【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3月11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】	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部　【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020

(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】

10兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問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 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】

1円以上1円単位

(7) 【申込期間】

2020年3月12日から2020年9月11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 当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合に限り取得できます。

② 受益権の取得申込者は、販売会社に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。

③　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。

④　金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することができます。

⑤　当ファンドは、積立投資専用です。

イ．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。）を締結するものとします。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。）。

ロ．収益分配金は、自動的に再投資されます。

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。

⑦　取得申込金額に利息は付きません。

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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

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

（注1）商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

- 「その他資産」…組入れている資産
- 「資産複合　資産配分変更型」…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、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
- 「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

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国　内	株　式
追加型投信	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式				
一般	年1回	グローバル（含む日本）		
大型株				
中小型株	年2回	日本		
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		
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 資産配分変更型（株式、債券、不動産投信））		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
（　）		中近東（中東）		
資産配分固定型	その他（　）			
資産配分変更型		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、1兆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、債券、リートおよび短期金融資産に投資し、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

●当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2020年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

◆2020年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

〈2019年12月時点の基本配分比率〉

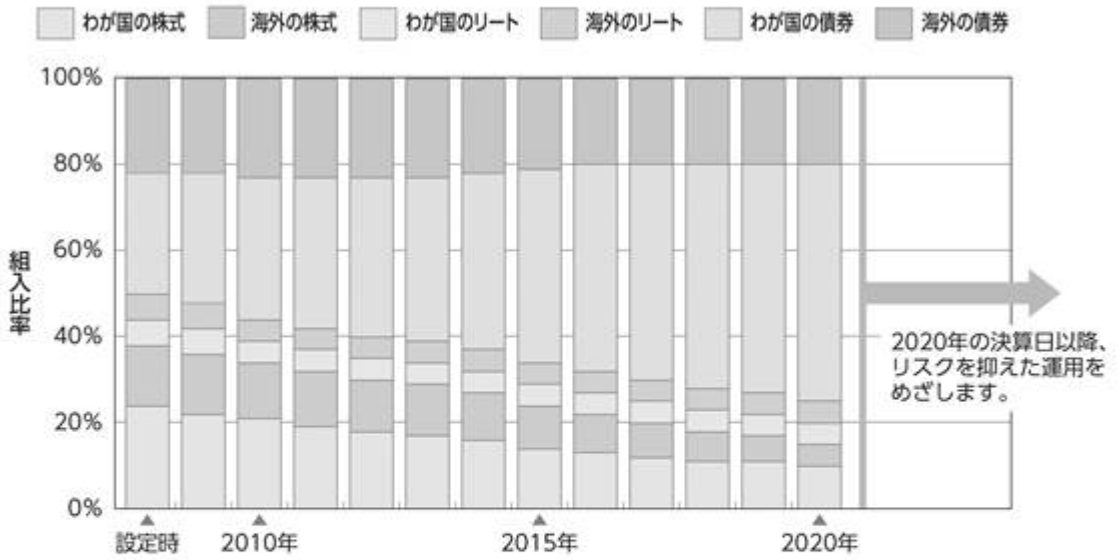
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	11%	6%	5%	5%	53%	20%

〈当初設定時の基本配分比率〉

	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	24%	14%	6%	6%	28%	22%

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

ファンドの基本配分比率のイメージ



（注1）2019年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2018年以前は過去の基本配分比率を示しています。

（注2）解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要性があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。

（注3）組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。

2 わが国の株式への投資にあたっては、投資成果を東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

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

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

(c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

運用プロセス

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。ベンチマークである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っています。

(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

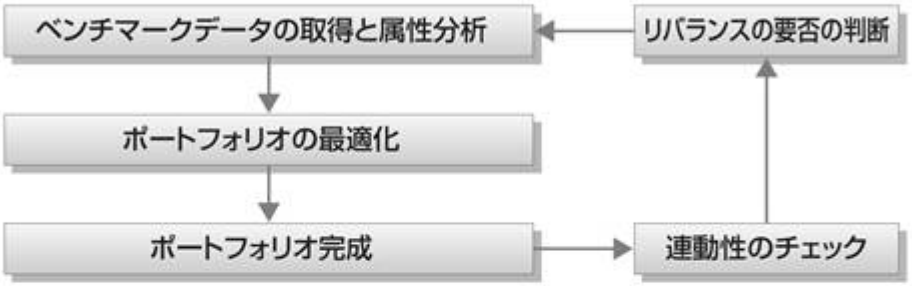
東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするもので、1968年1月4日（基準時）の時価総額を100として、1969年7月1日から株式会社東京証券取引所が算出・公表しています。

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。

3 海外の株式への投資にあたっては、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

運用プロセス



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。ベンチマークである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っています。

（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 わが国のリートへの投資にあたっては、東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用プロセス

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

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

東証REIT指数とは

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

［算出方法の概要］

指数：算出時の時価総額(注1)÷基準時の時価総額(注2)×1,000

(注1) 算出対象銘柄ごとに、価格に指数算出用上場口数を乗じ、これを全銘柄合計したものです。

(注2) 2003年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市況変動によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額を修正します。なお、配当込み指数の算出に際しては、権利落（金銭の分配）についても、基準時の時価総額の修正が行なわれます。

①東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。

②(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

③本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

5 海外のリートへの投資にあたっては、ベンチマーク（S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用プロセス

ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてベンチマークであるS&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の構成銘柄の全てに投資することをめざします。

ベンチマークへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

- 運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

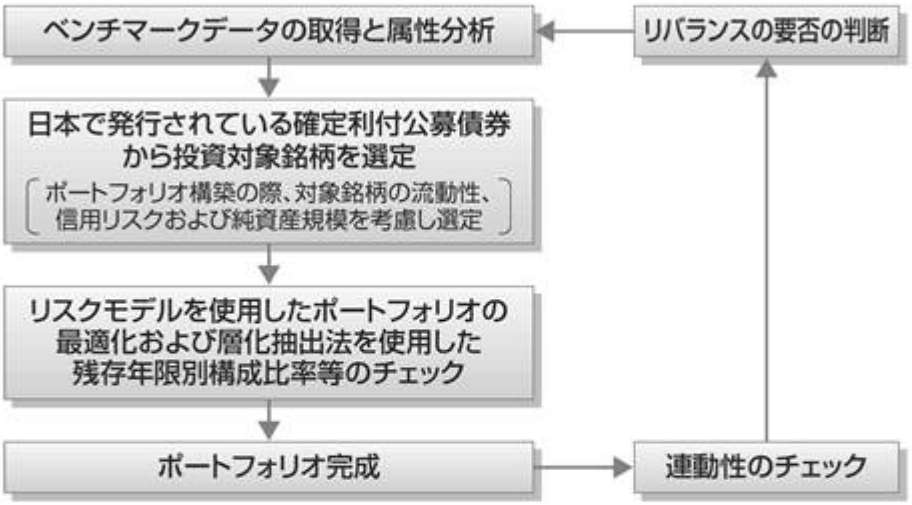
S&P先進国REIT指数は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

[特徴]
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

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

6 わが国の債券への投資にあたっては、ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用プロセス



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

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

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

・運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の信託財産の純資産総額を超えることがあります。

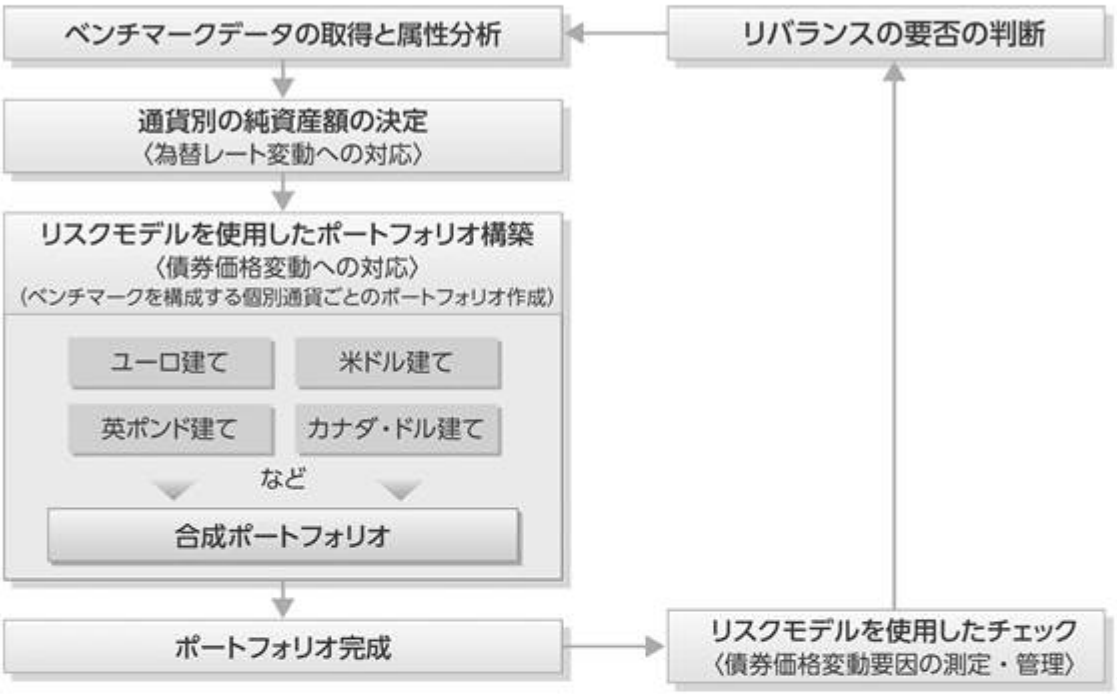
ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数とは

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

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

7 海外の債券への投資にあたっては、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

運用プロセス



ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の主な騰落要因は、為替レート変動と債券価格変動です。したがって、ファンドは、特に以下の3点に留意し運用します。

①為替レート変動への対応

為替レート変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、ファンドの通貨別構成比率をベンチマークの通貨別構成比率に近づけます。

②債券価格変動への対応

ベンチマークは構成する債券の銘柄数が多く、構成銘柄の比率がベンチマークと同一のポートフォリオを構築することは困難です。したがって、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、リスクモデル(注)を使用した効率的な複製を行なうことを基本とします。なお、リスクモデルを使用した効率的な複製はベンチマークを構成する通貨別に行ないます。

③債券価格変動要因の測定・管理

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、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行なっています。

（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しています。その結果、ポートフォリオの効率的な複製を行なうこと、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を測定・管理する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。

8 2020年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

●わが国の短期債券への投資にあたっては、ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期指数とは

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

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合には、債券の残存期間別に短期・中期・長期などのサブ・インデックスがあり、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期(ＮＯＭＵＲＡ－ボンド・パフォーマンス・インデックス総合短期)は、残存期間１年以上３年未満の短期の公募利付債市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の銘柄採用基準に基づいて構成された債券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。

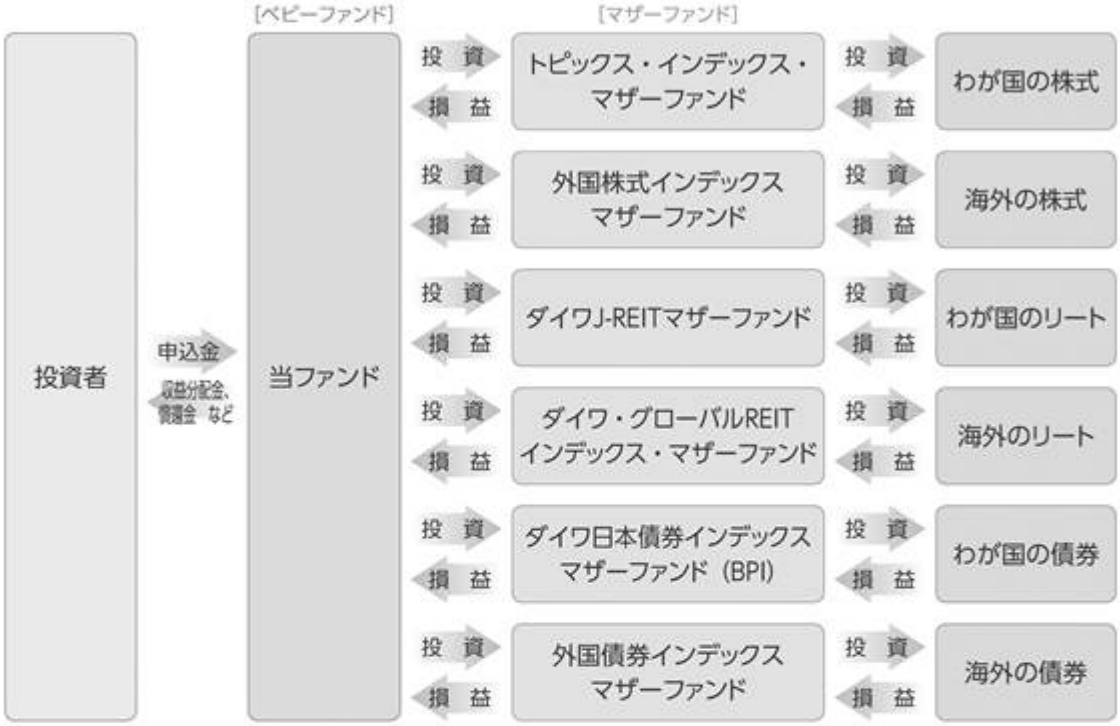
ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

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。

〈2020年の決算日前日まで〉



※ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドに投資することがあります。

〈2020年の決算日から〉

・為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

・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. ～ 8.の運用が行なわれないことがあります。

9 当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により購入の申込みを行なう場合に限り購入できます。

10 毎年12月18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。
収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2008年2月28日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者		お申込者
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金(※3)	
お取扱窓口	販売会社	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	内外の株式・債券・リート（ＲＥＩＴ）および短期金融資産　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（注）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12月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	設立登記
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。

2007年 9月30日　　「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。
（金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）

・大株主の状況

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

2　【投資方針】

(1)　【投資方針】

①　主要投資対象

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
3. ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券
4. ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
7. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、マザーファンドを通じて内外の株式、債券、リート（ＲＥＩＴ）に投資するとともに、短期金融資産に投資を行ない、中長期的に安定した信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

ロ．マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2020年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

当初設定時の基本配分比率

トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の24%
外国株式インデックスマザーファンドの受益証券　……信託財産の純資産総額の14%
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券　……信託財産の純資産総額の6%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券
……信託財産の純資産総額の6%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
……信託財産の純資産総額の28%
外国債券インデックスマザーファンドの受益証券　……信託財産の純資産総額の22%

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．2020年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

(2) 【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．外国法人が発行する譲渡性預金証書

4．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。）

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

1．預金

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

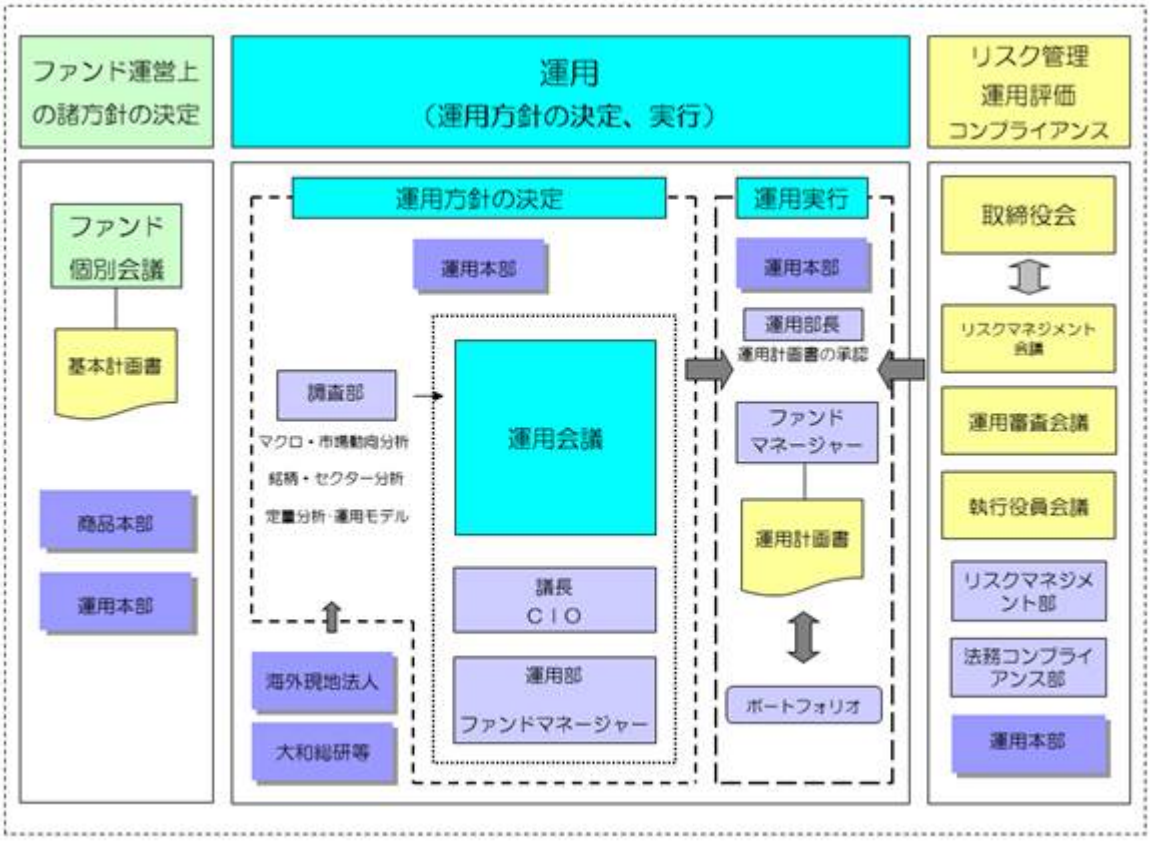
3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

(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12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】

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

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）
株式への直接投資は、行ないません。

②　外貨建資産（信託約款）
外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参考＞各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　投資態度

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」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

(3) 主な投資制限

① 株式への投資には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資は、行ないません。

（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．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

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

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。

３．ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号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、「＜参考＞各マザーファンドの概要」において同じ。

② 投資態度

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

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
3. 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
4. 新投資口予約権証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限ります。）
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 同一銘柄の投資信託証券

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

④ 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑤ 先物取引

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

（注）東証ＲＥＩＴ指数とは

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

［算出方法の概要］

指数：算出時の時価総額（注1）÷基準時の時価総額（注2）×1,000

（注1）算出対象銘柄ごとに、価格に指数算出用上場口数を乗じ、これを全銘柄合計したものです。
（注2）2003年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市況変動によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額を修正します。なお、配当込み指数の算出に際しては、権利落（金銭の分配）についても、基準時の時価総額の修正が行なわれます。

①東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有します。
②㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
③本商品は、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

４．ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。

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

ニ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

4. 外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

① 株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑤ 先物取引

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

（注）Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）とは

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

［特徴］

・世界に上場する各国のＲＥＩＴ制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用。

・1989年から過去データを算出。

・配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出。

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

５．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　外貨建資産への投資は、行ないません。

④　先物取引等

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなっ

た場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

(注）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数とは

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

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

６．ダイワ短期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

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

②　投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資し、ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

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

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

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

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

⑤ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

（注）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期指数とは

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

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合には、債券の残存期間別に短期・中期・長期などのサブ・インデックスがあり、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期(ＮＯＭＵＲＡ－ボンド・パフォーマンス・インデックス総合短期)は、残存期間１年以上３年未満の短期の公募利付債市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の銘柄採用基準に基づいて構成された債券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に関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

７．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（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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】

〈基準価額の主な変動要因〉

株価変動リスク	株式市況	株　価	基準価額
	改　善	↗	上昇要因
	悪　化	↘	下落要因
公社債の価格変動リスク	金　利	公社債価格	基準価額
	低　下	↗	上昇要因
	上　昇	↘	下落要因
リートの価格変動リスク	リート市況	リート価格	基準価額
	改　善	↗	上昇要因
	悪　化	↘	下落要因
外貨建資産の為替リスク	為替相場	円換算価値	基準価額
	円　安	↗	上昇要因
	円　高	↘	下落要因

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

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）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉

※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発

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

③　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。

・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。

・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。

・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

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

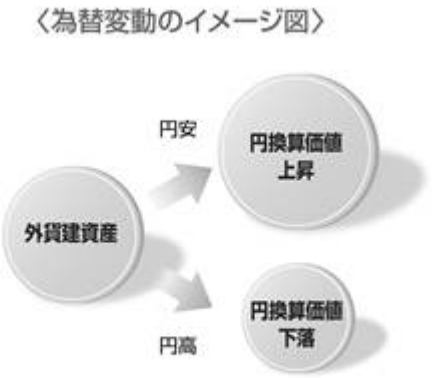
・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当が影響を受けることが考えられます。

・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

④　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

⑤　その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

①　金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付けの申込みの受付けを中止することがあります。

②　金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合

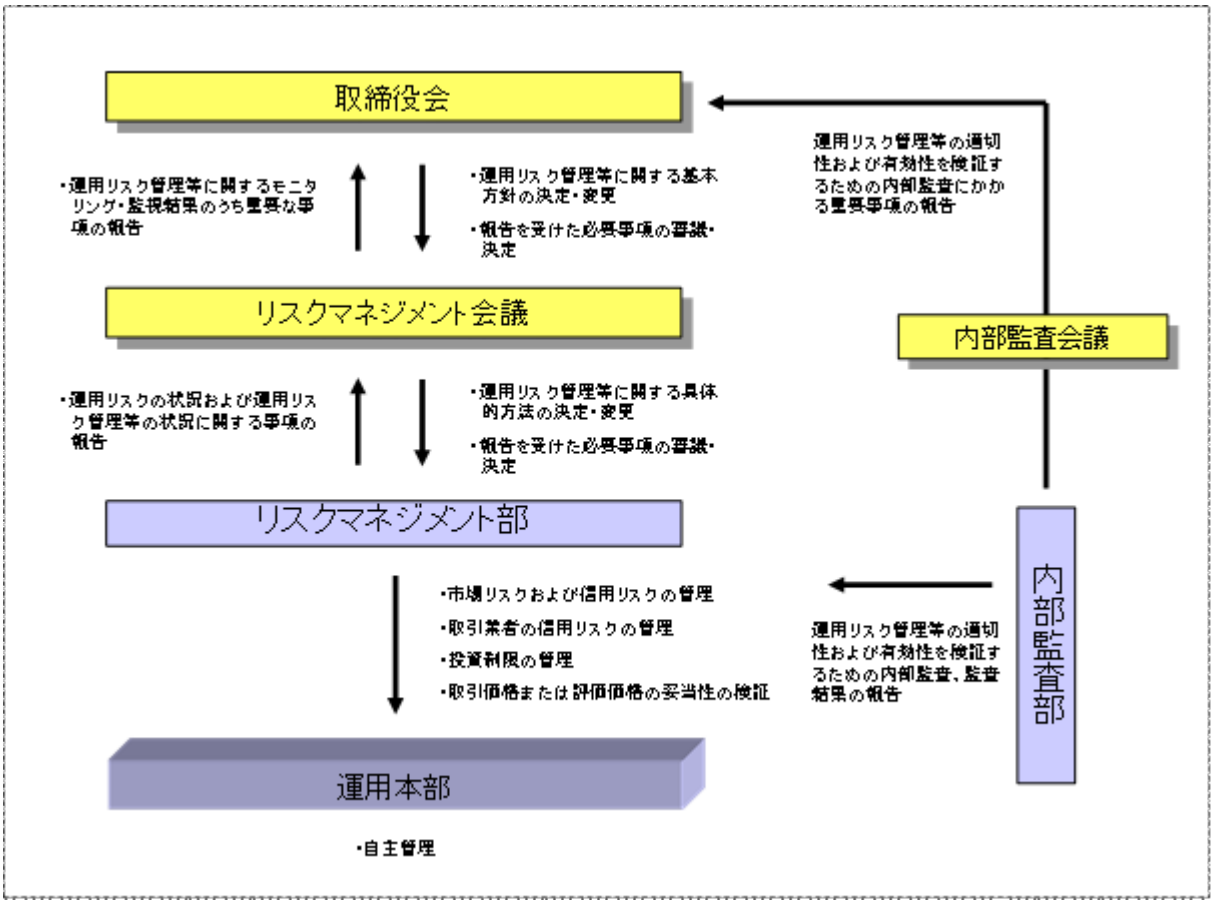
には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

(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

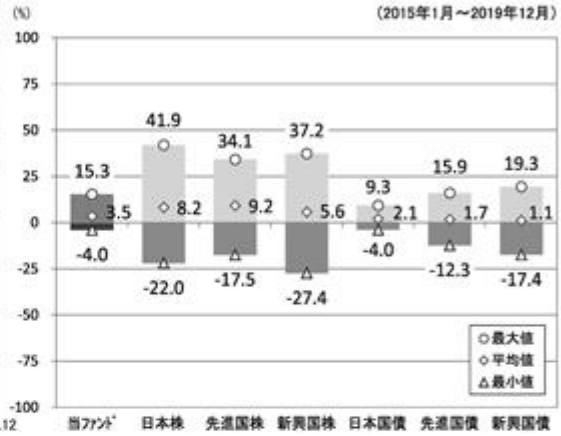
当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

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

	信託報酬率
第1計算期間から2016年3月11日まで	年率0.715%（税抜0.65%）
2016年3月12日から第13計算期間まで	年率0.308%（税抜0.28%）
第14計算期間以降	年率0.242%（税抜0.22%）

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。

＜第1計算期間から2016年3月11日まで＞

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.300% (税抜)	年率0.300% (税抜)	年率0.05% (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。

＜2016年3月12日から第13計算期間まで＞

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.125% (税抜)	年率0.125% (税抜)	年率0.03% (税抜)

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

＜第14計算期間以降＞

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.095% (税抜)	年率0.095% (税抜)	年率0.03% (税抜)

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（有価証券等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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、所得税および地方税がかかりません。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。

前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により受益権を取得した場合、上記にかかわらず、次の取扱いとなります。

