	786,129,849円
ダイワ・ライフ・バランス５０	367,446,516円	407,847,078円

ダイワ・ライフ・バランス７０	237,136,801円	255,622,913円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	329,247,490円	420,775,557円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	263,447,011円	323,134,588円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	82,424,940円	107,264,235円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	10,493,771円	9,559,864円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	18,731,042円	21,464,206円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	1,851,074円	3,128,858円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,192,484円	59,508,551円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	125,482円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	40,800円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	－円	199,958円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	249,101,467円	198,065,881円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	154,628,203円	149,085,433円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	5,694,073,062円	4,935,026,873円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	17,320,918円	－円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	8,186,659円	－円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	328,670,549円	282,957,531円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	142,930,521円	144,999,465円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	28,480,694円	32,445,382円

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	27,731,702円	1,312,096,170円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,534,667,082円	5,710,869,559円
ダイワライフスタイル２５	35,273,760円	34,837,008円
ダイワライフスタイル５０	62,560,835円	61,720,946円
ダイワライフスタイル７５	17,567,044円	17,127,861円
計	61,445,933,589円	66,118,107,712円
2. 期末日における受益権の総数	61,445,933,589口	66,118,107,712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12月1日 至　2019年12月2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12月2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11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△4,928,875,517	11,319,542,417
合計	△4,928,875,517	11,319,542,417

（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11月30日まで、及び2018年12月1日から2019年12月2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11月30日 現在				2019年12月2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								
売　建	69,008,100	－	69,079,500	△71,400	792,943,342	－	794,138,360	△1,195,018
アメリカ・ドル	－	－	－	－	692,834,338	－	693,818,820	△984,482

オーストラリア・ドル	－	－	－	－	88,958,190	－	89,162,240	△204,050
デンマーク・クローネ	－	－	－	－	11,150,814	－	11,157,300	△6,486
マレーシア・リンギット	69,008,100	－	69,079,500	△71,400	－	－	－	－
買 建	1,116,303,096	－	1,120,268,670	3,965,574	2,973,436,433	－	2,977,372,390	3,935,957
アメリカ・ドル	420,678,874	－	421,248,390	569,516	823,263,537	－	824,358,700	1,095,163
イギリス・ポンド	54,194,703	－	54,223,290	28,587	252,244,214	－	252,213,690	△30,524
オーストラリア・ドル	24,749,923	－	25,413,300	663,377	6,661,404	－	6,668,100	6,696
カナダ・ドル	65,526,746	－	65,238,610	△288,136	71,898,106	－	72,050,790	152,684
シンガポール・ドル	12,449,089	－	12,677,580	228,491	54,130,613	－	54,182,700	52,087
スウェーデン・クローナ	－	－	－	－	25,859,325	－	25,859,330	5
デンマーク・クローネ	28,512,966	－	28,786,530	273,564	－	－	－	－
ノルウェー・クローネ	－	－	－	－	42,874,854	－	42,731,410	△143,444
ポーランド・ズロチ	10,559,159	－	10,816,670	257,511	45,895,875	－	46,015,630	119,755
マレーシア・リンギット	－	－	－	－	15,757,800	－	15,738,000	△19,800
メキシコ・ペソ	－	－	－	－	72,071,067	－	71,975,920	△95,147
ユーロ	499,631,636	－	501,864,300	2,232,664	1,501,277,606	－	1,503,729,120	2,451,514
南アフリカ・ランド	－	－	－	－	61,502,032	－	61,849,000	346,968
合計	1,185,311,196	－	1,189,348,170	3,894,174	3,766,379,775	－	3,771,510,750	2,740,939

（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11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.7598円 (27,598円)	2.8807円 (28,807円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,170,400.160	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,605,106.710	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,553,486.460	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,168,544.660	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,249,308.400	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,467,729.450	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,544,881.820	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	8,168,000.000	8,171,430.560	