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

＜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12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12月30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		136,721,111	99.80
	内 日本	136,721,111	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		267,320	0.20
純資産総額		136,988,431	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12月30日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	52,278,012	1.2994 67,934,139	1.3012 68,024,149	49.66
2	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	9,457,660	2.8843 27,279,254	2.8900 27,332,637	19.95
3	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	13,333,647	1.1306 15,075,022	1.1211 14,948,351	10.91
4	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	2,982,999	2.7892 8,320,182	2.8314 8,446,063	6.17
5	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,684,929	2.4993 6,710,666	2.5654 6,887,916	5.03
6	ダイワJ－REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,082,567	3.2297 6,726,082	3.3004 6,873,304	5.02

7	ダイワ短期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	4,013,246	1.0486 4,208,289	1.0487 4,208,691	3.07

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.80%
合計	99.80%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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3計算期間末 (2010年12月20日)	36,256,038	36,256,038	0.8249	0.8249
第4計算期間末 (2011年12月19日)	40,591,212	40,591,212	0.7738	0.7738
第5計算期間末 (2012年12月18日)	54,675,911	54,675,911	0.8815	0.8815
第6計算期間末 (2013年12月18日)	79,552,652	79,552,652	1.0892	1.0892
第7計算期間末 (2014年12月18日)	119,842,748	119,842,748	1.2294	1.2294
第8計算期間末 (2015年12月18日)	153,953,019	153,953,019	1.2578	1.2578
第9計算期間末 (2016年12月19日)	165,407,593	165,407,593	1.2714	1.2714

第10計算期間末 (2017年12月18日)	159,516,345	159,516,345	1.3290	1.3290
第11計算期間末 (2018年12月18日)	143,386,231	143,386,231	1.3049	1.3049
2018年12月末日	141,695,425	―	1.2912	―
2019年1月末日	144,338,823	―	1.3128	―
2月末日	145,684,808	―	1.3285	―
3月末日	144,504,659	―	1.3418	―
4月末日	142,987,501	―	1.3440	―
5月末日	141,327,097	―	1.3302	―
6月末日	142,975,866	―	1.3452	―
7月末日	134,823,134	―	1.3545	―
8月末日	135,606,220	―	1.3585	―
9月末日	141,159,881	―	1.3694	―
10月末日	138,699,160	―	1.3839	―
11月末日	137,106,031	―	1.3866	―
第12計算期間末 (2019年12月18日)	135,831,927	135,831,927	1.3829	1.3829
12月末日	136,988,431	―	1.3875	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第3計算期間	2.1
第4計算期間	△6.2
第5計算期間	13.9
第6計算期間	23.6

第7計算期間	12.9
第8計算期間	2.3
第9計算期間	1.1
第10計算期間	4.5
第11計算期間	△1.8
第12計算期間	6.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第3計算期間	11,533,326	2,056,679
第4計算期間	11,003,989	2,494,623
第5計算期間	16,094,256	6,525,749
第6計算期間	22,032,793	11,025,442
第7計算期間	34,165,971	9,720,098
第8計算期間	38,271,752	13,351,557
第9計算期間	33,507,045	25,811,891
第10計算期間	25,448,046	35,514,191
第11計算期間	8,198,063	18,347,348
第12計算期間	9,205,859	20,865,681

（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12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		155,951,333,270	98.52
	内 日本	155,951,333,270	98.52
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,348,948,523	1.48
純資産総額		158,300,281,793	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		2,374,980,000	1.50
	内 日本	2,374,980,000	1.50

(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12月30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	716,800	7,380.53 5,290,370,124	7,714.00 5,529,395,200	3.49
2	ソ ニ ー	日本	株式	電気機器	406,200	6,391.26 2,596,130,797	7,401.00 3,006,286,200	1.90
3	三菱UFJﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	4,361,500	565.52 2,466,526,575	593.20 2,587,241,800	1.63
4	ｿﾌﾄﾊﾞﾝｸｸﾞﾙｰﾌﾟ	日本	株式	情報･通信業	500,200	4,585.35 2,293,597,034	4,756.00 2,378,951,200	1.50
5	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	842,600	2,640.04 2,224,501,679	2,757.00 2,323,048,200	1.47
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	534,500	3,777.63 2,019,146,698	4,332.00 2,315,454,000	1.46
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	58,200	33,554.68 1,952,882,948	38,490.00 2,240,118,000	1.42
8	ﾘｸﾙｰﾄﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	日本	株式	サービス業	439,700	3,439.91 1,512,528,757	4,099.00 1,802,330,300	1.14
9	三井住友ﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	438,100	3,792.42 1,661,463,048	4,038.00 1,769,047,800	1.12
10	任 天 堂	日本	株式	その他製品	39,400	42,022.42 1,655,683,501	43,970.00 1,732,418,000	1.09
11	本田技研	日本	株式	輸送用機器	505,700	2,893.07 1,463,025,986	3,099.00 1,567,164,300	0.99
12	ＫＤＤＩ	日本	株式	情報･通信業	469,800	2,878.90 1,352,510,794	3,253.00 1,528,259,400	0.97
13	みずほﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	8,608,100	168.51 1,450,582,766	168.30 1,448,743,230	0.92
14	日 立	日本	株式	電気機器	308,600	4,086.62 1,261,130,979	4,626.00 1,427,583,600	0.90

15	NTTドコモ	日本	株式	情報･通信業	465,500	2,818.55 1,312,039,091	3,038.00 1,414,189,000	0.89
16	花 王	日本	株式	化学	153,800	7,983.86 1,227,919,232	9,025.00 1,388,045,000	0.88
17	東京海上HD	日本	株式	保険業	226,500	5,894.78 1,335,169,424	6,119.00 1,385,953,500	0.88
18	HOYA	日本	株式	精密機器	128,300	8,900.36 1,141,916,985	10,450.00 1,340,735,000	0.85
19	第一三共	日本	株式	医薬品	183,900	7,109.79 1,307,491,571	7,228.00 1,329,229,200	0.84
20	信越化学	日本	株式	化学	108,000	11,839.09 1,278,622,124	12,060.00 1,302,480,000	0.82
21	三菱商事	日本	株式	卸売業	443,900	2,782.47 1,235,140,806	2,900.00 1,287,310,000	0.81
22	村田製作所	日本	株式	電気機器	188,700	5,109.20 964,107,361	6,746.00 1,272,970,200	0.80
23	ダイキン工業	日本	株式	機械	81,800	14,519.52 1,187,697,097	15,450.00 1,263,810,000	0.80
24	ファナック	日本	株式	電気機器	61,000	20,505.47 1,250,833,987	20,330.00 1,240,130,000	0.78
25	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	53,400	22,499.16 1,201,455,472	22,000.00 1,174,800,000	0.74
26	日本電産	日本	株式	電気機器	77,300	15,367.90 1,187,939,397	15,005.00 1,159,886,500	0.73
27	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	442,500	2,303.15 1,019,144,576	2,534.50 1,121,516,250	0.71
28	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	113,000	10,509.64 1,187,589,589	9,858.00 1,113,954,000	0.70
29	三井物産	日本	株式	卸売業	556,000	1,840.32 1,023,222,820	1,946.00 1,081,976,000	0.68
30	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	565,000	1,543.73 872,210,609	1,870.00 1,056,550,000	0.67

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.52%
合計	98.52%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%
鉱業	0.29%
建設業	2.74%
食料品	3.72%
繊維製品	0.59%
パルプ・紙	0.24%
化学	7.03%
医薬品	5.94%
石油・石炭製品	0.49%
ゴム製品	0.70%
ガラス・土石製品	0.84%
鉄鋼	0.76%
非鉄金属	0.76%
金属製品	0.59%
機械	5.04%
電気機器	14.19%
輸送用機器	7.60%
精密機器	2.34%
その他製品	2.29%
電気・ガス業	1.52%
陸運業	4.32%
海運業	0.18%
空運業	0.49%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	8.59%
卸売業	4.92%
小売業	4.57%
銀行業	5.77%
証券、商品先物取引業	0.81%
保険業	2.28%
その他金融業	1.17%
不動産業	2.35%
サービス業	5.09%
合計	98.52%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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 2020年3月	買建	138	2,377,560,000	2,374,980,000	1.50%

(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。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2019年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		125,348,199,342	92.42
	内 香港	1,579,010,477	1.16
	内 シンガポール	526,081,098	0.39
	内 イスラエル	262,101,557	0.19
	内 ノルウェー	293,362,206	0.22
	内 スウェーデン	1,272,335,342	0.94
	内 デンマーク	867,568,323	0.64
	内 イギリス	7,685,669,621	5.67
	内 アイルランド	278,977,490	0.21
	内 オランダ	1,880,025,072	1.39
	内 ベルギー	468,039,840	0.35
	内 フランス	5,236,230,091	3.86
	内 ドイツ	4,084,735,905	3.01
	内 スイス	4,437,210,052	3.27
	内 ポルトガル	72,771,501	0.05
	内 スペイン	1,337,941,033	0.99
	内 イタリア	1,107,873,795	0.82
	内 フィンランド	443,588,244	0.33

	内 オーストリア	103,037,820	0.08
	内 カナダ	4,720,120,626	3.48
	内 アメリカ	85,723,257,338	63.20
	内 オーストラリア	2,833,252,095	2.09
	内 ニュージーランド	135,009,816	0.10
投資証券		3,646,909,082	2.69
	内 香港	96,768,817	0.07
	内 シンガポール	68,445,617	0.05
	内 イギリス	96,386,028	0.07
	内 フランス	148,911,589	0.11
	内 カナダ	33,580,602	0.02
	内 アメリカ	2,803,559,938	2.07
	内 オーストラリア	399,256,491	0.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,638,118,730	4.89
純資産総額		135,633,227,154	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）		6,729,966,782	4.96
	内 イギリス	337,438,416	0.25
	内 ドイツ	913,712,742	0.67
	内 カナダ	238,881,938	0.18
	内 アメリカ	5,072,217,150	3.74
	内 オーストラリア	167,716,536	0.12
為替予約取引（買建）		3,841,569,000	2.83
	内 日本	3,841,569,000	2.83

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

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

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

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

(2) 投資資産（2019年12月30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	29,279.91 3,800,532,318	31,750.48 4,121,213,342	3.04
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	205,650	16,585.19 3,410,744,899	17,415.65 3,581,529,985	2.64
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	11,770	197,295.64 2,322,169,777	204,855.28 2,411,146,740	1.78
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	22,091.67 1,494,502,044	22,799.43 1,542,381,845	1.14
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	91,070	14,435.62 1,314,652,423	15,244.17 1,388,287,327	1.02
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	142,971.41 1,250,570,990	148,113.06 1,295,545,009	0.96
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	142,876.10 1,200,159,243	148,414.35 1,246,680,611	0.92
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	74,800	15,063.40 1,126,742,649	15,968.37 1,194,434,076	0.88
9	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	86,900	11,680.60 1,015,044,835	11,959.36 1,039,268,384	0.77
10	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	48,950	20,214.91 989,520,119	20,749.56 1,015,691,373	0.75
11	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	255,401	3,650.53 932,351,362	3,872.94 989,154,281	0.73
12	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	70,767	13,372.89 946,359,561	13,814.42 977,605,088	0.72
13	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	119,655	7,464.32 893,143,545	7,657.14 916,216,092	0.68
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	36,350	24,136.06 877,346,072	24,775.89 900,603,907	0.66

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	4,095.35 846,063,030	4,299.13 888,162,475	0.65
16	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	26,776	30,662.55 821,020,632	32,426.47 868,251,246	0.64
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	25,500	32,016.71 816,426,329	32,949.07 840,201,397	0.62
18	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	126,650	6,359.95 805,488,681	6,582.36 833,656,502	0.61
19	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	16,607.10 845,500,920	15,968.37 812,981,653	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	6,599.89 771,554,055	6,741.22 788,076,378	0.58
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	31,000	24,159.07 748,931,344	24,099.91 747,097,309	0.55
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	72,721	9,551.44 694,590,326	10,024.74 729,009,118	0.54
23	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	120,922	5,966.63 721,497,752	5,907.47 714,343,716	0.53
24	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	19,940	34,641.68 690,755,099	35,658.90 711,038,466	0.52
25	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	53,818	12,832.76 690,633,628	13,180.06 709,324,900	0.52
26	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	114,150	5,850.50 667,835,032	6,064.14 692,222,266	0.51
27	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	157,113	4,220.25 663,056,327	4,307.89 676,826,967	0.50
28	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	61,050	10,347.54 631,717,561	10,465.56 638,922,682	0.47
29	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	121,050	4,964.16 600,912,004	5,233.68 633,537,109	0.47

30	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	4,837.07 620,064,516	4,941.15 633,406,788	0.47

(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	92.42%
投資証券	2.69%
合計	95.11%

(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	4.98%
素材	4.13%
資本財・サービス	9.60%
一般消費財・サービス	9.12%
生活必需品	7.93%
ヘルスケア	12.60%
金融	15.33%
情報技術	16.94%
コミュニケーション・サービス	7.93%
公益事業	3.37%
不動産	0.48%
合計	92.42%

(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 2020年3月	買建	286	5,014,069,495	5,072,217,150	3.74%
	イギリス	FT 100 2020年3月	買建	31	332,185,649	337,438,416	0.25%

	オーストラリア	SPI 200 INDEX 2020年3月	買建	13	168,641,165	167,716,536	0.12%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX 2020年3月	買建	14	238,247,397	238,881,938	0.18%
	ドイツ	SMI 2020年3月	買建	15	175,974,424	179,171,220	0.13%
		EURO STOXX 50 2020年3月	買建	159	729,874,770	734,541,522	0.54%
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2020年1月	買建	700,000	51,863,000	53,529,000	0.04%
		カナダ・ドル買/円売 2020年1月	買建	1,750,000	144,451,920	146,527,500	0.11%
		スイス・フラン買/円売 2020年1月	買建	1,000,000	110,181,240	112,410,000	0.08%
		ユーロ買/円売 2020年1月	買建	3,500,000	423,265,270	428,855,000	0.32%
		英ポンド買/円売 2020年1月	買建	550,000	78,162,640	78,875,500	0.06%
		米ドル買/円売 2020年1月	買建	27,600,000	3,016,799,160	3,021,372,000	2.23%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

(1) 投資状況（2019年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		373,725,087,140	98.25
	内 日本	373,725,087,140	98.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,672,638,512	1.75
純資産総額		380,397,725,652	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

不動産投信指数先物取引(買建)		6,618,080,000	1.74
	内 日本	6,618,080,000	1.74

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

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

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

(2) 投資資産（2019年12月30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	日本ビルファンド	日本	投資証券	33,047	796,606.76 26,325,463,656	795,000.00 26,272,365,000	6.91
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	34,126	718,208.61 24,509,587,167	720,000.00 24,570,720,000	6.46
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	110,169	193,193.30 21,283,913,747	185,600.00 20,447,366,400	5.38
4	オリックス不動産投資	日本	投資証券	67,996	229,198.61 15,584,589,257	235,300.00 15,999,458,800	4.21
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	76,624	202,835.53 15,542,069,662	203,600.00 15,600,646,400	4.10
6	日本リテールファンド	日本	投資証券	64,498	219,043.82 14,127,888,717	233,300.00 15,047,383,400	3.96
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	49,031	284,955.59 13,971,657,742	276,400.00 13,552,168,400	3.56
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	46,008	293,518.56 13,504,202,178	283,600.00 13,047,868,800	3.43
9	ＧＬＰ投資法人	日本	投資証券	84,997	135,694.22 11,533,602,168	134,900.00 11,466,095,300	3.01
10	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	32,367	346,826.15 11,225,722,291	344,000.00 11,134,248,000	2.93
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	21,602	495,288.94 10,699,231,844	476,500.00 10,293,353,000	2.71
12	ＡＰＩ投資法人	日本	投資証券	17,100	532,551.07 9,106,623,414	544,000.00 9,302,400,000	2.45

13	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	149,692	63,340.31 9,481,539,046	61,900.00 9,265,934,800	2.44
14	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	99,782	91,041.53 9,084,306,776	91,400.00 9,120,074,800	2.40
15	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	109,935	82,265.59 9,043,868,506	81,200.00 8,926,722,000	2.35
16	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	10,557	818,464.44 8,640,529,165	838,000.00 8,846,766,000	2.33
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	11,340	664,293.71 7,533,090,739	686,000.00 7,779,240,000	2.05
18	産業ファンド	日本	投資証券	43,951	154,535.76 6,792,001,383	165,700.00 7,282,680,700	1.91
19	森ヒルズリート	日本	投資証券	39,263	168,568.20 6,618,493,312	180,500.00 7,086,971,500	1.86
20	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	7,877	819,842.42 6,457,898,784	834,000.00 6,569,418,000	1.73
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	22,298	268,706.72 5,991,622,621	277,100.00 6,178,775,800	1.62
22	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	29,022	192,232.37 5,578,967,984	197,200.00 5,723,138,400	1.50
23	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	12,121	453,550.40 5,497,484,498	456,500.00 5,533,236,500	1.45
24	イオンリート投資	日本	投資証券	36,829	138,049.75 5,084,234,384	148,700.00 5,476,472,300	1.44
25	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	30,559	173,573.39 5,304,229,356	175,800.00 5,372,272,200	1.41
26	日本リート投資法人	日本	投資証券	11,085	443,964.18 4,921,343,030	478,000.00 5,298,630,000	1.39
27	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	43,783	115,640.37 5,063,082,397	118,000.00 5,166,394,000	1.36
28	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	31,729	155,224.27 4,925,111,120	161,300.00 5,117,887,700	1.35
29	インベスコ・オフィス・Jリート	日本	投資証券	219,243	20,467.42 4,487,339,366	22,480.00 4,928,582,640	1.30
30	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	14,209	344,670.86 4,897,428,327	344,000.00 4,887,896,000	1.28

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率

投資証券	98.25%
合計	98.25%

(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
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2020年3月	買建	3,110	6,661,742,100	6,618,080,000	1.74%

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

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

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2019年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		342,852,682	1.24
	内 アメリカ	342,852,682	1.24
投資証券		26,811,231,950	97.06
	内 ガーンジィ	53,211,045	0.19
	内 マン島	7,760,179	0.03
	内 韓国	4,347,816	0.02
	内 香港	520,594,504	1.88
	内 シンガポール	1,128,142,660	4.08
	内 イスラエル	18,946,294	0.07
	内 イギリス	1,466,783,939	5.31
	内 アイルランド	36,285,113	0.13

	内 オランダ	65,837,317	0.24
	内 ベルギー	269,199,991	0.97
	内 フランス	921,956,674	3.34
	内 ドイツ	69,538,509	0.25
	内 スペイン	172,304,424	0.62
	内 イタリア	4,748,474	0.02
	内 カナダ	523,702,750	1.90
	内 アメリカ	19,585,319,651	70.90
	内 オーストラリア	1,841,752,245	6.67
	内 ニュージーランド	120,800,365	0.44
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		470,575,662	1.70
純資産総額		27,624,660,294	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		532,903,483	1.93
	内 ドイツ	177,192,840	0.64
	内 アメリカ	355,710,643	1.29
為替予約取引（買建）		317,909,000	1.15
	内 日本	317,909,000	1.15

(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12月30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	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	115,202	10,022.32 1,154,600,372	9,714.68 1,119,151,164	4.05
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	15,500	62,040.10 961,622,034	63,818.70 989,189,850	3.58
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	56,347	16,543.01 932,151,475	16,169.96 911,128,759	3.30
4	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	74,200	9,246.64 686,105,367	8,869.97 658,152,338	2.38

5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	27,500	23,071.47 634,468,095	23,187.27 637,650,156	2.31
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	25,600	23,477.83 601,032,903	22,880.51 585,741,066	2.12
7	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	63,800	9,312.49 594,143,551	8,868.88 565,834,672	2.05
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	37,878	13,234.08 501,280,945	12,947.80 490,436,799	1.78
9	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	59,217	8,376.51 496,033,635	8,025.27 475,232,414	1.72
10	LINK REIT	香港	投資証券	391,500	1,125.72 440,722,231	1,149.51 450,036,689	1.63
11	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	67,779	6,380.44 432,465,475	6,335.85 429,437,902	1.55
12	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	フランス	投資証券	23,700	17,389.03 412,120,520	17,278.14 409,491,918	1.48
13	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	26,100	15,175.48 396,081,750	15,084.22 393,698,163	1.43
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	11,967	34,178.88 409,019,478	32,838.41 392,977,358	1.42
15	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	20,600	17,796.26 366,605,180	17,573.42 362,012,534	1.31
16	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託受益証券	34,000	9,950.56 338,321,280	10,083.90 342,852,682	1.24
17	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	89,500	3,814.33 341,388,522	3,723.94 333,293,024	1.21
18	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	302,050	1,132.64 342,133,442	1,051.38 317,570,779	1.15
19	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	97,997	3,340.26 327,337,278	3,233.11 316,835,629	1.15
20	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,004,270	301.25 302,590,476	300.72 302,007,690	1.09
21	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	20,828	14,898.62 310,310,193	14,242.80 296,649,038	1.07
22	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	134,200	1,919.05 257,543,788	2,066.30 277,297,675	1.00
23	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	31,400	9,116.59 286,262,093	8,719.88 273,804,245	0.99

24	UDR INC	アメリカ	投資証券	53,400	5,260.30 280,902,966	5,077.01 271,112,355	0.98
25	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	16,500	18,012.65 297,209,547	16,341.96 269,642,498	0.98
26	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	23,500	11,612.26 272,888,542	11,450.11 269,077,717	0.97
27	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	198,010	1,281.85 253,841,032	1,290.74 255,580,631	0.93
28	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	33,500	8,099.33 271,329,175	7,615.51 255,119,773	0.92
29	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	66,500	3,851.58 256,130,683	3,762.29 250,192,312	0.91
30	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	84,300	2,709.41 228,410,798	2,765.29 233,114,318	0.84

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	1.24%
投資証券	97.06%
合計	98.30%

(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
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DJ US REIT IDXFTRS 2020年3月	買建	89	349,457,725	355,710,643	1.29%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFTR 2020年3月	買建	150	172,107,736	177,192,840	0.64%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2020年1月	買建	1,040,000	126,125,498	127,431,200	0.46%

		米ドル買/円売 2020年1月	買建	1,740,000	189,727,207	190,477,800	0.69%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資状況（2019年12月30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		17,435,525,750	84.13
	内 日本	17,435,525,750	84.13
地方債証券		1,459,735,400	7.04
	内 日本	1,459,735,400	7.04
特殊債券		730,402,700	3.52
	内 日本	730,402,700	3.52
社債券		935,551,200	4.51
	内 日本	935,551,200	4.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		162,597,405	0.78
純資産総額		20,723,812,455	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12月30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	345 10年国債	日本	国債証券	280,000,000	101.85 285,188,400	101.50 284,219,600	0.100000 2026/12/20	1.37
2	135 5年国債	日本	国債証券	230,000,000	100.96 232,210,300	100.78 231,810,100	0.100000 2023/03/20	1.12
3	128 5年国債	日本	国債証券	227,000,000	100.41 227,948,860	100.34 227,792,230	0.100000 2021/06/20	1.10

4	334 10年国債	日本	国債証券	220,000,000	103.50 227,706,600	103.26 227,189,600	0.600000 2024/06/20	1.10
5	130 5年国債	日本	国債証券	217,000,000	100.56 218,223,880	100.47 218,019,900	0.100000 2021/12/20	1.05
6	335 10年国債	日本	国債証券	210,000,000	103.21 216,751,500	102.98 216,260,100	0.500000 2024/09/20	1.04
7	349 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.92 203,851,200	101.60 203,206,000	0.100000 2027/12/20	0.98
8	140 5年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.19 202,380,000	101.02 202,058,000	0.100000 2024/06/20	0.98
9	139 5年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.16 202,334,000	100.99 201,984,000	0.100000 2024/03/20	0.97
10	133 5年国債	日本	国債証券	200,000,000	100.85 201,716,000	100.66 201,330,000	0.100000 2022/09/20	0.97
11	356 10年国債	日本	国債証券	198,000,000	101.47 200,922,480	101.21 200,405,700	0.100000 2029/09/20	0.97
12	352 10年国債	日本	国債証券	190,000,000	101.78 193,394,300	101.48 192,827,200	0.100000 2028/09/20	0.93
13	138 5年国債	日本	国債証券	190,000,000	101.10 192,090,000	100.93 191,774,600	0.100000 2023/12/20	0.93
14	131 5年国債	日本	国債証券	190,000,000	100.64 191,223,600	100.52 191,005,100	0.100000 2022/03/20	0.92
15	350 10年国債	日本	国債証券	185,000,000	101.97 188,644,500	101.56 187,902,650	0.100000 2028/03/20	0.91
16	347 10年国債	日本	国債証券	180,000,000	101.94 183,502,800	101.57 182,838,600	0.100000 2027/06/20	0.88
17	129 5年国債	日本	国債証券	182,000,000	100.49 182,900,900	100.41 182,760,760	0.100000 2021/09/20	0.88
18	406 2年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.52 180,948,600	100.43 180,786,600	0.100000 2021/11/01	0.87
19	348 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.97 173,352,400	101.59 172,706,400	0.100000 2027/09/20	0.83
20	137 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.05 171,786,700	100.89 171,518,100	0.100000 2023/09/20	0.83
21	134 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.85 171,455,300	100.71 171,208,700	0.100000 2022/12/20	0.83
22	132 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.71 171,215,500	100.59 171,003,000	0.100000 2022/06/20	0.83
23	329 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.49 165,593,600	103.26 165,216,000	0.800000 2023/06/20	0.80

24	340 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.30 165,291,200	103.04 164,872,000	0.400000 2025/09/20	0.80
25	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	102.74 164,384,000	102.53 164,059,200	0.800000 2022/09/20	0.79
26	353 10年国債	日本	国債証券	161,000,000	101.70 163,745,850	101.39 163,244,340	0.100000 2028/12/20	0.79
27	351 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	101.89 163,038,400	101.53 162,449,600	0.100000 2028/06/20	0.78
28	403 2年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.45 160,731,200	100.37 160,601,600	0.100000 2021/08/01	0.77
29	141 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	101.25 151,884,000	101.08 151,632,000	0.100000 2024/09/20	0.73
30	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	102.59 143,635,800	102.41 143,385,200	1.100000 2021/12/20	0.69