		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,403,679.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,704,723.850	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,711,800.640	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,234,392.500	
		2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,509,303.320	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,020,804.280	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,463,050.040	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,655,745.570	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,740,363.780	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,841,593.300	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,094,628.160	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	7,907,000.000	7,967,804.830	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,745,332.160	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,510,022.300	
		8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,360,931.300	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	762,138.900	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,071,084.150	
		6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	827,662.500	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	940,311.250	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	910,595.000	

		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	950,573.520	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	773,000.000	1,001,576.100	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,373,844.600	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,091,000.000	1,486,356.580	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,326,000.000	1,798,069.260	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	747,000.000	1,082,447.820	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	746,091.040	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	718,446.510	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,535,870.320	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,513,787.190	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,477,205.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,663,084.500	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	2,010,000.000	2,852,772.900	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	2,037,895.960	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	2,061,204.140	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,998,750.780	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,542,738.720	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,891,152.900	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,745,905.060	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,693,440.500	

		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,897,384.380	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,550,970.960	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,457,758.840	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,899,154.200	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,826,000.000	3,309,952.500	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,898,000.000	4,387,666.760	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,879,544.880	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,625,076.360	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,117,000.000	5,224,061.300	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,472,657.280	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,859,902.760	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,367,071.360	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,929,000.000	4,624,825.900	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,308,571.820	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,654,725.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,177,686.770	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,089,807.710	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	4,435,784.100	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,899,073.580	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,200,690.000	

		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,420,544.180	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,841,664.740	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,978,469.380	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,813,522.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,900,684.850	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,922,744.640	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	4,435,982.850	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,620,567.360	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,844,312.480	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,858,462.880	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,201,465.490	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,843,904.510	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	4,073,000.000	4,610,758.190	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,462,359.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,482,036.320	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,022,032.800	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	4,298,953.540	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,577,364.060	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,093,554.160	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,357,225.790	

		1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,044,521.500	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,068,826.880	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,114,746.400	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,339,545.620	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,571,781.810	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,627,783.840	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,285,704.640	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,247,338.720	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,983,927.960	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,115,866.720	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,029,000.000	6,994,347.030	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,440,224.500	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,070,807.300	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,623,553.570	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,687,742.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,500,575.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,478,500.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,975,610.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,322,780.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,507,457.200	

		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,665,294.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,666,441.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,744,138.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,379,000.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,482,880.850	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	3,013,222.680	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	6,500,000.000	6,619,275.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,976,540.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,500,375.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,809,050.500	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,538,231.300	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,405,232.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	2,014,200.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,561,500.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,529,783.600	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,025,260.700	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,541,603.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,128,258.850	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,025,260.700	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,346,000.000	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	7,550,000.000	7,704,473.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,917,197.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,958,723.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	4,075,575.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,018,030.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,046,620.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,010,530.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,800,000.000	5,891,930.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,011,940.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,437,872.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,119,362.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,920,155.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,064,440.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	4,224,498.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,201,984.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,021,860.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,519,125.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	1,500,000.000	1,533,045.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,528,125.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,707,955.000	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	3,893,470.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,600,870.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	2,003,660.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,272,224.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,881,368.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,307,705.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,581,480.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,782,328.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,516,500.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,403,884.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,707,848.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,848,284.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	4,197,348.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,228,352.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,982,679.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,040,447.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,523,325.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,011,104.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,072,780.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	3,040,410.000	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,593,350.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,018,750.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,774,076.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,595,500.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	5,071,650.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,587,100.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,171,780.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,350,127.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	4,550,000.000	4,730,908.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,302,464.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,200,000.000	4,904,802.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,545,400.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,661,125.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,746,808.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,807,540.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,567,095.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,680,075.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,138,270.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,066,660.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,683,375.000	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,187,800.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,093,560.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	7,300,000.000	8,120,082.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,800,000.000	6,001,488.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,500,000.000	2,526,050.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,200,130.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	5,000,000.000	5,240,200.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,855,216.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20201231	4,000,000.000	4,035,280.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,685,640.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,597,850.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,054,000.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,077,444.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,055,410.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,000,000.000	3,027,750.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,138,120.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,633,775.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,600,000.000	5,379,838.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,000,000.000	3,029,640.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,616,775.000	

		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,399,759.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,559,745.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,580,850.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,753,909.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,440,494.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,850,000.000	5,547,187.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	6,900,000.000	7,256,316.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,591,595.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,912,000.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,000,000.000	2,013,980.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,513,510.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,074,520.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,516,940.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20210630	4,700,000.000	4,697,603.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,000,000.000	4,038,400.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,014,200.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20210731	4,700,000.000	4,706,016.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,500,000.000	3,518,305.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,000,000.000	2,018,900.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	6,799,191.000	

		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,489,745.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,850,000.000	4,891,273.500	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,100,000.000	3,090,917.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,738,288.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,930,000.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	2,992,140.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20210930	5,100,000.000	5,087,046.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,483,200.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,981,010.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,880,628.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,000,000.000	2,980,290.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,550,000.000	2,543,523.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	4,500,000.000	4,468,680.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	3,000,000.000	2,993,190.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	2,000,000.000	2,073,580.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 827,399,572.600 (90,749,185,123)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
		2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,979,117.430	
		1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,500,184.720	

		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,531,241.800	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,561,045.400	
		0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,319,907.200	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,390,000.000	1,489,107.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,650,000.000	1,824,900.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,430,000.000	1,711,281.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,510,000.000	1,590,452.800	
		0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,017,220.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,300,000.000	2,502,952.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	930,000.000	1,135,716.000	
		1% United Kingdom Gilt 20240422	1,900,000.000	1,940,318.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	370,000.000	419,802.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	962,140.500	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,300,000.000	1,322,269.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	100,000.000	100,508.000	
		8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,225,357.880	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,399,139.170	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,883,638.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,815,608.960	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	3,017,520.000	

		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,380,738.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	3,288,412.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,558,090.200	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,591,891.840	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,946,000.000	3,253,128.200	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,330,000.000	1,897,112.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,697,689.900	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,251,566.600	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,490,487.000	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,510,000.000	2,251,561.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,374,000.000	2,666,796.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,490,398.400	
		3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	848,168.750	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,646,470.400	
		1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,318,160.740	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,066,000.000	2,953,966.800	
		2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,068,463.040	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,641,000.000	3,124,464.000	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,538,619.360	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,185,575.200	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド	

			85,751,187.290 (12,141,510,608)	
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	2,596,079.200	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,447,946.120	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,402,995.320	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,297,376.290	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,692,280.910	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,760,975.360	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,698,000.000	3,050,817.460	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,780,459.980	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	3,148,000.000	3,814,463.080	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,527,291.990	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	807,000.000	974,718.810	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	842,000.000	1,103,070.520	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,038,651.840	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,078,000.000	2,289,665.080	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,633,822.440	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,848,456.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,215,016.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,550,000.000	1,622,989.500	

	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,400,000.000	2,789,280.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,770,000.000	3,168,436.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	390,000.000	478,015.200	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,140,000.000	1,192,360.200	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 49,725,168.100 (3,692,093,731)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	425,000.000	591,141.000	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	586,000.000	853,971.940	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,351,536.530	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,704,531.150	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,695,977.920	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,962,447.400	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	978,829.280	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,801,393.780	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	2,200,994.390	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,251,684.350	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,466,440.650	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,297,000.000	1,656,398.700	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,202,910.480	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,369,000.000	1,370,861.840	

		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,837,000.000	1,816,297.010	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,480,000.000	2,444,213.600	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,198,038.400	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,405,915.200	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,723,750.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,250,016.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,610,208.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,000,000.000	1,017,550.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	890,000.000	991,566.800	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,305,217.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,237,416.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210201	300,000.000	301,974.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210501	1,050,000.000	1,051,669.500	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,400,840.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210801	400,000.000	399,304.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	550,000.000	537,713.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20211101	800,000.000	795,040.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	600,000.000	592,974.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	2,200,000.000	2,196,172.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 43,364,993.920	