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	84.13%
地方債証券	7.04%
特殊債券	3.52%
社債券	4.51%
合計	99.22%

(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。

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2019年12月30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		4,021,160	95.54
	内 日本	4,021,160	95.54
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		187,607	4.46
純資産総額		4,208,767	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12月30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	131 5年国債	日本	国債証券	4,000,000	100.51 4,020,720	100.52 4,021,160	0.100000 2022/03/20	95.54

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	95.54%
合計	95.54%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2019年12月30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		189,342,701,140	98.22
	内 ユーロ	71,187,944,814	36.93
	内 シンガポール	797,074,517	0.41
	内 マレーシア	877,392,496	0.46
	内 ノルウェー	426,202,518	0.22
	内 スウェーデン	660,302,135	0.34
	内 デンマーク	939,307,798	0.49
	内 イギリス	12,281,158,617	6.37
	内 ポーランド	1,087,664,726	0.56
	内 カナダ	3,610,410,504	1.87
	内 アメリカ	90,974,570,725	47.19
	内 メキシコ	1,634,954,101	0.85
	内 南アフリカ	1,123,596,842	0.58
	内 オーストラリア	3,742,121,347	1.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,436,470,565	1.78
純資産総額		192,779,171,705	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		2,367,003,990	1.23
	内 日本	2,367,003,990	1.23

(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12月30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	8,168,000	100.04 895,261,932	100.04 895,261,932	1.625000 2022/11/15	0.46
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,300,000	111.23 889,636,183	110.35 882,574,055	3.125000 2028/11/15	0.46

3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,907,000	100.76 872,952,697	100.84 873,628,404	2.250000 2021/04/30	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,550,000	102.04 844,102,061	101.85 842,555,239	2.125000 2024/03/31	0.44
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	108.99 800,057,955	108.19 794,207,561	2.875000 2028/08/15	0.41
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	105.16 795,001,980	104.36 788,976,947	2.375000 2029/05/15	0.41
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	108.81 774,893,776	108.02 769,274,992	2.875000 2028/05/15	0.40
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	107.23 775,404,764	106.38 769,243,986	2.625000 2029/02/15	0.40
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,029,000	99.50 766,300,660	99.10 763,174,065	1.625000 2026/05/15	0.40
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	98.53 744,919,365	97.82 739,544,461	1.625000 2029/08/15	0.38
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	107.65 743,071,855	106.93 738,109,116	2.750000 2028/02/15	0.38
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	101.83 725,207,769	101.34 721,704,040	2.000000 2026/11/15	0.37
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	101.11 696,497,657	101.10 696,442,553	2.000000 2022/11/30	0.36
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	103.32 697,576,338	103.11 696,151,858	2.375000 2024/08/15	0.36
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,084,000	182.59 690,058,457	178.66 675,191,346	4.500000 2041/04/25	0.35
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	103.71 670,437,300	103.08 666,345,563	2.250000 2027/08/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	102.85 667,199,332	102.62 665,733,259	2.250000 2024/11/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	103.11 659,773,913	102.75 657,425,736	2.250000 2025/11/15	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	104.53 652,837,691	103.96 649,271,842	2.375000 2027/05/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	102.32 648,895,902	102.04 647,107,646	2.125000 2025/05/15	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,800,000	101.58 645,519,850	101.42 644,528,551	2.000000 2024/05/31	0.33
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,800,000	125.03 657,523,025	122.55 644,496,779	3.375000 2048/11/15	0.33

23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	101.71 640,012,788	101.50 638,685,170	2.000000 2025/02/15	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	101.75 640,258,178	101.42 638,144,055	2.000000 2025/08/15	0.33
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,087,000	126.60 634,039,360	125.25 627,288,293	2.500000 2030/05/25	0.33
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,420,000	116.79 632,609,269	115.41 625,134,820	1.500000 2031/05/25	0.32
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	103.78 625,363,549	103.14 621,549,218	2.250000 2027/11/15	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,340,000	103.55 605,843,091	103.04 602,871,035	2.250000 2027/02/15	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	104.47 598,531,762	104.29 597,500,561	2.750000 2024/02/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,850,000	114.37 607,749,862	112.03 595,294,643	2.875000 2049/05/15	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	98.22%
合計	98.22%

(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	190,000	14,462,800	14,533,100	0.01%
		南アフリカ・ランド買/円売 2020年2月	買建	5,300,000	41,054,791	41,234,000	0.02%

		カナダ・ドル買/円売 2020年2月	買建	281,000	23,443,239	23,491,600	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2020年1月	買建	180,000	15,033,600	15,075,000	0.01%
		デンマーク・クローネ買/円売 2020年1月	買建	500,000	8,141,500	8,200,000	0.00%
		ユーロ買/円売 2020年1月	買建	8,864,000	1,073,767,823	1,086,105,920	0.56%
		英ポンド買/円売 2020年2月	買建	305,000	43,636,685	43,700,400	0.02%
		英ポンド買/円売 2020年1月	買建	336,000	47,958,684	48,194,980	0.03%
		メキシコ・ペソ買/円売 2020年2月	買建	7,582,000	43,653,888	43,748,140	0.02%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2020年2月	買建	2,816,000	34,869,173	34,918,400	0.02%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2020年2月	買建	987,000	28,244,515	28,297,290	0.01%
		米ドル買/円売 2020年1月	買建	3,472,000	380,374,929	380,175,630	0.20%
		米ドル買/円売 2020年2月	買建	5,379,000	586,180,828	587,763,330	0.30%
		南アフリカ・ランド買/円売 2020年1月	買建	600,000	4,646,400	4,692,000	0.00%
		豪ドル買/円売 2020年2月	買建	90,000	6,864,138	6,874,200	0.00%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●DCダイワ・ターゲットイヤー 2020

2019年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	13,875円
純資産総額	1.3億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.1%
3カ月間	1.3%
6カ月間	3.1%
1年間	7.5%
3年間	9.2%
5年間	11.1%
設定来	38.8%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第1期 08年12月	第2期 09年12月	第3期 10年12月	第4期 11年12月	第5期 12年12月	第6期 13年12月	第7期 14年12月	第8期 15年12月	第9期 16年12月	第10期 17年12月	第11期 18年12月	第12期 19年12月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内債券	272	52.2%
外国債券	765	19.6%
国内株式・先物	2,129	10.9%
外国株式・先物	1,255	6.0%
外国リート・先物	312	5.1%
国内リート・先物	64	5.0%
外国投資信託等	9	0.1%
コール・ローン、その他		1.7%
合計	4,806	-

通貨別構成	比率
日本円	68.8%
米ドル	17.5%
ユーロ	8.6%
英ポンド	1.9%
豪ドル	0.9%
カナダ・ドル	0.7%
シンガポール・ドル	0.3%
スイス・フラン	0.2%
メキシコ・ペソ	0.2%
その他	0.9%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.2
最終利回り(%)	0.3
修正デュレーション	8.7
残存年数	9.8

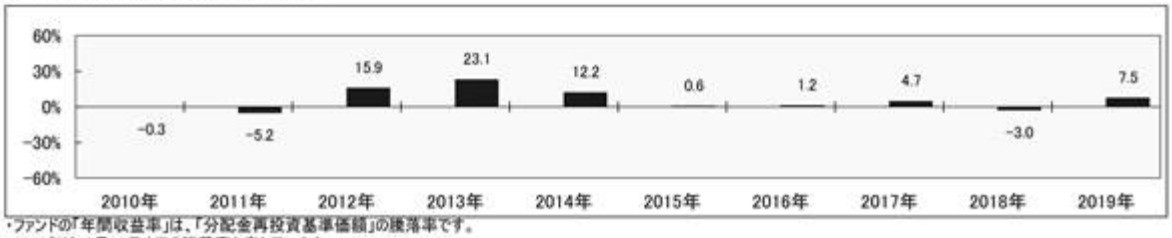
債券格付別構成	比率
AAA	86.8%
AA	5.6%
A	4.4%
BBB	0.2%
BB以下・無格付	3.1%
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	トヨタ自動車	日本	0.4%
株式	S&P500 EMINI FUT 202003	アメリカ	0.2%
株式	ソニー	日本	0.2%
株式	APPLE INC	アメリカ	0.2%
株式	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.2%
リート	日本ビルファンド	日本	0.3%
リート	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
リート	野村不動産マスターF	日本	0.3%
リート	PROLOGIS INC	アメリカ	0.2%
	オリックス不動産投資	日本	0.2%
合計			2.5%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を3.1%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

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2019年は12月30日までの騰落率を表しています。

第２ 【管理及び運営】

１ 【申込(販売)手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、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。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円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、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。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することができます。

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。

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

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

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

3　【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。

・公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。

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

3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)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19日から翌年12月18日までとします。ただし、第1計算期間は、2008年2月28日から2008年12月18日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、あるいは、第14計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約

にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。

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

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

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

② 信託約款の変更等

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

2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

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れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス　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。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。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。

② 償還金にかかる請求権

受益者は、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。

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。

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、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。

③ 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12期計算期間（2018年12月19日から2019年12月18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】

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 2018年12月18日現在	第12期 2019年12月18日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	99,266	－
コール・ローン	415,791	481,159
親投資信託受益証券	143,103,611	135,569,578
流動資産合計	143,618,668	136,050,737
資産合計	143,618,668	136,050,737
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,366	2,384
未払受託者報酬	23,979	22,548
未払委託者報酬	200,174	188,260
その他未払費用	5,918	5,618
流動負債合計	232,437	218,810
負債合計	232,437	218,810
純資産の部		
元本等		
元本	※1 109,880,670	※1 98,220,848
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	33,505,561	37,611,079
（分配準備積立金）	21,232,645	22,489,743
元本等合計	143,386,231	135,831,927
純資産合計	143,386,231	135,831,927
負債純資産合計	143,618,668	136,050,737

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期 自　2017年12月19日 至　2018年12月18日	第12期 自　2018年12月19日 至　2019年12月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	△ 2,299,161	8,707,967
その他収益	210	10
営業収益合計	△ 2,298,951	8,707,977
営業費用		
支払利息	60	8
受託者報酬	48,784	45,726
委託者報酬	407,167	381,619
その他費用	12,020	11,336
営業費用合計	468,031	438,689
営業利益又は営業損失（△）	△ 2,766,982	8,269,288
経常利益又は経常損失（△）	△ 2,766,982	8,269,288
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 2,766,982	8,269,288
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 211,750	1,049,633
期首剰余金又は期首欠損金（△）	39,486,390	33,505,561
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,602,814	3,280,130
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,602,814	3,280,130
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,028,411	6,394,267
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,028,411	6,394,267
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	33,505,561	37,611,079

(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12期 自　2018年12月19日 至　2019年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第11期 2018年12月18日現在	第12期 2019年12月18日現在
1.　※1　期首元本額	120,029,955円	109,880,670円
期中追加設定元本額	8,198,063円	9,205,859円
期中一部解約元本額	18,347,348円	20,865,681円
2.　計算期間末日における受益権の総数	109,880,670口	98,220,848口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第11期 自　2017年12月19日 至　2018年12月18日	第12期 自　2018年12月19日 至　2019年12月18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（31,742,744円）及び分配準備積立金（21,232,645円）より分配可能額は52,975,389円（1万口当たり4,821.17円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、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（2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（5,130,532円）、投資信託約款に規定される収益調整金（29,994,743円）及び分配準備積立金（17,359,209円）より分配可能額は52,484,486円（1万口当たり5,343.52円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、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12期 自　2018年12月19日 至　2019年12月18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12期 2019年12月18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11期 2018年12月18日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第12期 2019年12月18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	△2,229,350	7,162,067
合計	△2,229,350	7,162,067

（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11期 2018年12月18日現在	第12期 2019年12月18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12期 自　2018年12月19日 至　2019年12月18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11期 2018年12月18日現在	第12期 2019年12月18日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3049円 (13,049円)	1.3829円 (13,829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	13,334,541	15,076,032	
	外国株式インデックスマザーファンド	2,984,064	8,323,151	
	外国債券インデックスマザーファンド	9,435,326	27,215,254	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	2,036,683	6,577,060	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	2,670,316	6,673,653	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	51,940,084	67,496,139	
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	4,013,246	4,208,289	
親投資信託受益証券　合計			135,569,578	
合計			135,569,578	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」受益証券、「ダイワ短期日本債券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12月18日現在	2019年12月18日現在
		金　額（円）	金　額（円）
資産の部			
流動資産			
金銭信託		3,981,864,844	－
コール・ローン		16,678,698,103	12,454,495,771
株式	※3※4	132,803,813,650	159,283,041,130
派生商品評価勘定		－	7,155,750
未収入金		2,682,956	3,473,900
未収配当金		16,140,750	16,030,170
未収利息		719,210	590,417
前払金		11,280,000	－
その他未収収益	※5	4,527,606	4,758,152
差入委託証拠金		－	9,120,000
流動資産合計		153,499,727,119	171,778,665,290
資産合計		153,499,727,119	171,778,665,290
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		28,126,860	－
前受金		－	12,060,000
未払解約金		58,304,300	343,821,540
受入担保金		19,684,511,815	11,536,217,070
その他未払費用		81,047	－
流動負債合計		19,771,024,022	11,892,098,610
負債合計		19,771,024,022	11,892,098,610
純資産の部			

元本等		
元本　※1	134,974,559,390	141,422,704,097
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）　※2	△1,245,856,293	18,463,862,583
元本等合計	133,728,703,097	159,886,566,680
純資産合計	133,728,703,097	159,886,566,680
負債純資産合計	153,499,727,119	171,778,665,290

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2018年12月19日 至　2019年12月18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12月18日現在	2019年12月18日現在
1．※1　期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	128,399,557,544円	134,974,559,390円
期中追加設定元本額	18,708,118,755円	33,367,159,925円
期中一部解約元本額	12,133,116,909円	26,919,015,218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	4,201,513,179円	3,719,414,431円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	8,723,420,410円	7,472,340,169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	50,876,443円	5,762,559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)	1,048,156,296円	755,697,182円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	59,087,088円	46,148,600円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,439,870,693円	1,115,043,907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）	4,688,328円	51,012,739円
Ｄ－Ｉ's　ＴＯＰＩＸインデックス	40,048,507円	54,294,452円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	20,229,721円	15,656,840円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	687,039円	8,197,584円

ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	806,893,142円	1,316,972,376円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,341,607,768円	2,037,018,533円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	19,858,640円	65,777,526円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	65,589,578,535円	64,855,332,336円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,638,256,874円	2,833,642,415円
ダイワ・ライフ・バランス５０	2,934,310,951円	3,207,500,578円
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,837,773,343円	2,977,185,378円
年金ダイワ日本株式インデックス	4,616,032,022円	4,811,890,255円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	15,233,589円	13,334,541円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	53,028,188円	55,271,798円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	16,953,280円	25,479,310円
ダイワつみたてインデックス日本株式	18,427,073円	307,233,273円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	1,704,936円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	442,340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	184,088,109円	147,492,253円

	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	161,522,359円	156,190,807円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	9,663,609,360円	8,482,950,539円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	11,266,082円	－円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	14,433,489円	－円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	825,057,420円	719,627,452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	111,646,037円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	221,128,598円	215,465,757円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	145,177,137円	146,213,096円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	8,514,418,449円	10,009,316,770円
	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	305,043,025円	7,734,871,439円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	1,909,937,672円	2,552,426,398円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,392,102,290円	1,308,512,347円
	ダイワライフスタイル２５	181,541,595円	177,904,636円
	ダイワライフスタイル５０	651,110,098円	657,000,114円
	ダイワライフスタイル７５	544,233,554円	529,188,026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）	13,558,323,550円	12,659,614,337円
計		134,974,559,390円	141,422,704,097円
2.	期末日における受益権の総数	134,974,559,390口	141,422,704,097口
3. ※2	元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,245,856,293円であります。	――――――

4．※3　貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　18,392,303,350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　11,000,632,750円
5．※4　差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　677,500,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　579,220,000円
6．※5　その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分2,970,375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3,445,420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19日 至　2019年12月18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18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12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△18,231,339,771	10,882,388,969
合計	△18,231,339,771	10,882,388,969

（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12月18日まで、及び2019年9月20日から2019年12月18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12月18日 現在				2019年12月18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	948,200,000	－	920,105,000	△28,095,000	598,850,000	－	606,025,000	7,175,000
合計	948,200,000	－	920,105,000	△28,095,000	598,850,000	－	606,025,000	7,175,000

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2018年12月18日現在	2019年12月18日現在
1口当たり純資産額	0.9908円	1.1306円
（1万口当たり純資産額）	(9,908円)	(11,306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	3,100	2,851.00	8,838,100	貸付株式数	100株
日本水産	88,300	651.00	57,483,300		
マルハニチロ	12,800	2,787.00	35,673,600		
ホウスイ	600	872.00	523,200	貸付株式数	200株
カネコ種苗	2,700	1,494.00	4,033,800		
サカタのタネ	10,500	3,665.00	38,482,500	貸付株式数	4,200株
ホクト	6,700	2,004.00	13,426,800	貸付株式数	2,400株
ホクリヨウ	1,400	687.00	961,800		
ヒノキヤグループ	2,200	2,307.00	5,075,400	貸付株式数	800株 (200株)
ショーボンドＨＤ	12,600	4,570.00	57,582,000		

ミライト・ホールディングス	26,300	1,669.00	43,894,700	貸付株式数	10,600株
タマホーム	4,300	1,709.00	7,348,700		
サンヨーホームズ	900	672.00	604,800	貸付株式数	300株
日本アクア	3,600	652.00	2,347,200	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	632.00	1,769,600	貸付株式数	1,000株
ベステラ	1,500	1,254.00	1,881,000	貸付株式数	600株 (600株)
スペースバリューＨＤ	10,900	520.00	5,668,000		
住石ホールディングス	18,400	153.00	2,815,200	貸付株式数	7,100株
日鉄鉱業	2,000	5,140.00	10,280,000		
三井松島ＨＬＤＧＳ	3,300	1,208.00	3,986,400		
国際石油開発帝石	353,800	1,139.00	402,978,200		
石油資源開発	11,500	3,060.00	35,190,000		
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,300	1,650.00	7,095,000		
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,030.00	1,751,000		
第一カッター興業	1,100	1,814.00	1,995,400	貸付株式数	400株
安藤・間	52,500	958.00	50,295,000		
東急建設	25,700	778.00	19,994,600		
コムシスホールディングス	31,300	3,180.00	99,534,000		
ミサワホーム	6,100	1,204.00	7,344,400		
ビーアールホールディングス	9,900	494.00	4,890,600		
高松コンストラクショングループ	5,500	2,849.00	15,669,500		
東建コーポレーション	2,700	7,380.00	19,926,000	貸付株式数	1,000株
ソネック	900	815.00	733,500	貸付株式数	100株
ヤマウラ	3,900	898.00	3,502,200		
大成建設	67,900	4,510.00	306,229,000		
大　林　組	203,500	1,241.00	252,543,500		
清水建設	206,600	1,126.00	232,631,600		
飛島建設	5,800	1,514.00	8,781,200		
長谷工コーポレーシヨン	78,800	1,479.00	116,545,200		
松井建設	7,800	808.00	6,302,400		
錢　高　組	900	4,020.00	3,618,000		
鹿島建設	159,800	1,492.00	238,421,600	貸付株式数	63,900株
不動テトラ	5,400	1,655.00	8,937,000		

大末建設	2,200	983.00	2,162,600		
鉄建建設	4,400	2,910.00	12,804,000	貸付株式数	1,600株
西松建設	15,700	2,474.00	38,841,800		
三井住友建設	49,300	636.00	31,354,800		
大豊建設	4,600	2,950.00	13,570,000		
前田建設	51,000	1,073.00	54,723,000	貸付株式数	20,600株
佐田建設	4,600	440.00	2,024,000	貸付株式数	1,600株
ナカノフドー建設	5,300	475.00	2,517,500		
奥　村　組	11,100	2,994.00	33,233,400	貸付株式数	100株
東鉄工業	8,700	3,245.00	28,231,500		
イチケン	1,400	1,800.00	2,520,000		
富士ピー・エス	3,100	604.00	1,872,400		
淺沼組	2,300	4,655.00	10,706,500		
戸田建設	84,400	739.00	62,371,600	貸付株式数	33,200株
熊　谷　組	9,400	3,345.00	31,443,000	貸付株式数	2,500株
北野建設	1,200	2,651.00	3,181,200	貸付株式数	100株
植　木　組	900	2,563.00	2,306,700		
矢作建設	9,000	827.00	7,443,000		
ピーエス三菱	6,700	723.00	4,844,100	貸付株式数	3,000株
日本ハウスＨＬＤＧＳ	13,900	519.00	7,214,100		
大東建託	24,400	13,600.00	331,840,000	貸付株式数	10,300株
新日本建設	8,600	979.00	8,419,400		
ＮＩＰＰＯ	16,800	2,382.00	40,017,600		
東亜道路	1,300	3,690.00	4,797,000	貸付株式数	300株
前田道路	21,600	2,693.00	58,168,800		
日本道路	2,000	6,910.00	13,820,000		
東亜建設	6,400	1,630.00	10,432,000	貸付株式数	2,500株
日本国土開発	11,900	637.00	7,580,300	貸付株式数	4,800株
若築建設	3,600	1,738.00	6,256,800		
東洋建設	22,900	529.00	12,114,100		
五洋建設	80,800	685.00	55,348,000	貸付株式数	32,600株
世紀東急	9,800	903.00	8,849,400		
福　田　組	2,300	5,240.00	12,052,000	貸付株式数	900株
日本ドライケミカル	1,600	1,591.00	2,545,600	貸付株式数	200株
住友林業	51,500	1,620.00	83,430,000		
日本基礎技術	7,000	404.00	2,828,000		
巴コーポレーション	9,000	466.00	4,194,000		
大和ハウス	201,500	3,446.00	694,369,000		
ライト工業	11,600	1,590.00	18,444,000		
積水ハウス	222,700	2,374.50	528,801,150		

日特建設	5,300	847.00	4,489,100	貸付株式数	2,400株
北陸電気工事	3,500	1,110.00	3,885,000		
ユアテック	11,600	716.00	8,305,600	貸付株式数	500株
四電工	1,000	2,837.00	2,837,000		
中電工	8,100	2,610.00	21,141,000		
関　電　工	28,800	1,080.00	31,104,000		
きんでん	48,200	1,720.00	82,904,000		
東京エネシス	6,600	914.00	6,032,400		
トーエネック	2,100	3,910.00	8,211,000		
住友電設	5,800	2,808.00	16,286,400		
日本電設工業	11,100	2,315.00	25,696,500		
協和エクシオ	30,900	2,812.00	86,890,800	貸付株式数	10,900株
新日本空調	5,400	2,213.00	11,950,200		
日本工営	4,200	3,870.00	16,254,000		
九電工	14,300	3,360.00	48,048,000		
三機工業	14,700	1,528.00	22,461,600		
日揮ホールディングス	62,700	1,798.00	112,734,600		
中外炉工業	2,200	1,867.00	4,107,400		
ヤマト	6,600	767.00	5,062,200		
太平電業	4,900	2,325.00	11,392,500		
高砂熱学	17,600	1,983.00	34,900,800		
三晃金属	800	2,670.00	2,136,000		
ＮＥＣネッツエスアイ	6,000	3,570.00	21,420,000		
朝日工業社	1,400	3,410.00	4,774,000		
明星工業	13,200	976.00	12,883,200	貸付株式数	400株
大　氣　社	9,900	4,065.00	40,243,500		
ダイダン	4,900	2,820.00	13,818,000		
日比谷総合設備	6,500	1,988.00	12,922,000	貸付株式数	900株
東芝プラントシステム	15,800	2,665.00	42,107,000		
日本製粉	18,800	1,711.00	32,166,800		
日清製粉Ｇ本社	73,700	1,989.00	146,589,300		
日東富士製粉	500	6,400.00	3,200,000	貸付株式数	100株
昭和産業	5,900	3,150.00	18,585,000	貸付株式数	2,100株
鳥越製粉	5,800	915.00	5,307,000	貸付株式数	100株
中部飼料	8,000	1,584.00	12,672,000		
フィード・ワン	43,800	182.00	7,971,600		
東洋精糖	1,000	1,173.00	1,173,000		
日本甜菜糖	3,400	2,050.00	6,970,000		
三井製糖	5,700	2,320.00	13,224,000		
塩水港精糖	7,300	221.00	1,613,300	貸付株式数	2,800株

日新製糖	2,900	2,041.00	5,918,900	貸付株式数	200株
ＬＩＦＵＬＬ	21,800	553.00	12,055,400	貸付株式数	7,900株
ジェイエイシーリクルートメント	4,200	2,042.00	8,576,400		
日本M&Aセンター	46,900	3,635.00	170,481,500		
メンバーズ	1,900	2,292.00	4,354,800	貸付株式数	500株
中広	600	542.00	325,200		
アイティメディア	1,900	739.00	1,404,100		
タケエイ	6,000	1,296.00	7,776,000		
Ｅ・Ｊホールディングス	700	1,659.00	1,161,300		
トラスト・テック	6,900	1,294.00	8,928,600		
コシダカホールディングス	15,000	1,537.00	23,055,000	貸付株式数	200株
アルトナー	1,500	791.00	1,186,500		
パソナグループ	7,600	1,634.00	12,418,400	貸付株式数	1,200株
ＣＤＳ	1,600	1,663.00	2,660,800	貸付株式数	400株
リンクアンドモチベーション	13,800	634.00	8,749,200	貸付株式数	5,400株
ＧＣＡ	7,600	948.00	7,204,800		
エス・エム・エス	19,400	3,040.00	58,976,000		
サニーサイドアップ	1,400	1,031.00	1,443,400		
パーソルホールディングス	62,100	1,974.00	122,585,400		
リニカル	3,100	1,130.00	3,503,000	貸付株式数	1,200株 (600株)
クックパッド	22,000	367.00	8,074,000		
エスクリ	2,000	769.00	1,538,000		
アイ・ケイ・ケイ	2,700	710.00	1,917,000	貸付株式数	1,100株
森永製菓	15,300	5,450.00	83,385,000		
中　村　屋	1,700	4,430.00	7,531,000		
江崎グリコ	19,300	5,060.00	97,658,000	貸付株式数	7,700株
名糖産業	3,100	1,320.00	4,092,000		
井村屋グループ	2,800	2,016.00	5,644,800		
不　二　家	3,600	2,185.00	7,866,000	貸付株式数	1,400株
山崎製パン	48,900	1,971.00	96,381,900		
第一屋製パン	1,200	990.00	1,188,000	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	5,020.00	5,522,000		
亀田製菓	3,700	4,945.00	18,296,500		
寿スピリッツ	6,300	7,370.00	46,431,000		
カルビー	29,700	3,615.00	107,365,500		
森永乳業	12,100	4,405.00	53,300,500		
六甲バター	4,300	1,804.00	7,757,200		

ヤクルト	44,800	6,040.00	270,592,000		
明治ホールディングス	43,100	7,470.00	321,957,000		
雪印メグミルク	15,700	2,538.00	39,846,600		
プリマハム	10,200	2,551.00	26,020,200	貸付株式数	2,700株
日本ハム	24,900	4,600.00	114,540,000		
林兼産業	2,300	715.00	1,644,500		
丸大食品	7,000	2,356.00	16,492,000	貸付株式数	2,500株
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5,200	2,833.00	14,731,600		
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	41,900	729.00	30,545,100		
学情	2,200	2,171.00	4,776,200	貸付株式数	900株 (900株)
スタジオアリス	3,000	1,915.00	5,745,000		
クロスキャット	1,700	1,177.00	2,000,900		
シミックホールディングス	3,400	1,856.00	6,310,400		
システナ	22,900	1,763.00	40,372,700		
ＮＪＳ	1,300	1,809.00	2,351,700		
デジタルアーツ	3,200	5,450.00	17,440,000	貸付株式数	1,200株
日鉄ソリューションズ	9,700	3,640.00	35,308,000		
綜合警備保障	24,700	5,930.00	146,471,000		
キューブシステム	3,500	794.00	2,779,000		
いちご	81,700	466.00	38,072,200		
エイジア	1,200	1,451.00	1,741,200	貸付株式数	400株
日本駐車場開発	70,900	159.00	11,273,100	貸付株式数	5,700株
コア	2,800	1,406.00	3,936,800	貸付株式数	100株
カカクコム	46,500	2,754.00	128,061,000		
アイロムグループ	2,200	1,498.00	3,295,600		
セントケア・ホールディング	3,800	459.00	1,744,200		
サイネックス	1,100	679.00	746,900	貸付株式数	200株
ルネサンス	3,400	1,727.00	5,871,800		
ディップ	8,800	3,260.00	28,688,000	貸付株式数	200株
ＳＢＳホールディングス	5,600	1,961.00	10,981,600	貸付株式数	2,200株
オプトホールディング	3,400	1,701.00	5,783,400		
新日本科学	6,800	643.00	4,372,400		
ツクイ	14,800	564.00	8,347,200		
キャリアデザインセンター	1,600	1,322.00	2,115,200		
ベネフィット・ワン	17,000	2,243.00	38,131,000	貸付株式数	6,800株
エムスリー	136,800	3,155.00	431,604,000	貸付株式数	55,300株
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	3,800	615.00	2,337,000	貸付株式数	1,500株

ブラス	700	836.00	585,200	貸付株式数	200株
アウトソーシング	35,600	1,178.00	41,936,800		
ウェルネット	6,000	759.00	4,554,000	貸付株式数	1,600株
ワールドホールディングス	2,100	2,050.00	4,305,000	貸付株式数	600株
ディー・エヌ・エー	30,400	1,760.00	53,504,000		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	86,200	1,756.00	151,367,200		
ぐるなび	10,900	1,000.00	10,900,000	貸付株式数	1,500株
タカミヤ	6,700	692.00	4,636,400	貸付株式数	2,600株
ジャパンベストレスキューＳ	4,300	1,132.00	4,867,600	貸付株式数	1,400株
ファンコミュニケーションズ	17,100	499.00	8,532,900		
ライク	2,500	1,598.00	3,995,000	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	2,600	348.00	904,800	貸付株式数	1,000株
エスプール	12,100	763.00	9,232,300		
ＷＤＢホールディングス	2,800	2,560.00	7,168,000		
ティア	3,500	604.00	2,114,000		
ＣＤＧ	700	1,416.00	991,200	貸付株式数	200株 (200株)
バリューコマース	3,500	2,397.00	8,389,500	貸付株式数	1,400株 (1,300株)
インフォマート	34,100	1,910.00	65,131,000	貸付株式数	4,400株
サッポロホールディングス	22,300	2,740.00	61,102,000		
アサヒグループホールディン	136,500	5,175.00	706,387,500		
キリンＨＤ	276,400	2,485.50	686,992,200		
宝ホールディングス	48,800	1,025.00	50,020,000		
オエノンホールディングス	17,400	399.00	6,942,600	貸付株式数	6,800株
養　命　酒	2,000	1,969.00	3,938,000		
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	45,800	2,798.00	128,148,400	貸付株式数	300株
サントリー食品インター	43,600	4,660.00	203,176,000		
ダイドーグループＨＤ	3,300	4,585.00	15,130,500	貸付株式数	1,300株
伊　藤　園	19,800	5,540.00	109,692,000	貸付株式数	8,000株
キーコーヒー	6,400	2,348.00	15,027,200		
ユニカフェ	1,600	1,036.00	1,657,600	貸付株式数	600株
ジャパンフーズ	900	1,260.00	1,134,000		
日清オイリオグループ	8,400	3,870.00	32,508,000		
不二製油グループ	15,900	3,020.00	48,018,000	貸付株式数	6,000株
かどや製油	700	3,725.00	2,607,500	貸付株式数	100株

Ｊ－オイルミルズ	3,400	4,420.00	15,028,000		
ローソン	16,200	6,340.00	102,708,000		
サンエー	5,300	4,990.00	26,447,000	貸付株式数	100株
カワチ薬品	4,900	2,202.00	10,789,800	貸付株式数	700株
エービーシー・マート	10,000	7,430.00	74,300,000		
ハードオフコーポレーション	2,500	817.00	2,042,500		
高千穂交易	2,400	1,125.00	2,700,000	貸付株式数	900株
アスクル	6,700	3,310.00	22,177,000	貸付株式数	2,500株 (100株)
ゲオホールディングス	11,500	1,355.00	15,582,500	貸付株式数	3,700株
アダストリア	8,900	2,614.00	23,264,600		
ジーフット	4,000	622.00	2,488,000	貸付株式数	1,500株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,000	683.00	683,000		
伊藤忠食品	1,600	5,390.00	8,624,000		
くら寿司	3,300	4,960.00	16,368,000	貸付株式数	1,300株
キャンドゥ	3,000	1,652.00	4,956,000	貸付株式数	800株 (600株)
エレマテック	6,000	1,177.00	7,062,000		
パルグループＨＬＤＧＳ	3,300	3,590.00	11,847,000		
ＪＡＬＵＸ	1,800	2,515.00	4,527,000	貸付株式数	700株
エディオン	29,300	1,231.00	36,068,300	貸付株式数	1,600株
あらた	5,100	4,560.00	23,256,000		
サーラコーポレーション	12,800	635.00	8,128,000	貸付株式数	3,200株
ワッツ	2,800	603.00	1,688,400	貸付株式数	500株 (400株)
トーメンデバイス	900	3,075.00	2,767,500	貸付株式数	200株
ハローズ	2,400	2,790.00	6,696,000		
ＪＰホールディングス	19,600	333.00	6,526,800	貸付株式数	7,800株
フジオフードシステム	2,700	3,635.00	9,814,500	貸付株式数	1,000株
あみやき亭	1,300	3,715.00	4,829,500		
東京エレクトロンデバイス	2,300	2,556.00	5,878,800		
ひらまつ	12,000	297.00	3,564,000	貸付株式数	4,700株
フィールズ	5,000	573.00	2,865,000		
双日	353,200	358.00	126,445,600		
アルフレッサホールディングス	71,100	2,291.00	162,890,100		
大黒天物産	1,500	3,230.00	4,845,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,700	1,597.00	9,102,900	貸付株式数	100株

ファーマライズＨＤ	1,500	636.00	954,000		
キッコーマン	46,900	5,510.00	258,419,000		
味　の　素	144,000	1,820.00	262,080,000		
キユーピー	36,200	2,473.00	89,522,600	貸付株式数	14,600株
ハウス食品Ｇ本社	24,300	3,790.00	92,097,000		
カ　ゴ　メ	24,700	2,651.00	65,479,700		
焼津水産化工	3,100	1,043.00	3,233,300		
アリアケジャパン	6,000	7,740.00	46,440,000		
ピエトロ	700	1,637.00	1,145,900		
エバラ食品工業	1,400	2,210.00	3,094,000		
やまみ	300	2,231.00	669,300		
ニチレイ	31,100	2,536.00	78,869,600		
横浜冷凍	18,000	1,011.00	18,198,000		
東洋水産	33,500	4,715.00	157,952,500		
イートアンド	2,200	1,779.00	3,913,800		
大冷	800	1,972.00	1,577,600		
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	3,700	1,104.00	4,084,800	貸付株式数	200株
日清食品ＨＤ	27,700	8,200.00	227,140,000		
永谷園ホールディングス	3,200	2,147.00	6,870,400		
一正蒲鉾	2,500	1,042.00	2,605,000	貸付株式数	800株 (800株)
フジッコ	7,000	1,962.00	13,734,000		
ロックフィールド	7,000	1,545.00	10,815,000	貸付株式数	1,900株
日本たばこ産業	376,100	2,536.50	953,977,650		
ケンコーマヨネーズ	3,700	2,557.00	9,460,900	貸付株式数	1,400株
わらべや日洋ＨＤ	4,300	1,721.00	7,400,300		
なとり	3,600	1,722.00	6,199,200		
イフジ産業	1,100	783.00	861,300	貸付株式数	100株
ピックルスコーポレーション	1,500	3,010.00	4,515,000	貸付株式数	100株
北の達人コーポ	22,900	677.00	15,503,300	貸付株式数	9,200株
ユーグレナ	27,900	787.00	21,957,300	貸付株式数	5,200株 (5,200株)
片倉工業	9,300	1,385.00	12,880,500	貸付株式数	700株
グ　ン　ゼ	4,700	5,000.00	23,500,000	貸付株式数	1,500株
ヒューリック	137,000	1,319.00	180,703,000	貸付株式数	49,500株
神　栄	1,000	743.00	743,000	貸付株式数	100株
ラサ商事	3,400	962.00	3,270,800		
アルペン	5,000	1,855.00	9,275,000	貸付株式数	1,900株

ハブ	1,900	1,009.00	1,917,100	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	3,200	843.00	2,697,600		
クオールホールディングス	9,400	1,556.00	14,626,400		
アルコニックス	6,800	1,446.00	9,832,800		
神戸物産	22,100	3,765.00	83,206,500	貸付株式数	8,800株
ソリトンシステムズ	2,900	1,269.00	3,680,100		
ジンズホールディングス	3,400	7,310.00	24,854,000	貸付株式数	100株
ビックカメラ	37,800	1,252.00	47,325,600		
ＤＣＭホールディングス	34,300	1,070.00	36,701,000	貸付株式数	13,900株
ペッパーフードサービス	5,100	1,362.00	6,946,200	貸付株式数	2,000株 (300株)
ＭｏｎｏｔａＲＯ	45,500	2,805.00	127,627,500	貸付株式数	17,800株 (2,500株)
東京一番フーズ	1,600	628.00	1,004,800	貸付株式数	600株 (600株)
ＤＤホールディングス	2,600	1,507.00	3,918,200	貸付株式数	1,000株
あい　ホールディングス	9,200	2,027.00	18,648,400		
ディーブイエックス	2,300	844.00	1,941,200	貸付株式数	900株
きちりホールディングス	1,700	843.00	1,433,100	貸付株式数	600株
アークランドサービスＨＤ	4,600	1,880.00	8,648,000	貸付株式数	1,800株
Ｊ．　フロント　リテイリング	76,300	1,486.00	113,381,800	貸付株式数	22,700株
ドトール・日レスＨＤ	10,100	2,177.00	21,987,700		
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	26,400	4,370.00	115,368,000	貸付株式数	10,400株
ブロンコビリー	3,300	2,776.00	9,160,800	貸付株式数	1,300株
ＺＯＺＯ	44,000	2,100.00	92,400,000	貸付株式数	27,400株
トレジャー・ファクトリー	1,900	1,072.00	2,036,800		
物語コーポレーション	1,600	8,530.00	13,648,000	貸付株式数	600株 (100株)
ココカラファイン	6,700	6,510.00	43,617,000	貸付株式数	200株
三越伊勢丹ＨＤ	111,900	1,013.00	113,354,700		
東洋紡	25,200	1,640.00	41,328,000		
ユニチカ	18,900	398.00	7,522,200	貸付株式数	1,000株
富士紡ホールディングス	3,100	3,505.00	10,865,500		
日清紡ホールディングス	43,200	1,063.00	45,921,600		
倉敷紡績	6,500	2,608.00	16,952,000	貸付株式数	400株
ダイワボウＨＤ	5,400	6,390.00	34,506,000	貸付株式数	200株
シキボウ	3,400	1,010.00	3,434,000		
日東紡績	9,700	4,365.00	42,340,500	貸付株式数	200株
トヨタ紡織	18,900	1,837.00	34,719,300	貸付株式数	8,600株

マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	15,300	1,915.00	29,299,500		
Ｈａｍｅｅ	2,000	1,326.00	2,652,000	貸付株式数	700株
ラクト・ジャパン	2,400	3,525.00	8,460,000	貸付株式数	1,000株 (500株)
ウエルシアＨＤ	19,000	6,850.00	130,150,000	貸付株式数	7,600株
クリエイトＳＤＨ	9,300	2,724.00	25,333,200	貸付株式数	3,800株
バイタルＫＳＫＨＤ	12,000	1,054.00	12,648,000	貸付株式数	4,800株
八洲電機	4,900	917.00	4,493,300		
メディアスホールディングス	3,700	828.00	3,063,600		
レスターホールディングス	6,600	2,022.00	13,345,200	貸付株式数	2,600株
ジューテックＨＤ	1,500	1,163.00	1,744,500	貸付株式数	500株
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	7,200	377.00	2,714,400		
大光	2,800	690.00	1,932,000		
ＯＣＨＩホールディングス	1,900	1,470.00	2,793,000		
ＴＯＫＡＩホールディングス	33,900	1,138.00	38,578,200	貸付株式数	1,400株
黒谷	1,500	460.00	690,000	貸付株式数	500株
ミサワ	1,300	750.00	975,000	貸付株式数	100株
ティーライフ	900	894.00	804,600	貸付株式数	300株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,100	822.00	904,200		
エー・ピーカンパニー	1,200	550.00	660,000	貸付株式数	400株
三洋貿易	3,200	2,447.00	7,830,400		
チムニー	1,800	2,312.00	4,161,600	貸付株式数	700株
シュッピン	4,400	1,161.00	5,108,400	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ビューティガレージ	1,100	2,570.00	2,827,000	貸付株式数	400株
ウイン・パートナーズ	4,700	1,513.00	7,111,100		
ネクステージ	9,200	1,262.00	11,610,400	貸付株式数	3,600株
ジョイフル本田	18,700	1,468.00	27,451,600		
鳥貴族	2,100	2,257.00	4,739,700	貸付株式数	900株
キリン堂ホールディングス	2,500	2,089.00	5,222,500		
ホットランド	4,400	1,375.00	6,050,000	貸付株式数	1,700株
すかいらーくＨＤ	71,700	2,193.00	157,238,100	貸付株式数	29,000株 (2,800株)
ＳＦＰホールディングス	2,700	2,262.00	6,107,400		
綿半ホールディングス	2,400	1,960.00	4,704,000	貸付株式数	900株
日本毛織	20,800	1,145.00	23,816,000	貸付株式数	7,900株
ダイトウボウ	11,500	84.00	966,000	貸付株式数	2,900株

トーア紡コーポレーション	2,600	588.00	1,528,800		
ダイドーリミテツド	8,500	280.00	2,380,000		
ヨシックス	1,100	2,786.00	3,064,600	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパーマーケ	18,500	969.00	17,926,500		
三栄建築設計	2,600	1,606.00	4,175,600	貸付株式数	300株
野村不動産ＨＬＤＧＳ	38,900	2,612.00	101,606,800		
三重交通グループＨＤ	13,000	620.00	8,060,000	貸付株式数	3,500株
サムティ	9,100	2,184.00	19,874,400	貸付株式数	3,600株
エー・ディー・ワークス	121,800	30.00	3,654,000		
日本商業開発	4,200	1,618.00	6,795,600	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーション	10,400	1,165.00	12,116,000		
ユニゾホールディングス	9,700	4,895.00	47,481,500	貸付株式数	3,600株
日本管理センター	4,300	1,272.00	5,469,600	貸付株式数	1,600株
サンセイランディック	2,000	905.00	1,810,000		
エストラスト	900	810.00	729,000	貸付株式数	300株
フージャースＨＤ	12,900	730.00	9,417,000	貸付株式数	4,900株
オープンハウス	18,600	3,165.00	58,869,000	貸付株式数	7,500株
東急不動産ＨＤ	174,500	771.00	134,539,500		
飯田ＧＨＤ	53,400	1,945.00	103,863,000		
イーグランド	1,100	836.00	919,600		
帝国繊維	7,200	2,121.00	15,271,200		
日本コークス工業	54,800	80.00	4,384,000		
ゴルフダイジェスト・オン	2,900	688.00	1,995,200	貸付株式数	1,100株
ミタチ産業	1,600	761.00	1,217,600		
ＢＥＥＮＯＳ	2,300	1,381.00	3,176,300	貸付株式数	900株
あさひ	4,700	1,325.00	6,227,500	貸付株式数	1,900株
日本調剤	1,900	3,745.00	7,115,500		
コスモス薬品	2,800	22,850.00	63,980,000	貸付株式数	1,100株
シップヘルスケアＨＤ	10,300	4,985.00	51,345,500		
トーエル	3,100	795.00	2,464,500	貸付株式数	100株
ソフトクリエイトＨＤ	2,900	1,811.00	5,251,900	貸付株式数	200株
オンリー	1,100	807.00	887,700		
セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ	250,200	4,072.00	1,018,814,400	貸付株式数	106,600株
クリエイト・レストランツ・ホール	17,200	1,821.00	31,321,200	貸付株式数	6,800株
明治電機工業	2,000	1,673.00	3,346,000		
ツルハホールディングス	13,900	13,600.00	189,040,000	貸付株式数	5,600株
デリカフーズＨＬＤＧＳ	2,300	725.00	1,667,500	貸付株式数	200株

スターティアホールディングス	1,500	737.00	1,105,500	貸付株式数	400株
サンマルクホールディングス	5,000	2,325.00	11,625,000		
フェリシモ	1,400	1,028.00	1,439,200		
トリドールホールディングス	8,000	2,743.00	21,944,000	貸付株式数	800株 (800株)
帝　人	51,800	2,099.00	108,728,200	貸付株式数	4,900株
東　レ	460,500	755.30	347,815,650		
ク　ラ　レ	100,100	1,371.00	137,237,100		
旭　化　成	421,400	1,268.00	534,335,200		
サカイオーベックス	1,700	1,861.00	3,163,700		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	5,800	645.00	3,741,000	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
稲葉製作所	3,600	1,460.00	5,256,000		
宮地エンジニアリングＧ	1,900	2,093.00	3,976,700	貸付株式数	700株
トーカロ	17,900	1,154.00	20,656,600		
アルファＣＯ	2,200	1,303.00	2,866,600		
ＳＵＭＣＯ	76,800	1,761.00	135,244,800		
川田テクノロジーズ	1,300	6,760.00	8,788,000		
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	1,800	3,930.00	7,074,000	貸付株式数	300株
信和	2,800	1,089.00	3,049,200		
ビーロット	1,500	2,018.00	3,027,000	貸付株式数	600株
ファーストブラザーズ	1,500	1,292.00	1,938,000	貸付株式数	100株
ハウスドゥ	3,600	1,495.00	5,382,000	貸付株式数	1,400株 (600株)
シーアールイー	1,800	1,104.00	1,987,200		
プロパティエージェント	1,000	1,150.00	1,150,000	貸付株式数	300株
ケイアイスター不動産	2,100	2,165.00	4,546,500		
アグレ都市デザイン	1,100	548.00	602,800		
ジェイ・エス・ビー	700	5,120.00	3,584,000		
テンポイノベーション	1,400	1,045.00	1,463,000	貸付株式数	200株
グロバルリンクマネジメント	1,100	676.00	743,600	貸付株式数	400株
住江織物	1,900	2,953.00	5,610,700	貸付株式数	700株
日本フエルト	3,400	500.00	1,700,000		
イチカワ	900	1,521.00	1,368,900	貸付株式数	100株
エコナックホールディングス	11,400	139.00	1,584,600	貸付株式数	200株

日東製網	800	1,691.00	1,352,800		
芦森工業	1,300	1,407.00	1,829,100		
アツギ	5,400	857.00	4,627,800		
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	1,100	987.00	1,085,700		
ジャパンミート	3,200	2,204.00	7,052,800		
コメダホールディングス	14,000	2,086.00	29,204,000	貸付株式数	400株
サツドラホールディングス	900	1,800.00	1,620,000	貸付株式数	300株
デファクトスタンダード	600	397.00	238,200		
アレンザホールディングス	3,300	959.00	3,164,700	貸付株式数	1,200株 (300株)
串カツ田中ＨＬＤＧＳ	1,000	2,142.00	2,142,000	貸付株式数	300株
バロックジャパン	4,600	951.00	4,374,600	貸付株式数	1,700株
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	6,400	7,150.00	45,760,000	貸付株式数	2,500株
ダイニック	2,300	800.00	1,840,000		
共和レザー	3,500	829.00	2,901,500		
力の源ＨＤ	3,000	872.00	2,616,000		
スシローグローバルＨＬＤＧＳ	7,000	8,840.00	61,880,000		
ＬＩＸＩＬビバ	6,400	1,960.00	12,544,000		
セーレン	15,700	1,578.00	24,774,600		
ソトー	2,300	974.00	2,240,200	貸付株式数	1,000株
東海染工	900	1,139.00	1,025,100		
小松マテーレ	10,300	823.00	8,476,900		
ワコールホールディングス	16,600	2,983.00	49,517,800		
ホギメディカル	7,200	3,665.00	26,388,000		
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	487.00	827,900		
ＴＳＩホールディングス	21,300	553.00	11,778,900		
マツオカコーポレーション	1,900	2,429.00	4,615,100		
ワールド	9,000	2,813.00	25,317,000		
ＴＩＳ	21,300	6,550.00	139,515,000		
ネオス	2,600	805.00	2,093,000	貸付株式数	1,000株
電算システム	2,500	3,045.00	7,612,500	貸付株式数	900株
グリー	43,800	504.00	22,075,200		
コーエーテクモＨＤ	13,000	2,764.00	35,932,000		
三菱総合研究所	2,800	4,230.00	11,844,000		
ボルテージ	1,300	665.00	864,500	貸付株式数	400株
電算	700	2,233.00	1,563,100	貸付株式数	100株 (100株)
ＡＧＳ	3,700	805.00	2,978,500		

ファインデックス	5,500	1,363.00	7,496,500		
ブレインパッド	1,300	5,630.00	7,319,000	貸付株式数	500株
ＫＬａｂ	12,400	828.00	10,267,200	貸付株式数	4,900株
ポールトゥウィン・ピットクル	7,700	982.00	7,561,400		
イーブックイニシアティブ	900	1,857.00	1,671,300	貸付株式数	300株
ネクソン	181,400	1,466.00	265,932,400	貸付株式数	73,400株
アイスタイル	16,600	705.00	11,703,000	貸付株式数	6,000株
エムアップ	1,900	2,487.00	4,725,300	貸付株式数	800株
エイチーム	4,400	1,147.00	5,046,800	貸付株式数	1,600株
エニグモ	4,600	924.00	4,250,400	貸付株式数	1,800株
テクノスジャパン	5,000	497.00	2,485,000	貸付株式数	2,000株
ｅｎｉｓｈ	2,900	643.00	1,864,700	貸付株式数	1,100株
コロプラ	20,900	1,266.00	26,459,400	貸付株式数	8,400株 (4,500株)
オルトプラス	4,700	1,132.00	5,320,400	貸付株式数	1,700株
ブロードリーフ	32,000	680.00	21,760,000	貸付株式数	12,700株
クロス・マーケティングＧ	2,900	367.00	1,064,300	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	3,500	1,028.00	3,598,000		
システム情報	3,300	1,029.00	3,395,700		
メディアドゥＨＬＤＧＳ	2,000	3,950.00	7,900,000	貸付株式数	800株
じげん	15,900	540.00	8,586,000		
ブイキューブ	4,000	601.00	2,404,000	貸付株式数	1,500株
エンカレッジ・テクノロジ	1,100	898.00	987,800	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	1,000	1,271.00	1,271,000	貸付株式数	300株
ディー・エル・イー	4,300	195.00	838,500		
フィックスターズ	6,900	1,477.00	10,191,300	貸付株式数	2,700株
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,100	1,245.00	3,859,500	貸付株式数	800株
オプティム	1,700	3,235.00	5,499,500	貸付株式数	1,000株
セレス	2,100	1,212.00	2,545,200	貸付株式数	800株 (800株)
特種東海製紙	4,000	4,085.00	16,340,000	貸付株式数	500株
ティーガイア	5,700	2,689.00	15,327,300	貸付株式数	1,700株
セック	1,000	3,735.00	3,735,000	貸付株式数	400株
日本アジアグループ	6,800	383.00	2,604,400		
豆蔵ホールディングス	4,500	1,435.00	6,457,500		
テクマトリックス	4,600	2,335.00	10,741,000		
プロシップ	1,900	1,470.00	2,793,000		