			(3,582,815,798)	
シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	868,114.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	456,834.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	662,417.210	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	398,023.300	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	500,341.050	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	452,400.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	698,779.400	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	618,000.000	733,164.300	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	325,000.000	357,646.250	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	544,436.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	781,987.680	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	257,200.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	457,824.200	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	502,750.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	300,000.000	314,850.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	452,925.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	589,600.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	190,000.000	193,174.900	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	150,000.000	160,713.000	

シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 9,383,180.290 (752,624,891)	
スウェーデン・クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	スウェーデン・クローナ 9,095,000.000	スウェーデン・クローナ 9,578,581.150	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	6,581,686.200	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,277,470.700	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,527,638.750	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,595,000.000	6,438,166.500	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	6,138,546.400	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,872,731.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,900,000.000	4,186,962.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 54,601,783.200 (625,736,435)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 12,162,000.000	デンマーク・クローネ 23,542,469.880	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	8,103,339.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,262,998.300	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,513,000.000	7,420,195.770	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,521,414.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	4,437,404.600	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	800,000.000	822,272.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ	

			58,110,094.050 (939,640,221)	
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	7,254,126.800	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,335,505.080	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,393,812.150	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,484,288.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,389,999.800	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,556,605.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,681,580.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,250,000.000	3,357,152.500	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 34,453,069.830 (409,991,531)	
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	2,572,987.970	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,504,481.750	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,147,993.490	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,069,855.180	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,870,000.000	2,981,671.700	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,361,272.800	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,850,000.000	2,929,087.500	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,570,000.000	2,654,732.900	

		2.75% Poland Government Bond 20291025	2,040,000.000	2,177,190.000	
		Poland Government Bond 20210525	800,000.000	784,856.000	
		2.25% Poland Government Bond 20241025	1,900,000.000	1,944,042.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,104,996.050	
		5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,172,411.040	
		4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,855,028.750	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	2,750,000.000	2,910,187.500	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,788,848.760	
ポーランド・ズロチ　小計				ポーランド・ズロチ 37,959,643.390 (1,063,629,208)	
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	576,753.150	
		5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	836,390.160	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,272,958.580	
		4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,948,169.640	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,604,597.760	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,374,100.000	
		3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	882,691.250	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	754,223.870	
		4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	646,477.440	
		3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,012,301.290	

		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,447,748.580	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,209,862.320	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	682,086.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,099,565.390	
		4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	871,363.320	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	762,116.960	
		3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,182,617.820	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	869,913.400	
		3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,331,308.020	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,037,852.100	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	670,468.500	
		3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	355,970.560	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	900,000.000	916,578.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	776,835.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	919,610.300	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,186,038.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,234,404.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	800,000.000	815,720.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	768,845.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	685,752.000	

	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	671,671.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	910,000.000	943,124.000	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,100,000.000	1,268,520.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	404,736.000	
マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 33,021,369.410 (866,480,733)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	15,290,000.000	14,327,953.200	
	8% Mexican Bonos 20471107	13,300,000.000	14,328,356.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	13,000,000.000	13,088,010.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	13,300,000.000	13,866,580.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	5,000,000.000	4,977,600.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	20,633,000.000	21,421,180.600	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	26,990,677.980	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	26,468,000.000	27,171,784.120	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,244,777.840	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	19,544,000.000	21,457,553.040	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	12,194,000.000	13,684,960.380	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	26,326,000.000	26,222,538.820	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,624,882.900	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	24,424,839.080	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	19,472,164.440	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	9,944,000.000	10,427,278.400	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 276,731,136.800 (1,552,461,677)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	449,885.520	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	299,506.500	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	433,091.250	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	204,154.000	