ガンホー・オンライン・エンター	15,400	2,342.00	36,066,800	貸付株式数	500株
GMOペイメントゲートウェイ	10,500	7,290.00	76,545,000	貸付株式数	4,200株
ザッパラス	3,500	414.00	1,449,000	貸付株式数	1,300株
システムリサーチ	1,700	1,795.00	3,051,500		
インターネットイニシアティブ	9,400	2,794.00	26,263,600		
さくらインターネット	6,900	685.00	4,726,500		
ヴィンクス	1,800	1,257.00	2,262,600	貸付株式数	200株
GMOクラウド	1,200	2,602.00	3,122,400	貸付株式数	400株 (400株)
ＳＲＡホールディングス	3,500	2,617.00	9,159,500		
システムインテグレータ	2,100	819.00	1,719,900		
朝日ネット	4,500	625.00	2,812,500		
ｅＢＡＳＥ	3,900	1,126.00	4,391,400		
アバント	4,700	1,006.00	4,728,200		
アドソル日進	2,300	2,246.00	5,165,800	貸付株式数	900株
フリービット	3,800	882.00	3,351,600	貸付株式数	1,500株
コムチュア	7,200	2,434.00	17,524,800		
サイバーコム	1,200	2,240.00	2,688,000		
アステリア	4,100	626.00	2,566,600		
アイル	2,300	2,105.00	4,841,500	貸付株式数	900株
王子ホールディングス	265,800	633.00	168,251,400		
日本製紙	28,200	1,878.00	52,959,600	貸付株式数	11,200株
三菱製紙	7,400	493.00	3,648,200		
北越コーポレーション	42,000	582.00	24,444,000		
中越パルプ	2,700	1,690.00	4,563,000		
巴川製紙	2,000	891.00	1,782,000	貸付株式数	800株
大王製紙	27,900	1,510.00	42,129,000	貸付株式数	10,900株
阿波製紙	1,700	586.00	996,200		
マークラインズ	3,200	2,004.00	6,412,800		
メディカル・データ・ビジ	4,900	848.00	4,155,200	貸付株式数	1,900株
ｇｕｍｉ	8,300	874.00	7,254,200		
ショーケース	1,500	663.00	994,500	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,500	1,351.00	2,026,500	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,400	2,319.00	5,565,600		
デジタル・インフォメーション	2,900	1,659.00	4,811,100		
ＰＣＩホールディングス	1,300	2,195.00	2,853,500	貸付株式数	500株

パイプドHD	800	1,726.00	1,380,800	貸付株式数	300株 (200株)
アイビーシー	1,200	1,229.00	1,474,800	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,200	1,016.00	1,219,200	貸付株式数	400株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	600	2,206.00	1,323,600	貸付株式数	200株
ランドコンピュータ	1,000	1,183.00	1,183,000		
ダブルスタンダード	800	4,805.00	3,844,000		
オープンドア	3,200	1,633.00	5,225,600	貸付株式数	1,200株
マイネット	2,100	670.00	1,407,000		
アカツキ	2,300	5,740.00	13,202,000	貸付株式数	900株 (100株)
ベネフィットジャパン	500	1,663.00	831,500	貸付株式数	100株 (100株)
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	1,400	1,149.00	1,608,600	貸付株式数	500株
ＬＩＮＥ	14,600	5,230.00	76,358,000	貸付株式数	5,000株
カナミックネットワーク	4,000	713.00	2,852,000		
ノムラシステムコーポレーション	1,400	598.00	837,200	貸付株式数	500株
レンゴー	60,100	843.00	50,664,300		
トーモク	3,900	1,847.00	7,203,300	貸付株式数	1,400株
ザ・パック	4,800	4,045.00	19,416,000		
チェンジ	1,300	2,633.00	3,422,900	貸付株式数	500株
シンクロ・フード	2,700	552.00	1,490,400		
オークネット	3,900	1,423.00	5,549,700	貸付株式数	1,500株
セグエグループ	1,100	888.00	976,800		
エイトレッド	800	1,607.00	1,285,600	貸付株式数	200株 (200株)
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,400	735.00	4,704,000		
マクロミル	11,500	1,004.00	11,546,000		
ビーグリー	1,300	1,370.00	1,781,000	貸付株式数	400株
オロ	1,700	3,775.00	6,417,500	貸付株式数	600株 (200株)
テモナ	800	478.00	382,400	貸付株式数	300株
ニーズウェル	800	760.00	608,000		
サインポスト	1,000	2,115.00	2,115,000	貸付株式数	300株
昭和電工	45,200	3,020.00	136,504,000	貸付株式数	18,100株
住友化学	466,500	505.00	235,582,500		
住友精化	2,900	3,665.00	10,628,500		

日産化学	35,600	4,795.00	170,702,000		
ラサ工業	2,300	1,606.00	3,693,800	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,400	6,700.00	36,180,000		
多木化学	1,900	4,530.00	8,607,000	貸付株式数	700株
テイカ	4,700	1,884.00	8,854,800		
石原産業	11,400	1,093.00	12,460,200		
片倉コープアグリ	1,700	1,212.00	2,060,400		
日本曹達	9,400	3,045.00	28,623,000	貸付株式数	800株
東ソー	98,200	1,718.00	168,707,600		
トクヤマ	18,300	2,927.00	53,564,100		
セントラル硝子	13,000	2,707.00	35,191,000		
東亞合成	39,900	1,306.00	52,109,400		
大阪ソーダ	6,500	3,140.00	20,410,000		
関東電化	15,200	1,008.00	15,321,600		
デンカ	23,200	3,390.00	78,648,000		
イビデン	39,800	2,655.00	105,669,000		
信越化学	109,200	12,105.00	1,321,866,000		
日本カーバイド	2,200	1,498.00	3,295,600		
堺　化　学	4,100	2,599.00	10,655,900		
第一稀元素化学工	6,900	885.00	6,106,500		
エア・ウォーター	52,100	1,618.00	84,297,800		
大陽日酸	61,200	2,447.00	149,756,400	貸付株式数	1,000株
日本化学工業	2,000	3,430.00	6,860,000		
東邦アセチレン	900	1,359.00	1,223,100		
日本パーカライジング	32,000	1,185.00	37,920,000		
高圧ガス	10,200	880.00	8,976,000		
チタン工業	800	2,665.00	2,132,000	貸付株式数	300株
四国化成	9,800	1,353.00	13,259,400		
戸田工業	1,500	2,229.00	3,343,500		
ステラ　ケミファ	3,500	3,215.00	11,252,500	貸付株式数	1,400株
保土谷化学	2,400	4,040.00	9,696,000		
日本触媒	9,900	6,850.00	67,815,000		
大日精化	5,700	3,405.00	19,408,500		
カネカ	16,400	3,655.00	59,942,000		
協和キリン	65,300	2,443.00	159,527,900		
三菱瓦斯化学	60,000	1,698.00	101,880,000		
三井化学	57,700	2,729.00	157,463,300		
ＪＳＲ	59,300	2,101.00	124,589,300		
東京応化工業	10,900	4,430.00	48,287,000		
大阪有機化学	5,900	1,513.00	8,926,700	貸付株式数	2,300株

三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	424,900	837.00	355,641,300		
ＫＨネオケム	11,200	2,374.00	26,588,800	貸付株式数	4,500株
ダイセル	87,000	1,062.00	92,394,000		
住友ベークライト	10,000	4,220.00	42,200,000		
積水化学	136,600	1,921.00	262,408,600		
日本ゼオン	57,400	1,404.00	80,589,600		
アイカ工業	19,100	3,575.00	68,282,500		
宇部興産	32,100	2,435.00	78,163,500		
積水樹脂	11,400	2,361.00	26,915,400		
タキロンシーアイ	13,700	716.00	9,809,200		
旭有機材	3,600	1,712.00	6,163,200		
日立化成	29,400	4,080.00	119,952,000		
ニチバン	3,400	1,980.00	6,732,000		
リケンテクノス	15,900	526.00	8,363,400		
大倉工業	3,000	2,016.00	6,048,000		
積水化成品	8,500	822.00	6,987,000		
群栄化学	1,500	2,657.00	3,985,500		
タイガース　ポリマー	3,200	609.00	1,948,800		
ミライアル	2,300	1,397.00	3,213,100		
ダイキアクシス	2,300	1,008.00	2,318,400	貸付株式数	900株
ダイキョーニシカワ	13,300	887.00	11,797,100	貸付株式数	1,600株
竹本容器	2,300	1,002.00	2,304,600	貸付株式数	900株
森六ホールディングス	3,400	2,433.00	8,272,200		
日本化薬	39,300	1,357.00	53,330,100		
カーリットホールディングス	6,800	650.00	4,420,000		
ＥＰＳホールディングス	9,300	1,476.00	13,726,800		
ソルクシーズ	2,800	940.00	2,632,000	貸付株式数	1,000株
レッグス	1,600	1,629.00	2,606,400	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	23,400	994.00	23,259,600		
フェイス	2,300	799.00	1,837,700		
プロトコーポレーション	5,800	1,186.00	6,878,800		
ハイマックス	800	2,014.00	1,611,200	貸付株式数	300株
アミューズ	3,400	3,040.00	10,336,000		
野村総合研究所	106,600	2,345.00	249,977,000	貸付株式数	43,100株
ドリームインキュベータ	1,900	1,608.00	3,055,200		
サイバネットシステム	4,700	874.00	4,107,800		
クイック	3,900	1,672.00	6,520,800		
ＴＡＣ	4,100	227.00	930,700	貸付株式数	1,200株
ＣＥホールディングス	3,800	478.00	1,816,400		

ケネディクス	59,000	581.00	34,279,000		
日本システム技術	1,100	1,268.00	1,394,800		
電通	63,900	3,905.00	249,529,500		
インテージホールディングス	8,000	930.00	7,440,000		
テイクアンドギヴニーズ	2,400	1,261.00	3,026,400		
東邦システムサイエンス	1,700	921.00	1,565,700	貸付株式数	200株
ぴあ	1,800	4,950.00	8,910,000	貸付株式数	400株 (400株)
イオンファンタジー	2,400	2,917.00	7,000,800	貸付株式数	900株
ソースネクスト	30,500	447.00	13,633,500	貸付株式数	12,000株
シーティーエス	7,100	788.00	5,594,800	貸付株式数	600株
ネクシィーズグループ	2,200	1,844.00	4,056,800	貸付株式数	800株
インフォコム	7,100	2,516.00	17,863,600		
メディカルシステムネットワーク	6,300	532.00	3,351,600		
日本精化	5,100	1,283.00	6,543,300	貸付株式数	1,800株
扶桑化学工業	6,500	3,150.00	20,475,000		
トリケミカル	1,400	8,270.00	11,578,000	貸付株式数	500株
ラクスル	3,400	3,560.00	12,104,000	貸付株式数	1,300株
ＦＩＧ	7,100	310.00	2,201,000	貸付株式数	2,700株
ＡＤＥＫＡ	29,200	1,667.00	48,676,400		
日油	23,900	3,695.00	88,310,500		
ミヨシ油脂	2,500	1,304.00	3,260,000		
新日本理化	10,800	208.00	2,246,400	貸付株式数	1,100株
ハリマ化成グループ	5,300	1,184.00	6,275,200		
アルテリア・ネットワークス	7,100	1,637.00	11,622,700		
ヒト・コミュニケーションズＨＤ	1,500	1,550.00	2,325,000		
花　王	155,500	9,044.00	1,406,342,000		
第一工業製薬	2,400	4,610.00	11,064,000		
石原ケミカル	1,700	2,050.00	3,485,000		
日華化学	2,100	937.00	1,967,700	貸付株式数	800株
ニイタカ	900	1,785.00	1,606,500	貸付株式数	200株
三洋化成	3,800	5,470.00	20,786,000		
武田薬品	540,200	4,470.00	2,414,694,000		
アステラス製薬	571,100	1,894.00	1,081,663,400		
大日本住友製薬	48,200	2,122.00	102,280,400		
塩野義製薬	83,000	6,690.00	555,270,000		

田辺三菱製薬	79,400	2,005.00	159,197,000		
わかもと製薬	8,200	275.00	2,255,000	貸付株式数	3,000株
あすか製薬	7,400	1,278.00	9,457,200		
日本新薬	17,000	9,330.00	158,610,000		
ビオフエルミン製薬	1,100	2,397.00	2,636,700		
中外製薬	67,700	10,025.00	678,692,500		
科研製薬	11,100	6,110.00	67,821,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
エーザイ	77,700	8,147.00	633,021,900		
理研ビタミン	3,100	4,060.00	12,586,000		
ロート製薬	33,300	3,360.00	111,888,000		
小野薬品	149,100	2,461.50	367,009,650		
久光製薬	19,200	5,380.00	103,296,000		
有機合成薬品	5,000	312.00	1,560,000	貸付株式数	1,900株
持田製薬	9,000	4,590.00	41,310,000		
参天製薬	120,900	2,015.00	243,613,500		
扶桑薬品	2,300	2,086.00	4,797,800		
日本ケミファ	900	2,980.00	2,682,000		
ツムラ	20,100	3,225.00	64,822,500		
日医工	18,400	1,395.00	25,668,000		
テ　ル　モ	183,800	3,931.00	722,517,800	貸付株式数	68,400株
みらかホールディングス	17,400	2,639.00	45,918,600		
キッセイ薬品工業	11,500	3,120.00	35,880,000		
生化学工業	12,500	1,254.00	15,675,000	貸付株式数	500株
栄研化学	11,500	2,046.00	23,529,000	貸付株式数	4,500株
日水製薬	2,700	1,290.00	3,483,000		
鳥居薬品	4,100	2,982.00	12,226,200		
ＪＣＲファーマ	4,600	8,710.00	40,066,000		
東和薬品	8,300	2,889.00	23,978,700	貸付株式数	2,700株
富士製薬工業	4,400	1,363.00	5,997,200		
沢井製薬	13,300	6,820.00	90,706,000		
ゼリア新薬工業	11,800	2,082.00	24,567,600	貸付株式数	2,600株
第一三共	185,800	7,004.00	1,301,343,200		
キョーリン製薬ＨＤ	14,200	1,926.00	27,349,200		
大幸薬品	2,700	3,165.00	8,545,500		
ダイト	3,800	3,185.00	12,103,000	貸付株式数	1,500株
大塚ホールディングス	123,700	4,952.00	612,562,400		
大正製薬ＨＤ	13,700	8,250.00	113,025,000		
ペプチドリーム	32,900	5,190.00	170,751,000	貸付株式数	13,200株
大日本塗料	7,100	1,195.00	8,484,500		

日本ペイントＨＯＬＤ	52,500	5,500.00	288,750,000		
関西ペイント	71,500	2,675.00	191,262,500	貸付株式数	9,800株
神東塗料	5,000	218.00	1,090,000	貸付株式数	1,100株
中国塗料	18,200	1,044.00	19,000,800		
日本特殊塗料	4,800	1,512.00	7,257,600		
藤倉化成	8,500	586.00	4,981,000		
太陽ホールディングス	4,700	4,345.00	20,421,500		
ＤＩＣ	26,800	3,090.00	82,812,000		
サカタインクス	13,900	1,224.00	17,013,600		
東洋インキＳＣホールディン	13,400	2,706.00	36,260,400		
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	4,800	1,035.00	4,968,000		
アルプス技研	5,500	2,036.00	11,198,000		
サニックス	11,100	360.00	3,996,000	貸付株式数	4,400株 (4,200株)
ダイオーズ	1,200	1,340.00	1,608,000	貸付株式数	300株
日本空調サービス	6,500	838.00	5,447,000		
オリエンタルランド	66,000	14,950.00	986,700,000	貸付株式数	26,400株
フォーカスシステムズ	4,000	887.00	3,548,000		
ダスキン	15,900	3,065.00	48,733,500		
パーク２４	34,400	2,629.00	90,437,600	貸付株式数	13,900株
明光ネットワークジャパン	7,300	1,018.00	7,431,400	貸付株式数	2,900株
ファルコホールディングス	3,400	1,779.00	6,048,600	貸付株式数	100株
クレスコ	2,000	3,540.00	7,080,000		
フジ・メディア・ＨＤ	61,300	1,567.00	96,057,100		
秀英予備校	1,400	460.00	644,000	貸付株式数	600株
田谷	1,200	622.00	746,400		
ラウンドワン	17,400	1,058.00	18,409,200		
リゾートトラスト	28,500	1,864.00	53,124,000		
オービック	22,100	14,530.00	321,113,000		
ジャストシステム	10,400	6,140.00	63,856,000		
ＴＤＣソフト	5,800	921.00	5,341,800	貸付株式数	2,200株
Ｚホールディングス	875,300	421.00	368,501,300	貸付株式数	1,500株
ビー・エム・エル	8,000	3,030.00	24,240,000		
ワタベウェディング	1,000	592.00	592,000		
トレンドマイクロ	28,400	5,790.00	164,436,000		
りらいあコミュニケーショ	11,200	1,419.00	15,892,800		
ＩＤホールディングス	2,500	1,525.00	3,812,500	貸付株式数	900株
リソー教育	28,400	384.00	10,905,600		
日本オラクル	13,000	9,950.00	129,350,000	貸付株式数	5,200株

早稲田アカデミー	2,000	947.00	1,894,000		
アルファシステムズ	2,100	2,893.00	6,075,300	貸付株式数	700株
フューチャー	7,800	1,869.00	14,578,200		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,200	1,653.00	6,942,600		
ＳＢテクノロジー	2,300	1,936.00	4,452,800		
トーセ	1,800	916.00	1,648,800	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	69,500	2,063.00	143,378,500		
オービックビジネスＣ	6,600	5,100.00	33,660,000	貸付株式数	1,100株
伊藤忠テクノソリュー	29,200	3,075.00	89,790,000		
アイティフォー	7,900	876.00	6,920,400		
東京個別指導学院	2,200	711.00	1,564,200	貸付株式数	800株
東計電算	1,000	3,680.00	3,680,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	35,700	3,815.00	136,195,500	貸付株式数	14,200株
楽天	289,300	929.00	268,759,700		
エックスネット	1,000	978.00	978,000		
クリーク・アンド・リバー社	3,200	1,117.00	3,574,400		
テー・オー・ダブリュー	5,400	878.00	4,741,200		
大塚商会	34,600	4,560.00	157,776,000		
サイボウズ	7,600	1,227.00	9,325,200		
ソフトブレーン	3,800	609.00	2,314,200	貸付株式数	1,500株
山田コンサルティングＧＰ	3,000	1,646.00	4,938,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
セントラルスポーツ	2,300	3,290.00	7,567,000	貸付株式数	200株
パラカ	1,600	2,044.00	3,270,400		
電通国際情報Ｓ	4,000	4,215.00	16,860,000		
デジタルガレージ	11,500	4,440.00	51,060,000	貸付株式数	800株
イーエムシステムズ	4,600	2,064.00	9,494,400	貸付株式数	1,800株
ウェザーニューズ	2,100	3,480.00	7,308,000	貸付株式数	800株 (700株)
ＣＩＪ	4,900	957.00	4,689,300	貸付株式数	1,000株
ビジネスエンジニアリング	700	3,135.00	2,194,500		
日本エンタープライズ	6,600	234.00	1,544,400	貸付株式数	2,400株
WOWOW	3,000	2,800.00	8,400,000		
スカラ	4,600	766.00	3,523,600		
インテリジェント　ウェイブ	2,400	763.00	1,831,200	貸付株式数	900株
フルキャストホールディングス	6,200	2,418.00	14,991,600		
エン・ジャパン	11,000	5,120.00	56,320,000		

富士フイルムＨＬＤＧＳ	124,500	5,277.00	656,986,500		
コニカミノルタ	142,200	724.00	102,952,800		
資　生　堂	129,000	7,889.00	1,017,681,000		
ライオン	84,400	2,151.00	181,544,400		
高砂香料	4,100	2,574.00	10,553,400		
マンダム	14,600	3,025.00	44,165,000	貸付株式数	3,000株
ミルボン	8,700	6,210.00	54,027,000		
ファンケル	26,300	2,888.00	75,954,400		
コーセー	12,200	16,240.00	198,128,000	貸付株式数	4,900株
コタ	3,400	1,520.00	5,168,000	貸付株式数	1,300株
シーボン	900	2,505.00	2,254,500		
ポーラ・オルビスＨＤ	27,700	2,689.00	74,485,300		
ノエビアホールディングス	6,200	5,780.00	35,836,000		
アジュバンコスメジャパン	1,400	953.00	1,334,200	貸付株式数	500株 (100株)
エステー	4,200	1,747.00	7,337,400		
アグロカネショウ	2,100	1,479.00	3,105,900	貸付株式数	800株
コ　ニ　シ	10,600	1,515.00	16,059,000		
長谷川香料	8,600	2,050.00	17,630,000		
星光ＰＭＣ	3,800	1,039.00	3,948,200	貸付株式数	1,400株
小林製薬	18,200	9,230.00	167,986,000		
荒川化学工業	5,800	1,662.00	9,639,600		
メック	4,500	1,607.00	7,231,500	貸付株式数	1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,650.00	4,770,000	貸付株式数	300株
タカラバイオ	17,000	2,095.00	35,615,000		
ＪＣＵ	7,900	3,290.00	25,991,000		
新田ゼラチン	4,100	691.00	2,833,100	貸付株式数	300株
ＯＡＴアグリオ	1,100	1,632.00	1,795,200	貸付株式数	400株
デクセリアルズ	16,900	1,096.00	18,522,400		
アース製薬	4,900	5,780.00	28,322,000	貸付株式数	1,900株
北興化学	6,500	602.00	3,913,000		
大成ラミック	2,200	2,909.00	6,399,800		
クミアイ化学	26,900	960.00	25,824,000	貸付株式数	10,800株
日本農薬	11,800	581.00	6,855,800	貸付株式数	4,600株
富士興産	2,000	704.00	1,408,000	貸付株式数	300株 (300株)
ニチレキ	7,700	1,346.00	10,364,200		
ユシロ化学	3,600	1,471.00	5,295,600		
ビーピー・カストロール	2,300	1,596.00	3,670,800		

富士石油	17,500	247.00	4,322,500	貸付株式数	7,000株
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,300	1,416.00	3,256,800		
出光興産	73,000	3,030.00	221,190,000		
ＪＸＴＧホールディングス	1,006,400	505.80	509,037,120		
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	18,800	2,564.00	48,203,200	貸付株式数	2,700株
横浜ゴム	37,500	2,273.00	85,237,500		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	37,400	1,648.00	61,635,200		
ブリヂストン	199,500	4,256.00	849,072,000		
住友ゴム	58,200	1,403.00	81,654,600		
藤倉コンポジット	5,800	497.00	2,882,600		
オカモト	3,900	4,125.00	16,087,500		
アキレス	4,500	1,869.00	8,410,500		
フ　コ　ク	3,000	735.00	2,205,000		
ニッタ	7,300	3,360.00	24,528,000		
クリエートメディック	2,000	1,106.00	2,212,000		
住友理工	12,700	1,051.00	13,347,700		
三ツ星ベルト	8,500	2,170.00	18,445,000		
バンドー化学	11,300	968.00	10,938,400		
ＡＧＣ	64,200	3,985.00	255,837,000		
日本板硝子	31,100	664.00	20,650,400		
石塚硝子	1,200	2,435.00	2,922,000		
有沢製作所	10,300	1,020.00	10,506,000	貸付株式数	1,100株
日本山村硝子	2,800	1,323.00	3,704,400		
日本電気硝子	26,000	2,469.00	64,194,000		
オハラ	2,600	1,390.00	3,614,000	貸付株式数	1,000株
住友大阪セメント	12,300	4,920.00	60,516,000		
太平洋セメント	41,000	3,380.00	138,580,000		
リソルホールディングス	700	4,100.00	2,870,000	貸付株式数	200株
日本ヒユーム	6,600	866.00	5,715,600	貸付株式数	2,600株
日本コンクリート	14,300	290.00	4,147,000		
三谷セキサン	3,000	3,760.00	11,280,000		
アジアパイルＨＤ	9,300	617.00	5,738,100	貸付株式数	2,900株
東海カーボン	68,000	1,115.00	75,820,000	貸付株式数	27,500株 (100株)
日本カーボン	3,300	4,350.00	14,355,000	貸付株式数	1,300株
東洋炭素	3,800	2,370.00	9,006,000		
ノリタケ	3,600	4,700.00	16,920,000		
ＴＯＴＯ	46,400	4,770.00	221,328,000	貸付株式数	18,500株
日本碍子	79,200	1,905.00	150,876,000		

日本特殊陶業	50,600	2,106.00	106,563,600	貸付株式数	8,000株
ダントーホールディングス	5,400	118.00	637,200		
ＭＡＲＵＷＡ	2,500	8,180.00	20,450,000		
品川リフラクトリーズ	1,700	3,575.00	6,077,500		
黒崎播磨	1,300	6,480.00	8,424,000		
ヨータイ	5,100	737.00	3,758,700		
イソライト	3,400	677.00	2,301,800		
東京窯業	8,300	352.00	2,921,600	貸付株式数	3,300株
ニッカトー	2,900	819.00	2,375,100		
フジミインコーポレーテッド	5,800	2,968.00	17,214,400		
クニミネ工業	2,800	1,386.00	3,880,800		
エーアンドエーマテリアル	1,000	1,386.00	1,386,000		
ニチアス	17,800	2,781.00	49,501,800		
日本製鉄	287,200	1,716.00	492,835,200		
神戸製鋼所	117,600	607.00	71,383,200		
中山製鋼所	8,800	572.00	5,033,600		
合同製鐵	3,500	2,840.00	9,940,000		
ＪＦＥホールディングス	173,300	1,483.00	257,003,900		
東京製鐵	31,200	805.00	25,116,000		
共英製鋼	7,300	2,151.00	15,702,300		
大和工業	13,600	2,763.00	37,576,800		
東京鐵鋼	2,600	1,601.00	4,162,600	貸付株式数	600株
大阪製鐵	3,400	1,406.00	4,780,400		
淀川製鋼所	8,600	2,084.00	17,922,400		
丸一鋼管	20,800	3,180.00	66,144,000		
モリ工業	1,900	2,550.00	4,845,000		
大同特殊鋼	10,500	4,955.00	52,027,500	貸付株式数	4,200株
日本高周波	2,400	431.00	1,034,400		
日本冶金工	5,300	2,355.00	12,481,500		
山陽特殊製鋼	4,700	1,603.00	7,534,100		
愛知製鋼	3,600	3,995.00	14,382,000		
日立金属	69,200	1,541.00	106,637,200		
日本金属	1,600	967.00	1,547,200		
大平洋金属	4,400	2,611.00	11,488,400	貸付株式数	1,700株
新日本電工	41,500	180.00	7,470,000	貸付株式数	16,700株
栗本鉄工所	3,300	2,148.00	7,088,400		
虹　技	1,000	1,467.00	1,467,000	貸付株式数	300株
日本鋳鉄管	700	1,332.00	932,400	貸付株式数	200株
日本製鋼所	19,500	2,167.00	42,256,500		

三菱製鋼	4,900	1,113.00	5,453,700		
日亜鋼業	9,600	353.00	3,388,800		
日本精線	1,000	3,265.00	3,265,000		
エンビプロＨＤ	2,500	818.00	2,045,000	貸付株式数	500株
大紀アルミニウム	10,500	787.00	8,263,500		
日本軽金属ＨＤ	162,000	237.00	38,394,000		
三井金属	17,300	2,890.00	49,997,000		
東邦亜鉛	3,300	2,134.00	7,042,200		
三菱マテリアル	42,400	3,065.00	129,956,000		
住友鉱山	82,100	3,637.00	298,597,700		
ＤＯＷＡホールディングス	16,200	4,175.00	67,635,000		
古河機金	11,400	1,490.00	16,986,000		
エス・サイエンス	29,700	50.00	1,485,000		
大阪チタニウム	6,700	1,536.00	10,291,200		
東邦チタニウム	11,600	949.00	11,008,400	貸付株式数	4,600株
ＵＡＣＪ	9,800	2,594.00	25,421,200		
ＣＫサンエツ	1,300	3,415.00	4,439,500		
古河電工	19,900	2,948.00	58,665,200		
住友電工	239,800	1,675.00	401,665,000		
フジクラ	77,800	463.00	36,021,400	貸付株式数	31,000株
昭和電線ＨＬＤＧＳ	7,500	1,294.00	9,705,000		
東京特殊電線	1,000	2,267.00	2,267,000		
タツタ電線	12,700	611.00	7,759,700		
カナレ電気	1,000	1,875.00	1,875,000	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	2,400	1,541.00	3,698,400	貸付株式数	900株
リョービ	7,900	2,094.00	16,542,600		
アーレステイ	8,400	567.00	4,762,800		
アサヒＨＤ	11,300	2,659.00	30,046,700		
東洋製罐グループＨＤ	40,900	2,027.00	82,904,300		
ホッカンホールディングス	3,500	1,992.00	6,972,000		
コロナ	3,700	1,125.00	4,162,500		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	12,000	1,974.00	23,688,000		
ＯＳＪＢ　ＨＤ	32,000	271.00	8,672,000		
駒井ハルテック	1,200	1,820.00	2,184,000		
高田機工	600	2,683.00	1,609,800	貸付株式数	200株
三和ホールディングス	61,500	1,252.00	76,998,000		
文化シヤッター	18,800	993.00	18,668,400	貸付株式数	7,600株
三協立山	9,000	1,288.00	11,592,000	貸付株式数	3,600株
アルインコ	4,700	1,297.00	6,095,900		
東洋シヤッター	1,600	723.00	1,156,800		

ＬＩＸＩＬグループ	94,800	1,989.00	188,557,200	貸付株式数	37,900株
日本フイルコン	4,900	515.00	2,523,500	貸付株式数	1,700株
ノーリツ	13,300	1,524.00	20,269,200		
長府製作所	6,600	2,511.00	16,572,600		
リンナイ	12,500	8,630.00	107,875,000		
ユニプレス	12,500	1,634.00	20,425,000		
ダイニチ工業	3,500	697.00	2,439,500		
日東精工	8,900	643.00	5,722,700		
三洋工業	800	2,029.00	1,623,200		
岡　部	12,900	959.00	12,371,100	貸付株式数	200株
ジーテクト	7,900	1,818.00	14,362,200		
東　プ　レ	11,900	1,809.00	21,527,100		
高周波熱錬	12,300	918.00	11,291,400	貸付株式数	700株
東京製綱	4,600	1,319.00	6,067,400		
サンコール	3,400	580.00	1,972,000		
モリテックスチル	5,200	418.00	2,173,600		
パイオラックス	9,500	2,233.00	21,213,500	貸付株式数	500株
エイチワン	6,300	846.00	5,329,800	貸付株式数	800株
日本発条	68,900	1,020.00	70,278,000		
中央発條	700	3,095.00	2,166,500		
アドバネクス	900	1,629.00	1,466,100		
三浦工業	27,800	3,740.00	103,972,000		
タ　ク　マ	21,700	1,333.00	28,926,100		
テクノプロ・ホールディング	12,400	7,860.00	97,464,000		
アトラ	1,500	370.00	555,000	貸付株式数	500株
インターワークス	1,300	532.00	691,600		
アイ・アールジャパンＨＤ	2,500	4,830.00	12,075,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
ＫｅｅＰｅｒ技研	2,300	1,312.00	3,017,600		
ファーストロジック	1,400	635.00	889,000	貸付株式数	400株
三機サービス	1,400	1,036.00	1,450,400	貸付株式数	500株
Ｇｕｎｏｓｙ	4,300	1,542.00	6,630,600	貸付株式数	1,600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	2,022.00	6,470,400	貸付株式数	1,200株
リブセンス	4,100	302.00	1,238,200	貸付株式数	300株 (300株)
ジャパンマテリアル	19,100	1,771.00	33,826,100		
ベクトル	7,800	1,019.00	7,948,200	貸付株式数	1,900株
ウチヤマホールディングス	3,200	547.00	1,750,400	貸付株式数	100株

チャームケアコーポレーション	2,000	1,951.00	3,902,000	貸付株式数	800株 (100株)
ライクキッズ	1,500	824.00	1,236,000	貸付株式数	400株
キャリアリンク	2,100	599.00	1,257,900	貸付株式数	800株
ＩＢＪ	4,300	1,068.00	4,592,400	貸付株式数	1,600株
アサンテ	2,500	2,058.00	5,145,000	貸付株式数	900株
Ｎ・フィールド	4,300	671.00	2,885,300	貸付株式数	1,700株
バリューＨＲ	1,300	3,580.00	4,654,000	貸付株式数	400株
M&Aキャピタルパートナー	4,400	4,185.00	18,414,000	貸付株式数	800株
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,400	2,015.00	4,836,000	貸付株式数	900株 (900株)
ＥＲＩホールディングス	1,800	781.00	1,405,800	貸付株式数	100株
アビスト	900	2,632.00	2,368,800	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	4,300	2,245.00	9,653,500	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ウィルグループ	4,100	1,204.00	4,936,400	貸付株式数	1,500株
エスクローＡＪ	8,700	228.00	1,983,600	貸付株式数	3,400株
リクルートホールディングス	444,500	4,133.00	1,837,118,500		
エラン	3,700	1,620.00	5,994,000	貸付株式数	1,400株
ツ　ガ　ミ	13,400	1,105.00	14,807,000	貸付株式数	5,300株
オークマ	7,500	5,870.00	44,025,000		
東芝機械	7,300	2,988.00	21,812,400	貸付株式数	2,900株
アマダホールディングス	81,500	1,262.00	102,853,000		
アイダエンジニア	17,400	1,006.00	17,504,400		
滝澤鉄工所	2,000	1,429.00	2,858,000		
ＦＵＪＩ	27,600	1,989.00	54,896,400	貸付株式数	11,000株
牧野フライス	7,600	4,970.00	37,772,000		
オーエスジー	29,600	2,103.00	62,248,800	貸付株式数	12,000株
ダイジェット	700	1,505.00	1,053,500		
旭ダイヤモンド	16,800	662.00	11,121,600		
DMG森精機	40,600	1,697.00	68,898,200	貸付株式数	15,600株
ソディツク	15,200	998.00	15,169,600	貸付株式数	300株
ディスコ	8,700	25,990.00	226,113,000	貸付株式数	3,400株
日東工器	3,500	2,498.00	8,743,000		
日進工具	1,900	2,549.00	4,843,100		
パンチ工業	5,900	550.00	3,245,000	貸付株式数	2,300株
冨士ダイス	2,800	691.00	1,934,800	貸付株式数	1,100株

土木管理総合試験	2,600	471.00	1,224,600	貸付株式数	1,000株
ネットマーケティング	2,300	984.00	2,263,200		
日本郵政	508,400	1,047.50	532,549,000		
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	10,400	1,718.00	17,867,200	貸付株式数	1,000株
鎌倉新書	4,700	1,679.00	7,891,300	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ＳＭＮ	1,000	837.00	837,000		
一蔵	700	757.00	529,900		
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,200	2,254.00	4,958,800	貸付株式数	300株
グローバルキッズＣＯＭＰ	900	722.00	649,800	貸付株式数	300株
エボラブルアジア	2,800	2,009.00	5,625,200		
アトラエ	1,600	3,600.00	5,760,000	貸付株式数	600株
ストライク	2,400	4,275.00	10,260,000		
ソラスト	17,100	1,228.00	20,998,800		
セラク	2,000	789.00	1,578,000	貸付株式数	700株
インソース	3,000	3,425.00	10,275,000	貸付株式数	1,200株
豊田自動織機	52,500	6,460.00	339,150,000		
豊和工業	3,500	866.00	3,031,000	貸付株式数	300株
ＯＫＫ	2,600	674.00	1,752,400		
石川製作所	1,600	1,922.00	3,075,200	貸付株式数	600株
東洋機械金属	4,300	563.00	2,420,900		
津田駒工業	1,300	1,303.00	1,693,900		
エンシュウ	1,500	1,374.00	2,061,000	貸付株式数	200株
島精機製作所	10,300	2,704.00	27,851,200	貸付株式数	4,100株
オプトラン	7,200	3,010.00	21,672,000	貸付株式数	500株
ＮＣホールディングス	2,000	692.00	1,384,000	貸付株式数	700株
イワキポンプ	3,100	1,202.00	3,726,200		
フリュー	6,200	1,060.00	6,572,000		
ヤマシンフィルタ	14,100	859.00	12,111,900	貸付株式数	5,600株 (2,100株)
日阪製作所	7,900	1,025.00	8,097,500		
やまびこ	12,500	1,214.00	15,175,000		
平田機工	3,000	7,190.00	21,570,000	貸付株式数	1,200株
ペガサスミシン製造	6,400	514.00	3,289,600		
マルマエ	2,700	978.00	2,640,600	貸付株式数	1,000株
タツモ	3,000	1,310.00	3,930,000	貸付株式数	1,200株
ナブテスコ	37,800	3,345.00	126,441,000	貸付株式数	2,700株
三井海洋開発	6,900	2,693.00	18,581,700		
レオン自動機	6,300	1,635.00	10,300,500		

ＳＭＣ	20,400	50,660.00	1,033,464,000	貸付株式数	4,000株 (4,000株)
ヤマハモーターロボＨＬＤＧＳ	5,700	604.00	3,442,800	貸付株式数	100株
ホソカワミクロン	2,300	4,675.00	10,752,500		
ユニオンツール	2,400	3,250.00	7,800,000		
オイレス工業	8,300	1,702.00	14,126,600		
日精エーエスビー	2,200	4,760.00	10,472,000	貸付株式数	800株
サト－ホールディングス	9,300	3,425.00	31,852,500		
技研製作所	5,700	4,910.00	27,987,000		
日本エアーテック	2,000	748.00	1,496,000		
カ　ワ　タ	1,900	1,190.00	2,261,000	貸付株式数	700株
日精樹脂工業	5,400	1,039.00	5,610,600		
オカダアイヨン	2,100	1,276.00	2,679,600	貸付株式数	800株
ワイエイシイホールディングス	2,800	795.00	2,226,000	貸付株式数	1,100株
小松製作所	294,000	2,700.00	793,800,000	貸付株式数	117,600株
住友重機械	37,100	3,200.00	118,720,000		
日立建機	26,000	3,285.00	85,410,000	貸付株式数	10,400株
日　工	9,000	885.00	7,965,000		
巴工業	2,700	2,309.00	6,234,300	貸付株式数	1,100株
井関農機	6,500	1,672.00	10,868,000		
ＴＯＷＡ	6,700	1,183.00	7,926,100		
丸山製作所	1,500	1,262.00	1,893,000		
北川鉄工所	2,800	2,396.00	6,708,800		
シンニッタン	10,100	448.00	4,524,800		
ローツェ	2,900	4,190.00	12,151,000	貸付株式数	500株
タカキタ	2,300	612.00	1,407,600	貸付株式数	800株
クボタ	344,500	1,781.00	613,554,500		
荏原実業	1,600	2,260.00	3,616,000		
東洋エンジニア	8,700	723.00	6,290,100	貸付株式数	900株 (700株)
三菱化工機	2,300	1,958.00	4,503,400	貸付株式数	100株
月島機械	11,900	1,700.00	20,230,000		
帝国電機製作所	5,400	1,399.00	7,554,600		
東京機械	2,700	375.00	1,012,500		
新東工業	15,200	1,089.00	16,552,800	貸付株式数	700株
渋谷工業	5,700	3,170.00	18,069,000		
アイチ　コーポレーション	11,300	742.00	8,384,600	貸付株式数	4,400株
小森コーポレーション	16,400	1,148.00	18,827,200	貸付株式数	6,200株

鶴見製作所	5,000	2,074.00	10,370,000		
住友精密	1,000	3,400.00	3,400,000		
日本ギア工業	2,000	402.00	804,000	貸付株式数	700株
酒井重工業	1,300	2,987.00	3,883,100		
荏原製作所	26,800	3,405.00	91,254,000		
石井鉄工所	900	2,521.00	2,268,900		
西島製作所	6,600	948.00	6,256,800	貸付株式数	900株
北越工業	6,700	1,310.00	8,777,000		
ダイキン工業	82,700	15,725.00	1,300,457,500		
オルガノ	2,400	6,650.00	15,960,000	貸付株式数	700株
トーヨーカネツ	2,900	2,389.00	6,928,100		
栗田工業	35,100	3,245.00	113,899,500		
椿本チエイン	9,200	3,920.00	36,064,000		
大同工業	3,100	839.00	2,600,900		
日　機　装	19,500	1,417.00	27,631,500		
木村化工機	5,500	722.00	3,971,000	貸付株式数	2,100株
レイズネクスト	10,900	1,369.00	14,922,100		
アネスト岩田	10,100	1,069.00	10,796,900	貸付株式数	3,500株
ダイフク	33,200	6,520.00	216,464,000	貸付株式数	13,400株
サムコ	1,800	1,422.00	2,559,600		
加藤製作所	3,600	1,762.00	6,343,200	貸付株式数	100株
油研工業	1,000	1,737.00	1,737,000	貸付株式数	400株
タダノ	31,500	997.00	31,405,500	貸付株式数	12,600株
フジテック	23,700	1,770.00	41,949,000		
ＣＫＤ	18,200	1,840.00	33,488,000		
キトー	4,900	1,710.00	8,379,000		
平和	18,000	2,252.00	40,536,000		
理想科学工業	5,900	1,937.00	11,428,300		
ＳＡＮＫＹＯ	14,400	3,620.00	52,128,000		
日本金銭機械	7,400	918.00	6,793,200	貸付株式数	600株
マースグループＨＬＤＧＳ	4,000	2,048.00	8,192,000		
フクシマガリレイ	4,000	4,135.00	16,540,000		
オーイズミ	2,800	576.00	1,612,800	貸付株式数	500株
ダイコク電機	3,000	1,672.00	5,016,000		
竹内製作所	10,900	1,681.00	18,322,900		
ア　マ　ノ	17,100	3,390.00	57,969,000		
ＪＵＫＩ	9,000	896.00	8,064,000		
サンデンホールディングス	8,700	857.00	7,455,900	貸付株式数	2,900株 (2,900株)
蛇の目ミシン	6,000	415.00	2,490,000		

ブラザー工業	79,400	2,311.00	183,493,400	貸付株式数	32,100株
マックス	10,000	2,116.00	21,160,000		
モリタホールディングス	11,300	1,791.00	20,238,300		
グローリー	18,100	3,315.00	60,001,500		
新晃工業	6,100	2,005.00	12,230,500		
大和冷機工業	9,400	1,292.00	12,144,800		
セガサミーホールディングス	64,400	1,619.00	104,263,600		
日本ピストンリング	2,400	1,563.00	3,751,200		
リ　ケ　ン	3,000	4,315.00	12,945,000	貸付株式数	100株
ＴＰＲ	8,700	2,181.00	18,974,700		
ツバキ・ナカシマ	13,300	1,683.00	22,383,900		
ホシザキ	19,000	9,970.00	189,430,000		
大豊工業	5,500	908.00	4,994,000		
日本精工	122,300	1,059.00	129,515,700		
Ｎ　Ｔ　Ｎ	151,000	346.00	52,246,000	貸付株式数	60,100株
ジェイテクト	62,100	1,356.00	84,207,600		
不　二　越	6,000	4,905.00	29,430,000	貸付株式数	2,400株
ミネベアミツミ	120,500	2,307.00	277,993,500		
日本トムソン	19,300	500.00	9,650,000		
Ｔ　Ｈ　Ｋ	37,800	2,936.00	110,980,800		
ユーシン精機	5,100	1,047.00	5,339,700		
前澤給装工業	2,300	2,211.00	5,085,300		
イーグル工業	8,000	1,122.00	8,976,000		
前澤工業	4,000	391.00	1,564,000		
日本ピラー工業	6,600	1,545.00	10,197,000		
キッツ	26,300	759.00	19,961,700		
日　立	311,900	4,465.00	1,392,633,500		
三菱電機	649,200	1,522.00	988,082,400		
富士電機	39,100	3,390.00	132,549,000		
東洋電機製造	2,600	1,578.00	4,102,800	貸付株式数	500株
安川電機	69,900	4,300.00	300,570,000	貸付株式数	29,900株
シンフォニア　テクノロジー	8,400	1,363.00	11,449,200		
明　電　舎	11,900	2,259.00	26,882,100		
オリジン	1,800	1,508.00	2,714,400		
山洋電気	3,100	5,470.00	16,957,000		
デンヨー	5,600	2,081.00	11,653,600		
ベイカレントコンサルティング	3,800	5,400.00	20,520,000	貸付株式数	1,200株

ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	1,300	1,086.00	1,411,800	貸付株式数	400株
アイモバイル	2,000	664.00	1,328,000	貸付株式数	700株
キャリアインデックス	2,600	429.00	1,115,400	貸付株式数	1,000株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2,100	1,566.00	3,288,600		
船場	1,000	1,178.00	1,178,000		
グレイステクノロジー	2,800	2,716.00	7,604,800	貸付株式数	1,100株
ジャパンエレベーターＳＨＤ	6,600	2,715.00	17,919,000		
フルテック	900	1,420.00	1,278,000	貸付株式数	300株 (300株)
グリーンズ	2,300	1,170.00	2,691,000	貸付株式数	900株
ツナググループＨＬＤＧＳ	800	617.00	493,600		
ソウルドアウト	1,000	1,789.00	1,789,000	貸付株式数	300株
ＭＳ&ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	900	1,025.00	922,500		
日総工産	4,200	1,056.00	4,435,200		
キュービーネットＨＬＤＧＳ	3,800	2,349.00	8,926,200	貸付株式数	1,500株
ＲＰＡホールディングス	3,600	1,131.00	4,071,600	貸付株式数	1,400株
三桜工業	8,300	1,422.00	11,802,600	貸付株式数	3,300株
マキタ	84,700	3,765.00	318,895,500		
東芝テック	8,300	4,530.00	37,599,000		
芝浦メカトロニクス	1,100	3,700.00	4,070,000	貸付株式数	400株
マブチモーター	17,900	4,300.00	76,970,000	貸付株式数	2,000株
日本電産	78,100	15,395.00	1,202,349,500	貸付株式数	31,600株
ユーエムシーエレクトロニクス	4,000	538.00	2,152,000	貸付株式数	1,500株
トレックス・セミコンダクター	3,700	1,633.00	6,042,100	貸付株式数	200株
東光高岳	3,600	1,195.00	4,302,000		
ダブル・スコープ	9,900	1,040.00	10,296,000	貸付株式数	3,800株 (100株)
宮越ホールディングス	2,500	1,106.00	2,765,000	貸付株式数	900株
ダイヘン	7,100	3,655.00	25,950,500		
ヤーマン	9,500	743.00	7,058,500	貸付株式数	3,800株
ＪＶＣケンウッド	53,900	272.00	14,660,800		
ミマキエンジニアリング	5,800	520.00	3,016,000		
第一精工	2,400	2,466.00	5,918,400	貸付株式数	500株 (500株)

日新電機	15,200	1,345.00	20,444,000		
大崎電気	12,800	724.00	9,267,200		
オムロン	60,400	6,580.00	397,432,000		
日東工業	9,600	2,591.00	24,873,600		
ＩＤＥＣ	9,400	2,276.00	21,394,400	貸付株式数	2,400株
正興電機製作所	1,600	911.00	1,457,600	貸付株式数	600株
不二電機工業	700	1,295.00	906,500	貸付株式数	300株 (200株)
ジーエス・ユアサ　コーポ	21,700	2,423.00	52,579,100		
サクサホールディングス	1,400	1,937.00	2,711,800		
メルコホールディングス	2,200	3,065.00	6,743,000	貸付株式数	600株
テクノメディカ	1,500	2,110.00	3,165,000	貸付株式数	300株
日本電気	78,800	4,565.00	359,722,000	貸付株式数	13,200株
富　士　通	62,600	10,280.00	643,528,000		
沖　電　気	26,400	1,569.00	41,421,600		
岩崎通信機	2,700	833.00	2,249,100		
電気興業	3,200	3,250.00	10,400,000		
サンケン電気	7,100	3,275.00	23,252,500	貸付株式数	2,800株
ナカヨ	1,300	1,697.00	2,206,100		
アイホン	3,700	1,910.00	7,067,000		
ルネサスエレクトロニクス	309,800	761.00	235,757,800		
セイコーエプソン	80,800	1,722.00	139,137,600	貸付株式数	1,400株
ワコム	43,900	481.00	21,115,900		
アルバック	12,900	4,575.00	59,017,500	貸付株式数	200株
アクセル	2,700	807.00	2,178,900	貸付株式数	900株
ＥＩＺＯ	5,000	4,045.00	20,225,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	75.00	4,627,500	貸付株式数	55,600株
日本信号	16,500	1,469.00	24,238,500		
京三製作所	15,300	590.00	9,027,000		
能美防災	8,600	2,460.00	21,156,000		
ホーチキ	4,700	1,789.00	8,408,300		
星和電機	3,300	595.00	1,963,500		
エレコム	7,000	4,315.00	30,205,000		
パナソニック	742,000	1,025.50	760,921,000		
シャープ	75,400	1,728.00	130,291,200	貸付株式数	6,100株
アンリツ	41,800	2,152.00	89,953,600	貸付株式数	16,900株
富士通ゼネラル	17,800	2,430.00	43,254,000	貸付株式数	7,300株
ソ　ニ　ー※	410,400	7,413.00	3,042,295,200	貸付株式数	120,000株 (120,000株)
Ｔ　Ｄ　Ｋ	31,300	12,340.00	386,242,000		

帝国通信工業	2,800	1,220.00	3,416,000	貸付株式数	400株
タムラ製作所	21,800	675.00	14,715,000	貸付株式数	2,800株
アルプスアルパイン	57,500	2,537.00	145,877,500		
池上通信機	2,000	1,089.00	2,178,000	貸付株式数	900株
日本電波工業	6,000	537.00	3,222,000	貸付株式数	2,300株
鈴木	3,400	816.00	2,774,400	貸付株式数	1,400株
日本トリム	900	4,650.00	4,185,000		
ローランド　ディー. ジー.	3,500	2,248.00	7,868,000	貸付株式数	1,400株
フオスター電機	6,800	2,056.00	13,980,800		
Ｓ　Ｍ　Ｋ	1,700	2,997.00	5,094,900	貸付株式数	600株
ヨコオ	4,200	3,315.00	13,923,000	貸付株式数	600株
ティアック	4,900	221.00	1,082,900		
ホシデン	17,700	1,405.00	24,868,500		
ヒロセ電機	10,100	13,840.00	139,784,000		
日本航空電子	14,900	2,280.00	33,972,000		
Ｔ　Ｏ　Ａ	6,900	1,138.00	7,852,200		
マクセルホールディングス	14,100	1,515.00	21,361,500		
古野電気	8,400	1,365.00	11,466,000		
ユニデンホールディングス	1,800	1,907.00	3,432,600		
スミダコーポレーション	5,100	1,306.00	6,660,600	貸付株式数	2,000株 (1,700株)
アイコム	3,600	2,760.00	9,936,000		
リオン	2,800	3,045.00	8,526,000	貸付株式数	400株
本多通信工業	5,700	551.00	3,140,700	貸付株式数	2,200株
船井電機	6,800	696.00	4,732,800	貸付株式数	2,600株 (1,700株)
横河電機	59,500	1,918.00	114,121,000		
新電元工業	2,300	3,890.00	8,947,000		
アズビル	41,000	3,195.00	130,995,000	貸付株式数	1,000株
東亜ディーケーケー	3,200	1,078.00	3,449,600	貸付株式数	1,200株
日本光電工業	26,800	2,888.00	77,398,400		
チ　ノ　ー	2,200	1,441.00	3,170,200		
共和電業	6,500	453.00	2,944,500		
日本電子材料	2,600	874.00	2,272,400		
堀場製作所	12,900	7,630.00	98,427,000		
アドバンテスト	48,300	5,830.00	281,589,000		
小野測器	2,300	553.00	1,271,900		
エスペック	5,800	2,232.00	12,945,600		
キーエンス	58,800	39,470.00	2,320,836,000		