		1.375% Finland Government Bond 20470415	400,000.000	504,568.000	
		Finland Government Bond 20220415	770,000.000	781,080.300	
		0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	317,364.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	423,183.800	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	529,815.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	530,045.000	
		Finland Government Bond 20240915	200,000.000	204,358.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	954,791.370	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,208,434.460	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	534,000.000	677,389.680	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	200,000.000	270,910.000	
		Austria Government Bond 20230715	900,000.000	917,604.000	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	612,764.200	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	940,674.600	
		Austria Government Bond 20220920	400,000.000	406,468.000	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,078,380.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,200,000.000	1,269,804.000	
		Austria Government Bond 20240715	300,000.000	306,579.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,489,627.220	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,274,000.000	1,410,267.040	

		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	957,763.320	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,392,157.640	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	944,000.000	1,168,284.960	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	440,000.000	640,464.000	
		0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	503,362.300	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,506,526.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,096,903.500	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	665,219.800	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	353,721.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,640,000.000	1,771,839.600	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	629,106.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	800,000.000	873,808.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	756,300.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,251,726.360	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,106,820.400	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,047,426.500	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,818,475.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,599,372.780	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,404,056.480	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	3,083,405.750	

		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,551,081.570	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,272,044.250	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,599,000.000	3,194,114.430	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	2,385,456.360	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,415,798.170	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,778,055.840	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,487,320.650	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	2,965,848.130	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,361,474.940	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,438,000.000	3,899,312.820	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,743,018.120	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,508,474.400	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,953,184.150	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,757,396.940	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,718,426.850	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,609,000.000	4,270,019.850	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,745,812.560	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,659,654.600	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,319,365.160	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,327,596.480	

		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,311,348.160	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,952,315.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,689,136.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,478,779.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,750,000.000	2,306,955.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,500,000.000	1,620,855.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,900,000.000	2,014,133.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,400,000.000	2,544,504.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	1,900,000.000	1,966,500.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	382,128.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20201211	700,000.000	704,599.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210312	400,000.000	403,276.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210611	100,000.000	100,971.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210910	500,000.000	505,625.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211210	200,000.000	202,596.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,591,523.460	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,416,702.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,178,072.800	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,139,564.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	730,000.000	746,191.400	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,947,557.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	2,250,000.000	2,310,007.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,200,000.000	1,234,536.000	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,605,272.800	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,173,229.500	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,633,261.410	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,855,885.440	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,483,765.340	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,664,000.000	3,319,646.720	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,427,837.500	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	4,366,965.760	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,872,603.070	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	5,631,291.480	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	2,438,971.650	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,929,007.940	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,457,100.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,946,935.300	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,699,000.000	4,583,134.980	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,918,760.420	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,438,000.000	3,968,161.940	

		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,620,583.780	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,470,176.140	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	4,087,000.000	5,174,142.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,774,453.540	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,457,587.600	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,601,000.000	2,814,125.940	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,420,000.000	5,162,471.600	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,737,000.000	3,937,228.460	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,969,000.000	3,414,914.110	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,037,000.000	1,375,642.720	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,795,317.800	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,300,000.000	3,424,080.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,060,680.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,870,000.000	2,337,051.200	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,735,400.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,250,000.000	3,023,302.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,446,440.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,424,515.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	2,400,000.000	2,417,784.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	2,150,000.000	2,470,973.500	

		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,950,000.000	3,184,820.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,400,000.000	2,452,272.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,418,424.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,500,000.000	3,027,375.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	2,500,000.000	2,640,325.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	2,200,000.000	2,246,508.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	1,800,000.000	1,808,280.000	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	688,923.680	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,831,576.530	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,612,757.650	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	900,553.500	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,549,000.000	2,790,554.480	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,555,578.640	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,548,136.420	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,564,886.400	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,504,691.700	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,549,000.000	2,610,622.640	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,693,439.280	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,343,737.350	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,420,340.520	

		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,215,888.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,300,896.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,432,508.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,254,466.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,100,000.000	1,149,841.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	400,000.000	429,716.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,475,569.900	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,579,419.000	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,378,102.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,979,273.540	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,629,000.000	1,961,967.600	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,676,745.990	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,756,571.880	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,797,829.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,023,615.830	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,557,873.280	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,583,251.200	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,410,780.050	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,870,281.340	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,686,973.500	