日置電機	3,400	3,960.00	13,464,000	貸付株式数	200株
シスメックス	46,400	7,522.00	349,020,800		
日本マイクロニクス	11,400	1,159.00	13,212,600		
メガチップス	6,100	1,927.00	11,754,700	貸付株式数	2,400株 (2,100株)
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,400	3,715.00	12,631,000		
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	5,500	602.00	3,311,000	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
澤藤電機	800	2,184.00	1,747,200		
デンソー	142,900	5,143.00	734,934,700		
原田工業	3,200	1,042.00	3,334,400	貸付株式数	1,200株
コーセル	7,900	1,256.00	9,922,400	貸付株式数	3,200株
イリソ電子工業	5,500	5,120.00	28,160,000	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	10,700	1,578.00	16,884,600	貸付株式数	1,800株
千代田インテグレ	3,000	2,455.00	7,365,000		
アイ・オー・データ	2,400	1,068.00	2,563,200		
レーザーテック	13,300	10,100.00	134,330,000		
スタンレー電気	45,800	3,195.00	146,331,000		
岩崎電気	2,500	1,526.00	3,815,000		
ウシオ電機	37,700	1,644.00	61,978,800		
岡谷電機	5,200	400.00	2,080,000	貸付株式数	1,300株
ヘリオステクノＨ	6,000	478.00	2,868,000	貸付株式数	1,300株
エノモト	2,000	1,199.00	2,398,000		
日本セラミック	6,600	2,844.00	18,770,400		
遠藤照明	3,100	723.00	2,241,300		
古河電池	4,600	827.00	3,804,200		
双信電機	3,200	504.00	1,612,800	貸付株式数	700株
山一電機	4,800	1,677.00	8,049,600	貸付株式数	100株
図　研	4,300	2,537.00	10,909,100		
日本電子	12,800	3,250.00	41,600,000		
カ　シ　オ	57,700	2,168.00	125,093,600	貸付株式数	4,900株
ファナック	61,700	21,150.00	1,304,955,000		
日本シイエムケイ	15,300	660.00	10,098,000	貸付株式数	2,800株
エンプラス	3,300	3,605.00	11,896,500		
大真空	2,400	1,770.00	4,248,000	貸付株式数	900株
ロ　ー　ム	28,800	8,800.00	253,440,000		
浜松ホトニクス	46,500	4,515.00	209,947,500		
三井ハイテック	7,200	1,556.00	11,203,200	貸付株式数	200株 (200株)

新光電気工業	21,800	1,259.00	27,446,200	貸付株式数	8,800株 (8,800株)
京　セ　ラ	91,300	7,459.00	681,006,700		
協栄産業	700	1,608.00	1,125,600		
太陽誘電	28,900	3,175.00	91,757,500	貸付株式数	11,600株
村田製作所	190,700	6,590.00	1,256,713,000		
双葉電子工業	10,300	1,402.00	14,440,600		
日東電工	44,800	6,290.00	281,792,000		
北陸電気工業	2,700	1,156.00	3,121,200		
東海理化電機	17,000	2,232.00	37,944,000		
ニチコン	22,200	1,140.00	25,308,000		
日本ケミコン	5,000	2,118.00	10,590,000		
Ｋ　Ｏ　Ａ	9,800	1,414.00	13,857,200		
三井Ｅ＆ＳＨＤ	21,700	971.00	21,070,700		
日立造船	51,700	431.00	22,282,700		
三菱重工業	108,800	4,241.00	461,420,800	貸付株式数	34,300株
川崎重工業	50,500	2,508.00	126,654,000		
ＩＨＩ	46,800	2,517.00	117,795,600		
名村造船所	21,300	266.00	5,665,800	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		
スプリックス	2,100	1,146.00	2,406,600	貸付株式数	800株
日本車輌	2,400	3,090.00	7,416,000	貸付株式数	800株
三菱ロジスネクスト	8,700	1,340.00	11,658,000	貸付株式数	3,800株
近畿車輌	1,000	1,547.00	1,547,000	貸付株式数	300株
ＦＰＧ	20,100	1,038.00	20,863,800		
島根銀行	1,300	660.00	858,000		
じもとホールディングス	45,000	110.00	4,950,000		
全国保証	18,000	4,740.00	85,320,000	貸付株式数	7,300株
めぶきフィナンシャルＧ	331,900	283.00	93,927,700		
東京きらぼしＦＧ	8,700	1,566.00	13,624,200		
九州フィナンシャルＧ	105,200	486.00	51,127,200	貸付株式数	100株
かんぽ生命保険	22,800	1,939.00	44,209,200		
ゆうちょ銀行	181,000	1,071.00	193,851,000	貸付株式数	72,400株
富山第一銀行	15,300	351.00	5,370,300		
コンコルディア・フィナンシャル	376,500	459.00	172,813,500		
ジェイリース	1,800	323.00	581,400	貸付株式数	700株
西日本フィナンシャルＨＤ	43,700	871.00	38,062,700		
マーキュリアインベストメント	2,800	760.00	2,128,000	貸付株式数	1,100株

イントラスト	2,300	719.00	1,653,700	貸付株式数	800株
日本モーゲージサービス	1,300	1,551.00	2,016,300		
Ｃａｓａ	2,200	1,303.00	2,866,600		
アルヒ	10,200	2,340.00	23,868,000	貸付株式数	4,000株
プレミアグループ	3,500	2,289.00	8,011,500	貸付株式数	1,300株
日産自動車	765,700	678.60	519,604,020		
いすゞ自動車	188,200	1,385.00	260,657,000		
トヨタ自動車 ※	723,500	7,778.00	5,627,383,000		
日野自動車	81,100	1,170.00	94,887,000		
三菱自動車工業	240,600	480.00	115,488,000	貸付株式数	83,400株
エフテック	4,600	777.00	3,574,200		
レシップホールディングス	2,600	668.00	1,736,800		
ＧＭＢ	1,200	810.00	972,000		
ファルテック	1,200	1,279.00	1,534,800	貸付株式数	400株
武蔵精密工業	14,500	1,486.00	21,547,000	貸付株式数	200株
日産車体	12,800	1,045.00	13,376,000	貸付株式数	3,100株
新明和工業	17,500	1,496.00	26,180,000		
極東開発工業	12,000	1,639.00	19,668,000		
日信工業	13,300	2,218.00	29,499,400		
トピー工業	5,400	2,056.00	11,102,400		
ティラド	2,400	2,062.00	4,948,800		
タチエス	10,700	1,488.00	15,921,600		
Ｎ　Ｏ　Ｋ	34,800	1,730.00	60,204,000		
フタバ産業	18,200	786.00	14,305,200		
ＫＹＢ	7,300	3,305.00	24,126,500	貸付株式数	100株
市光工業	9,700	826.00	8,012,200		
大同メタル工業	12,500	790.00	9,875,000		
プレス工業	32,000	450.00	14,400,000		
ミクニ	8,100	352.00	2,851,200		
太平洋工業	13,700	1,499.00	20,536,300		
ケーヒン	15,000	2,562.00	38,430,000		
河西工業	8,700	908.00	7,899,600		
アイシン精機	53,500	4,160.00	222,560,000		
マ　ツ　ダ	191,000	959.00	183,169,000		
今仙電機製作所	5,900	1,007.00	5,941,300		
本田技研	511,200	3,180.00	1,625,616,000		
スズキ	128,700	4,619.00	594,465,300		
ＳＵＢＡＲＵ	201,600	2,784.00	561,254,400		
安永	3,200	1,292.00	4,134,400	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	84,700	2,292.00	194,132,400		

ショーワ	15,400	2,264.00	34,865,600		
小糸製作所	38,900	5,510.00	214,339,000		
ＴＢＫ	7,600	471.00	3,579,600		
エクセディ	8,800	2,510.00	22,088,000		
ミツバ	12,100	793.00	9,595,300		
豊田合成	21,000	2,767.00	58,107,000		
愛三工業	10,200	832.00	8,486,400		
盟和産業	1,000	1,162.00	1,162,000	貸付株式数	300株
日本プラスト	4,900	749.00	3,670,100	貸付株式数	2,000株
ヨ　ロ　ズ	6,200	1,451.00	8,996,200		
エフ・シー・シー	10,600	2,406.00	25,503,600		
新家工業	1,400	1,483.00	2,076,200		
シマノ	24,300	17,590.00	427,437,000	貸付株式数	9,600株
テイ・エス　テック	15,100	3,465.00	52,321,500		
関西みらいＦＧ	37,500	715.00	26,812,500		
３３ＦＧ	6,000	1,758.00	10,548,000		
第四北越フィナンシャルＧ	11,100	3,100.00	34,410,000	貸付株式数	100株
ジャムコ	3,300	1,458.00	4,811,400		
小　野　建	5,600	1,402.00	7,851,200		
はるやまＨＬＤＧＳ	2,800	867.00	2,427,600		
南　陽	1,400	1,956.00	2,738,400		
ノ　ジ　マ	11,300	2,293.00	25,910,900	貸付株式数	200株
佐鳥電機	4,700	927.00	4,356,900	貸付株式数	1,700株
カッパ・クリエイト	9,000	1,504.00	13,536,000	貸付株式数	600株
エコートレーディング	1,600	561.00	897,600		
伯東	3,900	1,360.00	5,304,000		
コンドーテック	5,000	1,138.00	5,690,000		
中山福	3,800	540.00	2,052,000	貸付株式数	300株
ライトオン	4,900	613.00	3,003,700	貸付株式数	1,900株 (1,400株)
ナガイレーベン	9,300	2,599.00	24,170,700		
ジーンズメイト	2,000	310.00	620,000	貸付株式数	700株
三菱食品	7,000	3,100.00	21,700,000		
良品計画	84,900	2,530.00	214,797,000	貸付株式数	32,900株
三城ホールディングス	6,900	307.00	2,118,300	貸付株式数	2,700株
松田産業	4,700	1,631.00	7,665,700		
第一興商	9,500	5,460.00	51,870,000		
メディパルＨＤ	69,000	2,373.00	163,737,000		
アドヴァン	9,800	1,321.00	12,945,800		
ＳＰＫ	1,400	2,925.00	4,095,000		

萩原電気ＨＬＤＧＳ	2,300	2,911.00	6,695,300	貸付株式数	800株
アルビス	2,400	2,280.00	5,472,000		
アズワン	4,200	10,000.00	42,000,000	貸付株式数	200株
スズデン	2,200	1,512.00	3,326,400	貸付株式数	800株
尾家産業	1,900	1,492.00	2,834,800	貸付株式数	800株
シモジマ	4,000	1,258.00	5,032,000	貸付株式数	400株
ドウシシャ	6,100	1,820.00	11,102,000		
小津産業	1,400	1,788.00	2,503,200	貸付株式数	500株
コナカ	7,700	420.00	3,234,000		
高速	3,800	1,245.00	4,731,000		
ハウス　ローゼ	700	1,667.00	1,166,900	貸付株式数	100株
Ｇ－７ホールディングス	1,900	4,700.00	8,930,000		
たけびし	2,100	1,467.00	3,080,700	貸付株式数	900株
イオン北海道	6,000	795.00	4,770,000	貸付株式数	2,400株
コ　ジ　マ	11,000	528.00	5,808,000		
ヒマラヤ	2,100	847.00	1,778,700	貸付株式数	900株
コーナン商事	9,000	2,593.00	23,337,000	貸付株式数	3,300株
ネットワンシステムズ	24,300	2,676.00	65,026,800		
エコス	2,300	1,732.00	3,983,600		
ワタミ	7,600	1,301.00	9,887,600	貸付株式数	2,000株
マルシェ	1,600	781.00	1,249,600	貸付株式数	600株
リックス	1,400	1,755.00	2,457,000	貸付株式数	300株
システムソフト	15,400	108.00	1,663,200		
パンパシフィックＨＤ	153,300	1,847.00	283,145,100		
丸文	5,600	622.00	3,483,200		
西松屋チェーン	14,000	952.00	13,328,000		
ゼンショーホールディングス	30,700	2,440.00	74,908,000		
ハピネット	5,300	1,394.00	7,388,200	貸付株式数	2,100株
幸楽苑ホールディングス	4,100	2,041.00	8,368,100	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,200	1,056.00	1,267,200	貸付株式数	500株
橋本総業ＨＬＤＧＳ	1,300	1,969.00	2,559,700	貸付株式数	200株
日本ライフライン	19,000	1,524.00	28,956,000	貸付株式数	6,300株
サイゼリヤ	10,600	2,634.00	27,920,400		
タカショー	3,200	502.00	1,606,400		
エクセル	1,900	1,585.00	3,011,500	貸付株式数	900株
ＶＴホールディングス	26,600	485.00	12,901,000		
マルカ	2,300	2,389.00	5,494,700	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,400	3,355.00	18,117,000		

魚力	1,700	1,571.00	2,670,700		
ＩＤＯＭ	17,500	625.00	10,937,500	貸付株式数	6,900株 (2,100株)
日本エム・ディ・エム	3,800	2,205.00	8,379,000	貸付株式数	1,500株
ポプラ	1,800	533.00	959,400	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	1,700	2,411.00	4,098,700		
ユナイテッドアローズ	6,700	3,255.00	21,808,500		
進和	3,700	2,398.00	8,872,600	貸付株式数	1,300株
エスケイジャパン	1,400	436.00	610,400		
ダイトロン	2,700	1,945.00	5,251,500		
ハイデイ日高	9,200	2,205.00	20,286,000	貸付株式数	2,600株
シークス	8,100	1,641.00	13,292,100	貸付株式数	3,100株
京都きもの友禅	4,200	349.00	1,465,800	貸付株式数	1,600株
コロワイド	21,300	2,200.00	46,860,000	貸付株式数	7,600株
ピーシーデポコーポ	8,600	551.00	4,738,600	貸付株式数	3,400株
田中商事	2,100	708.00	1,486,800		
オーハシテクニカ	3,700	1,498.00	5,542,600		
壱番屋	4,500	5,540.00	24,930,000	貸付株式数	1,400株
白銅	2,200	1,544.00	3,396,800		
トップカルチャー	2,400	340.00	816,000	貸付株式数	900株 (600株)
ＰＬＡＮＴ	1,700	652.00	1,108,400	貸付株式数	500株
スギホールディングス	12,800	6,120.00	78,336,000	貸付株式数	5,500株
薬王堂ホールディングス	2,800	2,537.00	7,103,600		
島津製作所	77,600	3,410.00	264,616,000		
Ｊ　Ｍ　Ｓ	5,600	833.00	4,664,800		
クボテック	1,700	415.00	705,500	貸付株式数	600株 (100株)
長野計器	4,600	934.00	4,296,400		
ブイ・テクノロジー	3,000	5,790.00	17,370,000	貸付株式数	1,100株
スター精密	10,100	1,578.00	15,937,800		
東京計器	4,100	1,041.00	4,268,100		
愛知時計	800	4,455.00	3,564,000		
インターアクション	3,500	2,874.00	10,059,000	貸付株式数	1,300株
オーバル	5,800	255.00	1,479,000	貸付株式数	500株
東京精密	11,800	4,170.00	49,206,000		
マニー	25,900	3,035.00	78,606,500	貸付株式数	10,400株
ニコン	105,000	1,454.00	152,670,000	貸付株式数	40,700株
トプコン	32,700	1,444.00	47,218,800		
オリンパス	359,300	1,703.00	611,887,900		

理研計器	5,700	2,368.00	13,497,600		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	11,300	7,670.00	86,671,000	貸付株式数	100株
キヤノン電子	6,800	2,145.00	14,586,000		
タムロン	5,200	2,645.00	13,754,000		
ＨＯＹＡ	130,700	10,280.00	1,343,596,000		
シ　ー　ド	2,800	1,118.00	3,130,400	貸付株式数	1,100株
ノーリツ鋼機	4,400	1,620.00	7,128,000	貸付株式数	1,700株
エー・アンド・デイ	5,900	1,085.00	6,401,500		
朝日インテック	55,100	3,185.00	175,493,500	貸付株式数	22,100株
キヤノン	349,600	3,114.00	1,088,654,400	貸付株式数	141,500株
リ　コ　ー	165,700	1,182.00	195,857,400		
シチズン時計	76,300	616.00	47,000,800		
リズム時計	2,100	938.00	1,969,800		
大研医器	4,600	640.00	2,944,000		
メニコン	9,000	4,400.00	39,600,000		
シンシア	800	629.00	503,200	貸付株式数	200株
中本パックス	1,500	1,558.00	2,337,000	貸付株式数	100株
スノーピーク	3,000	1,090.00	3,270,000	貸付株式数	1,200株
パラマウントベッドＨＤ	6,800	4,620.00	31,416,000		
トランザクション	4,200	988.00	4,149,600		
ＳＨＯ‐ＢＩ	2,000	398.00	796,000	貸付株式数	300株
ニホンフラッシュ	3,100	2,922.00	9,058,200	貸付株式数	1,200株 (800株)
前田工繊	7,200	2,112.00	15,206,400	貸付株式数	2,800株
永大産業	8,700	356.00	3,097,200		
アートネイチャー	6,900	840.00	5,796,000		
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	67,100	6,560.00	440,176,000		
アイフィスジャパン	1,700	797.00	1,354,900	貸付株式数	100株
共立印刷	11,600	170.00	1,972,000		
ＳＨＯＥＩ	3,100	5,300.00	16,430,000	貸付株式数	600株
フランスベッドＨＬＤＧＳ	9,200	976.00	8,979,200		
マーベラス	9,600	741.00	7,113,600	貸付株式数	3,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	11,300	4,620.00	52,206,000		
萩原工業	3,600	1,729.00	6,224,400	貸付株式数	300株 (300株)
エイベックス	10,900	1,262.00	13,755,800		
トッパン・フォームズ	14,000	1,245.00	17,430,000		

フジシールインターナショナル	14,600	2,501.00	36,514,600	貸付株式数	1,800株
タカラトミー	29,200	1,330.00	38,836,000		
廣済堂	4,600	809.00	3,721,400		
エステールホールディングス	1,800	690.00	1,242,000		
アーク	24,400	99.00	2,415,600		
レック	7,000	1,360.00	9,520,000	貸付株式数	2,600株
タカノ	2,500	834.00	2,085,000		
三光合成	7,500	444.00	3,330,000		
プロネクサス	5,500	1,232.00	6,776,000		
ホクシン	4,200	167.00	701,400		
ウッドワン	2,300	1,239.00	2,849,700		
大建工業	4,400	1,983.00	8,725,200		
き　も　と	11,500	182.00	2,093,000		
凸版印刷	91,600	2,279.00	208,756,400		
大日本印刷	84,900	3,040.00	258,096,000		
共同印刷	2,000	3,015.00	6,030,000		
ＮＩＳＳＨＡ	13,400	1,169.00	15,664,600		
光村印刷	600	1,803.00	1,081,800	貸付株式数	200株
藤森工業	5,800	3,560.00	20,648,000		
ヴィア・ホールディングス	8,100	679.00	5,499,900		
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,000	1,753.00	5,259,000		
前澤化成工業	4,100	1,204.00	4,936,400		
未来工業	3,500	2,201.00	7,703,500		
アシックス	53,700	1,858.00	99,774,600	貸付株式数	22,800株
ツ　ツ　ミ	2,100	2,147.00	4,508,700		
ウェーブロックＨＬＤＧＳ	2,300	847.00	1,948,100		
ジェイ　エス　ピー	3,800	1,951.00	7,413,800		
ニ　チ　ハ	9,000	2,771.00	24,939,000		
エフピコ	7,100	6,660.00	47,286,000	貸付株式数	400株 (400株)
小松ウオール工業	2,000	2,358.00	4,716,000		
ヤマハ	38,700	6,170.00	238,779,000		
河合楽器	2,000	3,925.00	7,850,000		
クリナップ	6,200	746.00	4,625,200		
ピジョン	39,300	4,140.00	162,702,000	貸付株式数	15,800株
天馬	4,300	2,022.00	8,694,600		
兼松サステック	400	1,796.00	718,400	貸付株式数	100株

キングジム	5,600	889.00	4,978,400		
象印マホービン	19,200	1,871.00	35,923,200	貸付株式数	7,700株
リンテック	15,400	2,496.00	38,438,400		
信越ポリマー	11,700	1,040.00	12,168,000		
東　リ	16,200	335.00	5,427,000		
イトーキ	13,900	592.00	8,228,800		
任　天　堂	39,800	44,500.00	1,771,100,000		
三菱鉛筆	10,600	1,706.00	18,083,600		
松　風	2,900	1,707.00	4,950,300	貸付株式数	1,100株
タカラスタンダード	13,300	2,001.00	26,613,300	貸付株式数	4,700株
コ　ク　ヨ	31,100	1,690.00	52,559,000		
ナカバヤシ	6,200	622.00	3,856,400		
ニ　フ　コ	23,800	3,045.00	72,471,000	貸付株式数	6,000株
立川ブラインド	2,900	1,416.00	4,106,400	貸付株式数	1,100株
グローブライド	2,900	2,641.00	7,658,900		
オカムラ	22,700	1,072.00	24,334,400		
バルカー	5,300	2,631.00	13,944,300	貸付株式数	800株
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,000	1,726.00	1,726,000		
伊　藤　忠	447,200	2,536.50	1,134,322,800		
丸　紅	665,500	825.00	549,037,500		
スクロール	9,800	359.00	3,518,200		
高　島	900	1,833.00	1,649,700		
ヨンドシーホールディングス	6,500	2,711.00	17,621,500	貸付株式数	2,700株
三陽商会	3,300	1,392.00	4,593,600		
長瀬産業	35,900	1,668.00	59,881,200		
ナイガイ	2,500	471.00	1,177,500	貸付株式数	900株
蝶　理	4,100	2,241.00	9,188,100		
豊田通商	71,400	4,005.00	285,957,000		
オンワードホールディングス	38,300	661.00	25,316,300		
三共生興	9,800	598.00	5,860,400		
兼　松	23,800	1,475.00	35,105,000		
美　津　濃	5,900	2,804.00	16,543,600		
ツカモトコーポレーション	1,200	1,095.00	1,314,000	貸付株式数	100株
ファミリーマート	51,100	2,719.00	138,940,900		
ルックホールディングス	2,200	1,211.00	2,664,200	貸付株式数	800株
三井物産	562,000	1,983.50	1,114,727,000		
日本紙パルプ	3,600	4,305.00	15,498,000		

東京エレクトロン	43,300	24,410.00	1,056,953,000		
日立ハイテクノロジーズ	22,200	7,580.00	168,276,000		
カメイ	8,300	1,379.00	11,445,700		
東都水産	800	2,682.00	2,145,600		
ＯＵＧホールディングス	1,000	2,640.00	2,640,000	貸付株式数	300株
スターゼン	2,400	4,330.00	10,392,000	貸付株式数	900株
セイコーＨＤ	9,200	2,894.00	26,624,800	貸付株式数	3,800株
山　善	24,900	1,092.00	27,190,800		
椿本興業	1,200	4,090.00	4,908,000		
住友商事	403,400	1,670.00	673,678,000		
日本ユニシス	20,000	3,515.00	70,300,000		
内田洋行	2,800	7,260.00	20,328,000	貸付株式数	1,100株
三菱商事	448,700	2,935.00	1,316,934,500		
第一実業	3,100	3,810.00	11,811,000		
キヤノンマーケティングＪＰＮ	18,400	2,591.00	47,674,400		
西華産業	3,600	1,391.00	5,007,600		
佐藤商事	5,200	992.00	5,158,400		
菱洋エレクトロ	6,400	2,033.00	13,011,200	貸付株式数	2,400株
東京産業	5,700	615.00	3,505,500		
ユアサ商事	6,000	3,735.00	22,410,000		
神鋼商事	1,600	2,796.00	4,473,600		
小林産業	3,900	298.00	1,162,200	貸付株式数	1,500株
阪和興業	12,000	2,901.00	34,812,000		
正栄食品	4,200	3,820.00	16,044,000	貸付株式数	1,600株
カナデン	5,200	1,353.00	7,035,600		
菱電商事	4,600	1,641.00	7,548,600		
ニプロ	44,900	1,320.00	59,268,000	貸付株式数	16,700株
フルサト工業	3,500	1,699.00	5,946,500		
岩谷産業	14,200	3,730.00	52,966,000	貸付株式数	5,700株
すてきナイスグループ	2,500	1,272.00	3,180,000	貸付株式数	600株
昭光通商	2,300	719.00	1,653,700	貸付株式数	200株
ニチモウ	1,000	2,008.00	2,008,000	貸付株式数	300株
極東貿易	1,900	2,250.00	4,275,000		
イ　ワ　キ	8,500	480.00	4,080,000		
兼松エレクトロニクス	3,500	3,560.00	12,460,000		
三愛石油	15,700	1,186.00	18,620,200		
稲畑産業	14,100	1,632.00	23,011,200		
ＧＳＩクレオス	1,600	1,289.00	2,062,400	貸付株式数	300株
明和産業	6,100	630.00	3,843,000		