		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	979,828.080	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	2,068,000.000	2,115,977.600	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,568,491.500	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,366,718.360	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,034,308.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,700,000.000	1,866,617.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,641,128.400	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,376,622.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,282,550.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,802,872.000	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,700,000.000	1,828,010.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,734,102.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,900,000.000	1,978,584.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,492,062.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,000,000.000	2,148,220.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	919,467.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,350,063.000	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	1,500,000.000	1,503,375.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,767,899.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	1,400,000.000	1,508,556.000	

		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,500,000.000	1,646,190.000	
		2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	1,200,000.000	1,251,048.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,000,000.000	1,206,320.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,651,062.500	
		1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,050,000.000	1,073,772.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,205,900.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	1,200,000.000	1,264,308.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,000,000.000	1,075,990.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	700,000.000	813,617.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,400,000.000	1,402,842.000	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	735,523.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	700,000.000	688,093.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	300,000.000	297,567.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,769,592.580	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,220,992.930	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	2,055,000.000	3,055,887.750	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,546,110.840	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,631,017.600	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,905,831.900	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	3,001,675.500	

		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,609,831.910	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,589,170.280	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	3,017,960.460	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,532,996.900	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,248,712.960	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,470,254.570	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,235,332.000	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,900,081.900	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	2,710,000.000	3,126,527.000	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,139,145.500	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,162,341.920	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,613,000.000	2,380,175.060	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,562,394.540	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,823,351.530	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,525,537.450	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,341,491.600	
		2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,661,339.700	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,520,393.220	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,915,220.240	
		4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	971,584.450	

		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,935,526.400	
		4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,575,431.460	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,307,906.600	
		4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,497,739.600	
		4% Belgium Government Bond 20320328	980,000.000	1,450,762.600	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,472,683.080	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	953,000.000	1,663,347.140	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,715,669.900	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,045,643.130	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,469,847.600	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	576,757.440	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	705,734.620	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	941,844.040	
		0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	531,278.760	
		2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	1,017,088.490	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,153,775.440	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	658,570.000	
		IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	354,711.000	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	539,775.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	789,229.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	225,910.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	700,000.000	769,454.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	400,000.000	469,696.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,238,316.750	
		3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,435,322.980	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	2,123,414.920	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,164,380.000	

		3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	878,158.510	
		3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	975,872.640	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	388,000.000	850,352.440	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,031,214.520	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,044,725.010	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,021,775.460	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,028,238.320	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	834,930.590	
		3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	485,080.380	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	488,206.670	
		1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	331,503.120	
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	477,563.420	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	618,640.000	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	587,454.500	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,550,226.400	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,445,000.000	2,659,108.650	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,365,997.040	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	2,013,562.880	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,938,291.180	
		0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,781,677.950	

		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,552,000.000	2,141,682.400	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,150,000.000	1,844,841.500	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,030,000.000	2,190,918.100	
		0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,118,105.600	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,500,000.000	2,737,225.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,850,000.000	2,253,022.500	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,242,003.000	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	1,300,000.000	1,307,553.000	
		0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,000,000.000	1,022,240.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,600,000.000	1,745,936.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,743,781.000	
		0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	1,400,000.000	1,428,294.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,074,002.000	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,200,000.000	1,210,104.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,900,000.000	2,086,580.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,100,000.000	1,267,475.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	900,000.000	914,535.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,200,000.000	2,239,380.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,233,270.410	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,544,745.160	

		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,708,000.000	2,952,705.000	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,028,828.400	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	3,197,342.110	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,761,138.930	
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,726,310.300	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,716,042.650	
		5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,246,375.040	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,076,527.200	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,242,077.420	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,516,019.600	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,422,427.160	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,310,081.100	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,388,923.370	
ユーロ　小計				ユーロ 578,388,411.770 (69,904,023,447)	
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	21,934,000.000	24,289,711.600	
		6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,612,000.000	8,234,185.320	
		6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,626,159.800	
		6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,100,130.400	
		7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	9,999,000.000	8,330,666.850	

		7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	8,439,000.000	8,523,390.000	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	21,552,000.000	18,646,790.400	
		8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,668,172.250	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	14,862,000.000	13,693,549.560	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	12,644,000.000	10,957,796.160	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	10,743,000.000	9,717,580.650	
		8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	10,166,000.000	9,380,981.480	
		9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	8,679,000.000	7,809,624.570	
	南アフリカ・ランド　小計			南アフリカ・ランド 139,978,739.040 (1,049,840,543)	
国債証券　合計				187,330,033,946 [187,330,033,946]	
合計				187,330,033,946 [187,330,033,946]	

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

通貨	銘柄数		組入債券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	243銘柄	100%	48.4%
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	19銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リンギット	国債証券	34銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	100%	0.8%

ユーロ	国債証券	304銘柄	100%	37.3%
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11月29日

Ⅰ	資産総額	1,005,558,861円
Ⅱ	負債総額	24,451,254円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	981,107,607円
Ⅳ	発行済数量	655,418,778口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4969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11月29日

Ⅰ	資産総額	178,833,434,259円
Ⅱ	負債総額	15,860,619,254円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	162,972,815,005円
Ⅳ	発行済数量	147,468,131,809口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1051円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2019年11月29日

Ⅰ	資産総額	82,737,261,437円
Ⅱ	負債総額	42,289,686円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	82,694,971,751円
Ⅳ	発行済数量	57,665,888,157口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4340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11月29日

Ⅰ	資産総額	135,168,443,207円
Ⅱ	負債総額	796,422,413円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	134,372,020,794円
Ⅳ	発行済数量	48,893,833,112口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7482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11月29日

Ⅰ	資産総額	191,050,437,117円
Ⅱ	負債総額	883,618,107円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	190,166,819,010円
Ⅳ	発行済数量	66,104,872,331口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8767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。

第三部　【委託会社等の情報】

第１　【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2019年11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．運用会議

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

ハ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ニ．運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年11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	62	115,488
追加型株式投資信託	721	16,485,415
株式投資信託　　合計	783	16,600,903
単位型公社債投資信託	27	88,797
追加型公社債投資信託	14	1,478,400
公社債投資信託　合計	41	1,567,197
総合計	824	18,168,100

３　【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第60期事業年度（2018年４月１日から2019年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第61期事業年度に係る中間会計期間（2019年４月１日から2019年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

３．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （2018年３月31日）		当事業年度 （2019年３月31日）	
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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
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。

中間財務諸表

(１)中間貸借対照表

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2019年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		19,529
有価証券		724
未収委託者報酬		11,175
その他		383
流動資産合計		31,812
固定資産		
有形固定資産	※１	211
無形固定資産		
ソフトウエア		2,380
その他		403
無形固定資産合計		2,784
投資その他の資産		
投資有価証券		7,928
関係会社株式		2,664
繰延税金資産		1,205
その他		1,280
投資その他の資産合計		13,078
固定資産合計		16,073
資産合計		47,886

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2019年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		6,021
未払費用		3,486
未払法人税等		754
賞与引当金		506
その他	※２	474
流動負債合計		11,243
固定負債		
退職給付引当金		2,483
役員退職慰労引当金		128
その他		7
固定負債合計		2,619
負債合計		13,862
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,968
利益剰余金合計		7,343
株主資本合計		34,013
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		10
評価・換算差額等合計		10
純資産合計		34,023
負債・純資産合計		47,886

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （自　2019年４月１日 至　2019年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		35,076
その他営業収益		309
営業収益合計		35,385
営業費用		
支払手数料		15,895
その他営業費用		6,272
営業費用合計		22,167
一般管理費	※１	5,954
営業利益		7,263
営業外収益	※２	968
営業外費用	※３	148
経常利益		8,083
特別利益		－
特別損失		－
税引前中間純利益		8,083
法人税、住民税及び事業税		2,313
法人税等調整額		△15
中間純利益		5,785

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2019年４月１日 至　2019年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当中間期変動額						

剰余金の配当	-	-	-	△11,868	△11,868	△11,868
中間純利益	-	-	-	5,785	5,785	5,785
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△6,083	△6,083	△6,083
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,968	7,343	34,013

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	46	46	40,142
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,868
中間純利益	-	-	5,785
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△35	△35	△35
当中間期変動額合計	△35	△35	△6,118
当中間期末残高	10	10	34,023

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	**10～18年**
器具備品	**４～20年**

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 **（2019年９月30日現在）**
有形固定資産	**310百万円**

※２　消費税等の取扱い

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

３　保証債務

当中間会計期間（2019年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,639百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　2019年４月　１日 至　2019年９月30日）
有形固定資産	14百万円
無形固定資産	472百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2019年４月　１日 至　2019年９月30日）
受取配当金	901百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2019年４月　１日 至　2019年９月30日）
有価証券償還損	71百万円
為替差損	68百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項　　**（単位：千株）**

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

２．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 （百万円）	１株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日

2019年６月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年 ３月31日	2019年 ６月24日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2019年９月30日）

金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	19,529	19,529	－
（２）未収委託者報酬	11,175	11,175	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	7,986	7,986	－
資産合計	38,691	38,691	－
（１）未払金	(5,965)	(5,965)	－
（２）未払費用(*2)	(2,867)	(2,867)	－
負債合計	(8,833)	(8,833)	－

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

資　産

（１）現金・預金及び（２）未収委託者報酬

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

（３）有価証券及び投資有価証券

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

負　債

（１）未払金及び（２）未払費用

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,836
関連会社株式	827
差入保証金	1,068

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（2019年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　1,836百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　827百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

	中間貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	66	55	11
（２）その他			
証券投資信託	3,971	3,628	343
小計	4,038	3,683	354
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,947	4,292	△344
小計	3,947	4,292	△344
合計	7,986	7,975	10

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

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

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

［関連情報］

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	当中間会計期間 （自　2019年４月１日 至　2019年９月30日）
１株当たり純資産額	13,043.35円
１株当たり中間純利益	2,217.93円

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

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2019年４月１日 至　2019年９月30日）	
中間純利益(百万円)	5,785
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,785
普通株主に帰属しない金額(百万円)	―
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

2020年4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。

・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第２　【その他の関係法人の概況】

１　【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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	（注1）
大樹生命保険株式会社	（※）167,280	（注2）
日本生命保険相互会社	1,350,000	
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	（注3）
三井住友信託銀行株式会社	342,037	（注4）
株式会社山口銀行	10,005	（注5）

（※）資本金の額は、2019年4月１日現在のものです。

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（注2）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

（注3）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

（注4）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

（注5）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

２　【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。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 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

① 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

② 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

③ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

④ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等

・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨

⑤ 使用開始日を記載することがあります。

⑥ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日

⑦ 次の事項を記載することがあります。

・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

⑧　委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

⑨　ファンドの形態等を記載することがあります。

⑩　図案を採用することがあります。

⑪　ファンドの管理番号等を記載することがあります。

⑫　委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

⑬　UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

⑭　次の事項を記載することがあります。

・大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更します。2020年4月1日以降、「大和投資信託」「大和証券投資信託委託株式会社」など当社名を表す記載につきましては、「大和アセットマネジメント株式会社」とお読み替え下さい。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2019年５月24日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小倉　加奈子	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬　友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2018年４月１日から2019年３月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

(注)１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
(注)２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年12月27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スタイル７５の2018年12月1日から2019年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワライフスタイル７５の2019年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

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

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小倉　加奈子　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬　友未　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2019年４月１日から2020年３月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年４月１日から2019年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年４月１日から2019年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以　上

(注)１．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
(注)２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。