クワザワ	2,400	616.00	1,478,400		
ゴールドウイン	11,500	8,000.00	92,000,000	貸付株式数	4,400株 (2,800株)
ユニ・チャーム	125,200	3,727.00	466,620,400	貸付株式数	51,200株
デサント	12,500	2,047.00	25,587,500		
キ　ン　グ	3,100	528.00	1,636,800	貸付株式数	100株
ワ　キ　タ	13,600	1,131.00	15,381,600	貸付株式数	1,900株
ヤマトインターナシヨナル	3,700	404.00	1,494,800	貸付株式数	100株
東邦ホールディングス	20,500	2,411.00	49,425,500	貸付株式数	1,900株
サンゲツ	17,500	2,144.00	37,520,000		
ミツウロコグループ	9,500	1,431.00	13,594,500	貸付株式数	3,800株
シナネンホールディングス	2,700	1,939.00	5,235,300		
伊藤忠エネクス	13,900	928.00	12,899,200		
サンリオ	18,000	2,187.00	39,366,000	貸付株式数	7,200株
サンワ　テクノス	4,600	1,177.00	5,414,200		
リョーサン	7,000	2,875.00	20,125,000		
新光商事	9,900	884.00	8,751,600		
トーホー	3,000	1,949.00	5,847,000	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
三信電気	3,500	1,745.00	6,107,500		
東陽テクニカ	7,300	1,228.00	8,964,400		
モスフード　サービス	8,400	3,050.00	25,620,000	貸付株式数	3,300株 (100株)
加賀電子	6,400	2,624.00	16,793,600		
三益半導体	5,600	2,159.00	12,090,400	貸付株式数	2,300株
ソーダニツカ	6,700	630.00	4,221,000		
立花エレテック	4,700	1,825.00	8,577,500		
木曽路	8,300	2,975.00	24,692,500	貸付株式数	3,300株
ＳＲＳホールディングス	7,500	1,041.00	7,807,500	貸付株式数	3,000株
千　趣　会	11,800	505.00	5,959,000	貸付株式数	4,600株
タカキユー	5,000	189.00	945,000	貸付株式数	1,800株 (1,600株)
ケーヨー	13,100	563.00	7,375,300	貸付株式数	5,200株
上新電機	7,500	2,662.00	19,965,000		
日本瓦斯	10,100	3,600.00	36,360,000		
ロイヤルホールディングス	11,100	2,514.00	27,905,400	貸付株式数	900株
東　天　紅	500	1,267.00	633,500		
いなげや	7,900	1,500.00	11,850,000		
島　忠	12,000	3,035.00	36,420,000		
チヨダ	6,700	1,608.00	10,773,600		

ライフコーポレーション	4,900	2,610.00	12,789,000		
リンガーハット	7,900	2,527.00	19,963,300	貸付株式数	3,100株 (1,700株)
ＭｒＭａｘＨＤ	8,600	502.00	4,317,200	貸付株式数	3,400株
テンアライド	5,900	444.00	2,619,600	貸付株式数	2,300株
ＡＯＫＩホールディングス	12,600	1,138.00	14,338,800	貸付株式数	400株
オークワ	10,100	1,425.00	14,392,500	貸付株式数	900株
コメリ	9,800	2,394.00	23,461,200		
青山商事	13,000	1,571.00	20,423,000		
しまむら	7,400	9,320.00	68,968,000		
はせがわ	3,400	402.00	1,366,800	貸付株式数	100株
高　島　屋	46,600	1,284.00	59,834,400		
松　屋	12,900	890.00	11,481,000	貸付株式数	2,500株
エイチ・ツー・オーリテイリング	30,300	1,305.00	39,541,500		
近鉄百貨店	2,400	3,845.00	9,228,000	貸付株式数	900株
パ　ル　コ	6,200	1,363.00	8,450,600		
丸井グループ	58,700	2,662.00	156,259,400	貸付株式数	12,400株
クレディセゾン	44,900	1,886.00	84,681,400	貸付株式数	2,400株
アクシアル　リテイリング	5,300	4,020.00	21,306,000		
井　筒　屋	3,700	252.00	932,400		
イオン	246,100	2,291.50	563,938,150	貸付株式数	70,900株
イ　ズ　ミ	13,000	4,055.00	52,715,000		
フオーバル	2,900	1,030.00	2,987,000		
平　和　堂	12,900	2,111.00	27,231,900		
フ　ジ	7,600	1,988.00	15,108,800		
ヤオコー	7,200	5,470.00	39,384,000	貸付株式数	400株
ゼビオホールディングス	7,700	1,350.00	10,395,000		
ケーズホールディングス	61,700	1,433.00	88,416,100		
ＰＡＬＴＡＣ	10,200	5,570.00	56,814,000		
三谷産業	8,400	347.00	2,914,800		
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,300	650.00	2,145,000		
日産東京販売ＨＤ	9,500	291.00	2,764,500		
新生銀行	47,100	1,686.00	79,410,600		
あおぞら銀行	38,200	2,909.00	111,123,800		
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ ※	4,408,400	599.20	2,641,513,280		
りそなホールディングス	702,900	491.00	345,123,900		
三井住友トラストＨＤ	121,100	4,359.00	527,874,900		
三井住友フィナンシャルＧ	442,800	4,114.00	1,821,679,200		

千葉銀行	220,200	642.00	141,368,400		
群馬銀行	125,700	392.00	49,274,400		
武蔵野銀行	9,500	1,945.00	18,477,500		
千葉興業銀行	17,800	381.00	6,781,800	貸付株式数	2,000株
筑波銀行	27,400	246.00	6,740,400		
七十七銀行	21,600	1,851.00	39,981,600		
青森銀行	5,000	2,941.00	14,705,000	貸付株式数	1,500株
秋田銀行	4,100	2,281.00	9,352,100		
山形銀行	7,200	1,660.00	11,952,000		
岩手銀行	4,200	3,000.00	12,600,000		
東邦銀行	57,000	281.00	16,017,000	貸付株式数	19,800株
東北銀行	3,100	1,059.00	3,282,900		
みちのく銀行	4,200	1,531.00	6,430,200	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ふくおかフィナンシャルG	54,000	2,146.00	115,884,000	貸付株式数	5,000株
静岡銀行	158,400	838.00	132,739,200		
十六銀行	8,100	2,646.00	21,432,600		
スルガ銀行	63,000	528.00	33,264,000	貸付株式数	15,200株 (7,000株)
八十二銀行	154,800	497.00	76,935,600	貸付株式数	15,000株
山梨中央銀行	7,500	1,216.00	9,120,000		
大垣共立銀行	12,600	2,448.00	30,844,800		
福井銀行	5,600	1,914.00	10,718,400		
北國銀行	6,700	3,745.00	25,091,500		
清水銀行	2,700	2,206.00	5,956,200		
富山銀行	1,300	2,451.00	3,186,300		
滋賀銀行	12,800	2,770.00	35,456,000	貸付株式数	5,100株
南都銀行	10,700	2,773.00	29,671,100		
百五銀行	57,900	360.00	20,844,000		
京都銀行	22,900	4,790.00	109,691,000	貸付株式数	9,100株
紀陽銀行	22,600	1,675.00	37,855,000	貸付株式数	2,100株
ほくほくフィナンシャルG	42,600	1,159.00	49,373,400		
広島銀行	94,500	548.00	51,786,000		
山陰合同銀行	38,200	674.00	25,746,800		
中国銀行	55,200	1,124.00	62,044,800	貸付株式数	22,300株
鳥取銀行	2,200	1,370.00	3,014,000		
伊予銀行	91,200	621.00	56,635,200	貸付株式数	2,100株
百十四銀行	6,800	2,182.00	14,837,600		
四国銀行	9,800	1,069.00	10,476,200		
阿波銀行	10,400	2,606.00	27,102,400	貸付株式数	3,700株

大分銀行	3,700	2,822.00	10,441,400		
宮崎銀行	4,300	2,750.00	11,825,000		
佐賀銀行	3,900	1,824.00	7,113,600		
沖縄銀行	5,800	3,745.00	21,721,000		
琉球銀行	14,800	1,230.00	18,204,000		
セブン銀行	214,100	358.00	76,647,800		
みずほフィナンシャルG	8,699,500	170.70	1,485,004,650		
高知銀行	2,500	940.00	2,350,000		
山口フィナンシャルG	79,800	772.00	61,605,600	貸付株式数	30,200株
芙蓉総合リース	6,700	7,350.00	49,245,000		
みずほリース	9,900	3,465.00	34,303,500		
東京センチュリー	12,900	5,850.00	75,465,000	貸付株式数	4,400株
ＳＢＩホールディングス	71,600	2,322.00	166,255,200	貸付株式数	30,300株
日本証券金融	28,200	540.00	15,228,000		
アイフル	98,200	241.00	23,666,200		
日本アジア投資	5,600	302.00	1,691,200	貸付株式数	2,100株
長野銀行	2,100	1,675.00	3,517,500		
名古屋銀行	5,200	3,420.00	17,784,000		
北洋銀行	96,700	251.00	24,271,700		
愛知銀行	2,300	3,800.00	8,740,000		
中京銀行	2,600	2,234.00	5,808,400	貸付株式数	200株
大光銀行	2,200	1,734.00	3,814,800		
愛媛銀行	9,000	1,203.00	10,827,000	貸付株式数	2,900株
トマト銀行	2,500	1,088.00	2,720,000		
京葉銀行	26,900	638.00	17,162,200	貸付株式数	4,500株
栃木銀行	31,200	240.00	7,488,000		
北日本銀行	2,100	2,162.00	4,540,200	貸付株式数	400株
東和銀行	11,300	908.00	10,260,400	貸付株式数	1,100株
福島銀行	6,200	270.00	1,674,000		
大東銀行	3,200	643.00	2,057,600	貸付株式数	300株
リコーリース	5,000	4,075.00	20,375,000		
イオンフィナンシャルサービス	39,200	1,718.00	67,345,600	貸付株式数	900株
ア　コ　ム	133,000	487.00	64,771,000		
ジャックス	7,100	2,733.00	19,404,300		
オ　リ　コ	173,900	162.00	28,171,800		
日立キャピタル	15,100	2,838.00	42,853,800		
アプラスフィナンシャル	32,500	90.00	2,925,000		
オリックス	400,400	1,834.00	734,333,600		
三菱ＵＦＪリース	162,300	715.00	116,044,500	貸付株式数	8,500株

ジャフコ	9,800	4,325.00	42,385,000		
九州　リースサービス	3,000	600.00	1,800,000	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	49,400	433.00	21,390,200		
大和証券Ｇ本社	513,800	564.20	289,885,960		
野村ホールディングス	1,127,000	577.10	650,391,700		
岡三証券グループ	54,400	401.00	21,814,400		
丸三証券	18,900	524.00	9,903,600	貸付株式数	7,700株
東洋証券	23,600	154.00	3,634,400	貸付株式数	9,200株
東海東京ＨＤ	73,900	330.00	24,387,000	貸付株式数	16,800株
光世証券	1,600	667.00	1,067,200	貸付株式数	400株
水戸証券	19,100	227.00	4,335,700	貸付株式数	5,400株
いちよし証券	11,700	659.00	7,710,300		
松井証券	36,400	886.00	32,250,400	貸付株式数	14,500株
ＳＯＭＰＯホールディングス	120,400	4,414.00	531,445,600		
だいこう証券ビジ	3,200	701.00	2,243,200		
日本取引所グループ	183,700	1,963.00	360,603,100		
マネックスＧ	48,500	276.00	13,386,000	貸付株式数	19,500株
極東証券	8,700	762.00	6,629,400	貸付株式数	200株
岩井コスモホールディング	5,800	1,289.00	7,476,200	貸付株式数	1,200株
藍澤證券	11,500	746.00	8,579,000		
フィデアホール	63,100	137.00	8,644,700		
池田泉州ＨＤ	75,000	219.00	16,425,000		
アニコム　ホールディングス	5,300	3,630.00	19,239,000	貸付株式数	2,100株
ＭＳ＆ＡＤ	167,400	3,708.00	620,719,200		
ＳＯＮＹ　ＦＨ	52,700	2,711.00	142,869,700		
マネーパートナーズＧＰ	6,600	240.00	1,584,000		
スパークス・グループ	22,300	260.00	5,798,000		
小林洋行	1,900	263.00	499,700		
第一生命ＨＬＤＧＳ	362,400	1,864.00	675,513,600	貸付株式数	144,900株
東京海上ＨＤ	229,000	6,185.00	1,416,365,000		
アドバンテッジリスクマネ	3,200	1,116.00	3,571,200	貸付株式数	900株
イー・ギャランティ	6,900	1,328.00	9,163,200	貸付株式数	2,300株
アサックス	3,200	674.00	2,156,800	貸付株式数	1,300株
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,600	2,477.00	6,440,200		
Ｔ＆Ｄホールディングス	198,100	1,424.00	282,094,400		
アドバンスクリエイト	1,500	1,908.00	2,862,000		
三井不動産	319,800	2,721.50	870,335,700		

三菱地所	448,800	2,127.00	954,597,600		
平和不動産	11,800	2,876.00	33,936,800		
東京建物	70,200	1,699.00	119,269,800		
ダイビル	16,600	1,199.00	19,903,400		
京阪神ビルディング	10,500	1,403.00	14,731,500	貸付株式数	1,000株
住友不動産	144,000	3,863.00	556,272,000		
太平洋興発	2,600	823.00	2,139,800	貸付株式数	200株
テーオーシー	12,800	892.00	11,417,600		
東京楽天地	1,100	6,290.00	6,919,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	8,700	2,769.00	24,090,300		
フジ住宅	7,600	694.00	5,274,400		
空港施設	6,400	553.00	3,539,200		
明和地所	3,500	619.00	2,166,500		
ゴールドクレスト	5,100	2,101.00	10,715,100	貸付株式数	2,000株
リログループ	34,000	2,867.00	97,478,000	貸付株式数	13,700株
エスリード	2,500	2,223.00	5,557,500		
日神不動産	9,600	549.00	5,270,400		
日本エスコン	11,700	1,009.00	11,805,300	貸付株式数	1,600株
タカラレーベン	29,600	510.00	15,096,000		
サンヨーハウジ　名古屋	3,700	1,038.00	3,840,600	貸付株式数	1,400株
イオンモール	32,100	1,901.00	61,022,100		
毎日コムネット	1,400	865.00	1,211,000		
ファースト住建	2,800	1,258.00	3,522,400	貸付株式数	1,000株
ランド	356,600	11.00	3,922,600	貸付株式数	31,400株
カチタス	8,000	4,855.00	38,840,000		
東祥	3,900	2,567.00	10,011,300	貸付株式数	1,100株
トーセイ	8,900	1,500.00	13,350,000	貸付株式数	3,500株
穴吹興産	700	3,540.00	2,478,000		
サンフロンティア不動産	9,000	1,323.00	11,907,000		
インテリックス	1,900	715.00	1,358,500		
ランドビジネス	2,800	748.00	2,094,400		
日本社宅サービス	1,700	1,171.00	1,990,700	貸付株式数	200株
グランディハウス	5,100	485.00	2,473,500	貸付株式数	300株
東武鉄道	68,500	4,080.00	279,480,000		
相鉄ホールディングス	20,700	2,987.00	61,830,900		
東急	163,800	2,062.00	337,755,600		
京浜急行	83,400	2,112.00	176,140,800		
小田急電鉄	96,600	2,612.00	252,319,200		
京王電鉄	33,700	6,760.00	227,812,000		
京成電鉄	45,200	4,315.00	195,038,000		

富士急行	8,900	4,265.00	37,958,500	貸付株式数	3,500株 (900株)
新京成電鉄	1,600	2,380.00	3,808,000		
東日本旅客鉄道	114,200	9,888.00	1,129,209,600		
西日本旅客鉄道	57,800	9,662.00	558,463,600		
東海旅客鉄道	54,000	22,285.00	1,203,390,000		
西武ホールディングス	87,100	1,829.00	159,305,900		
鴻池運輸	10,200	1,673.00	17,064,600		
西日本鉄道	18,000	2,575.00	46,350,000		
ハマキョウレックス	5,000	3,600.00	18,000,000		
サカイ引越センター	3,400	7,130.00	24,242,000		
近鉄グループＨＬＤＧＳ	61,500	6,020.00	370,230,000		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	82,000	4,795.00	393,190,000		
南海電鉄	29,200	2,997.00	87,512,400		
京阪ホールディングス	27,400	5,320.00	145,768,000	貸付株式数	2,200株
神戸電鉄	1,500	3,980.00	5,970,000	貸付株式数	100株
名古屋鉄道	50,600	3,435.00	173,811,000	貸付株式数	15,600株
山陽電鉄	4,400	2,190.00	9,636,000		
トランコム	1,700	7,960.00	13,532,000		
日本通運	21,700	6,500.00	141,050,000	貸付株式数	8,100株
ヤマトホールディングス	107,800	1,883.00	202,987,400	貸付株式数	43,100株
山　九	17,100	5,600.00	95,760,000		
日　新	5,300	1,865.00	9,884,500		
丸　運	2,800	303.00	848,400		
丸全昭和運輸	5,000	3,135.00	15,675,000		
センコーグループＨＬＤＧＳ	33,800	936.00	31,636,800		
トナミホールディングス	1,500	5,430.00	8,145,000		
ニッコンホールディングス	21,900	2,736.00	59,918,400		
日石輸送	600	2,897.00	1,738,200		
福山通運	7,800	4,080.00	31,824,000	貸付株式数	2,600株
セイノーホールディングス	46,000	1,486.00	68,356,000		
エスライン	1,800	1,033.00	1,859,400	貸付株式数	100株
神奈川中央交通	1,500	4,050.00	6,075,000		
日立物流	11,300	3,005.00	33,956,500	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
丸和運輸機関	6,500	2,491.00	16,191,500	貸付株式数	2,500株
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	6,200	1,456.00	9,027,200		
日本郵船	51,400	1,989.00	102,234,600		

商船三井	38,900	2,978.00	115,844,200	貸付株式数	15,500株
川崎汽船	19,000	1,860.00	35,340,000	貸付株式数	7,500株
ＮＳユナイテッド海運	3,400	2,305.00	7,837,000		
明治海運	6,400	370.00	2,368,000		
飯野海運	29,100	371.00	10,796,100		
共栄タンカー	600	1,802.00	1,081,200		
九州旅客鉄道	54,800	3,665.00	200,842,000		
ＳＧホールディングス	64,600	2,543.00	164,277,800		
日本航空	112,500	3,412.00	383,850,000		
ＡＮＡホールディングス	112,300	3,666.00	411,691,800		
パスコ	1,200	1,936.00	2,323,200	貸付株式数	400株
西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,200	3,900.00	4,680,000	貸付株式数	400株
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	600	1,524.00	914,400		
ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	3,100	2,397.00	7,430,700	貸付株式数	1,200株
国際紙パルプ商事	15,400	308.00	4,743,200		
総合メディカルＨＤ	5,600	2,050.00	11,480,000		
ブックオフＧＨＤ	3,800	1,064.00	4,043,200	貸付株式数	1,400株
三菱倉庫	19,500	2,891.00	56,374,500		
三井倉庫ＨＯＬＤ	7,100	1,997.00	14,178,700		
住友倉庫	22,600	1,498.00	33,854,800		
渋沢倉庫	3,400	2,339.00	7,952,600		
ヤマタネ	3,200	1,554.00	4,972,800	貸付株式数	1,000株
東陽倉庫	11,200	344.00	3,852,800		
乾汽船	3,700	1,139.00	4,214,300	貸付株式数	2,000株
日本トランスシティ	13,600	568.00	7,724,800	貸付株式数	700株
ケイヒン	1,100	1,363.00	1,499,300		
中央倉庫	3,800	1,250.00	4,750,000	貸付株式数	100株
川西倉庫	1,100	1,059.00	1,164,900		
安田倉庫	5,000	1,050.00	5,250,000		
ファイズホールディングス	1,300	619.00	804,700	貸付株式数	200株
東洋埠頭	1,800	1,404.00	2,527,200		
宇徳	5,200	540.00	2,808,000		
上　組	35,100	2,443.00	85,749,300		
サンリツ	1,400	707.00	989,800		
キムラユニティー	1,500	1,134.00	1,701,000		
キユーソー流通システム	1,500	1,900.00	2,850,000	貸付株式数	300株 (300株)

近鉄エクスプレス	13,100	1,887.00	24,719,700	貸付株式数	3,500株
東海運	3,600	288.00	1,036,800	貸付株式数	100株
エーアイテイー	4,400	979.00	4,307,600		
内外トランスライン	2,200	1,503.00	3,306,600	貸付株式数	800株
ショーエイコーポ	700	735.00	514,500	貸付株式数	200株
日本コンセプト	2,000	1,507.00	3,014,000	貸付株式数	100株
東京放送ＨＤ	38,700	1,918.00	74,226,600		
日本テレビＨＬＤＳ	53,000	1,468.00	77,804,000		
朝日放送グループＨＤ	6,000	765.00	4,590,000	貸付株式数	300株
テレビ朝日ＨＤ	17,500	2,092.00	36,610,000	貸付株式数	7,000株
スカパーＪＳＡＴＨＤ	41,800	476.00	19,896,800		
テレビ東京ＨＤ	5,200	2,382.00	12,386,400		
日本ＢＳ放送	2,100	1,104.00	2,318,400	貸付株式数	800株 (800株)
ビジョン	6,000	1,750.00	10,500,000	貸付株式数	2,200株
スマートバリュー	1,900	792.00	1,504,800	貸付株式数	700株
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	2,500	1,259.00	3,147,500	貸付株式数	900株
ワイヤレスゲート	3,100	637.00	1,974,700	貸付株式数	1,200株
コネクシオ	3,600	1,562.00	5,623,200		
日本通信	49,600	244.00	12,102,400	貸付株式数	22,900株 (1,000株)
クロップス	1,200	775.00	930,000		
日本電信電話	425,800	5,610.00	2,388,738,000		
ＫＤＤＩ	474,800	3,232.00	1,534,553,600		
ソフトバンク	579,100	1,442.50	835,351,750	貸付株式数	234,400株
光通信	6,600	27,520.00	181,632,000		
ＮＴＴドコモ	470,500	3,053.00	1,436,436,500		
エムティーアイ	6,100	730.00	4,453,000	貸付株式数	500株
ＧＭＯインターネット	25,200	2,170.00	54,684,000		
ファイバーゲート	1,300	1,425.00	1,852,500	貸付株式数	400株
アイドママーケティングコミュ	2,000	694.00	1,388,000		
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	17,300	1,906.00	32,973,800		
学研ホールディングス	2,100	7,300.00	15,330,000		
ゼンリン	12,700	1,952.00	24,790,400	貸付株式数	4,000株
昭文社	3,100	411.00	1,274,100		
インプレスホールディングス	5,300	187.00	991,100		
東京電力ＨＤ	518,300	486.00	251,893,800	貸付株式数	1,900株

中部電力	198,600	1,585.50	314,880,300		
関西電力	246,100	1,299.00	319,683,900		
中国電力	89,700	1,474.00	132,217,800	貸付株式数	36,300株
北陸電力	59,500	815.00	48,492,500		
東北電力	162,200	1,130.00	183,286,000		
四国電力	58,600	1,118.00	65,514,800		
九州電力	133,900	977.00	130,820,300		
北海道電力	60,700	544.00	33,020,800		
沖縄電力	12,100	2,080.00	25,168,000		
電源開発	51,700	2,727.00	140,985,900		
エフオン	3,100	759.00	2,352,900	貸付株式数	1,200株
イーレックス	9,300	1,810.00	16,833,000	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
レノバ	10,800	1,193.00	12,884,400		
東京瓦斯	124,800	2,732.00	340,953,600		
大阪瓦斯	125,900	2,221.00	279,623,900		
東邦瓦斯	32,200	4,600.00	148,120,000		
北海道瓦斯	3,400	1,675.00	5,695,000		
広島ガス	13,000	365.00	4,745,000		
西部瓦斯	7,300	2,608.00	19,038,400		
静岡ガス	18,400	1,001.00	18,418,400		
メタウォーター	3,100	4,415.00	13,686,500	貸付株式数	1,000株
アイネット	3,400	1,548.00	5,263,200		
松　竹	4,200	16,340.00	68,628,000	貸付株式数	1,600株
東　宝	38,100	4,460.00	169,926,000	貸付株式数	14,700株
エイチ・アイ・エス	9,700	3,165.00	30,700,500	貸付株式数	3,900株
東　映	2,400	16,850.00	40,440,000		
ラックランド	1,300	2,347.00	3,051,100	貸付株式数	400株
ＮＴＴデータ	170,000	1,475.00	250,750,000		
共立メンテナンス	10,300	4,975.00	51,242,500	貸付株式数	4,100株 (1,300株)
イチネンホールディングス	7,000	1,583.00	11,081,000	貸付株式数	2,700株
建設技術研究所	4,300	2,130.00	9,159,000		
スペース	3,900	1,318.00	5,140,200		
長　大	2,300	1,306.00	3,003,800		
アインホールディングス	8,600	6,770.00	58,222,000	貸付株式数	3,400株
燦ホールディングス	2,700	1,445.00	3,901,500		
ピー・シー・エー	800	4,895.00	3,916,000	貸付株式数	300株
スバル興業	400	8,680.00	3,472,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,400	1,404.00	3,369,600	貸付株式数	900株

タナベ経営	1,200	1,301.00	1,561,200	貸付株式数	100株
ビジネスＢ太田昭和	1,100	2,286.00	2,514,600	貸付株式数	400株
ナ　ガ　ワ	2,000	8,130.00	16,260,000	貸付株式数	200株
よみうりランド	1,300	4,620.00	6,006,000		
東京都競馬	4,100	3,470.00	14,227,000	貸付株式数	1,600株
常磐興産	2,600	1,648.00	4,284,800	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,200	2,960.00	30,192,000	貸付株式数	4,100株
東京ドーム	25,200	1,047.00	26,384,400	貸付株式数	8,600株
ＤＴＳ	14,400	2,494.00	35,913,600		
スクウェア・エニックス・ＨＤ	27,200	5,530.00	150,416,000		
シーイーシー	6,900	2,139.00	14,759,100		
カプコン	30,100	3,085.00	92,858,500		
西尾レントオール	6,300	3,195.00	20,128,500		
アイ・エス・ビー	1,300	1,947.00	2,531,100		
アゴーラ・ホスピタリティーＧ	41,500	33.00	1,369,500		
日本空港ビルデング	20,500	6,110.00	125,255,000	貸付株式数	8,100株
トランス・コスモス	6,000	2,977.00	17,862,000		
乃村工藝社	26,600	1,435.00	38,171,000		
ジャステック	4,200	1,113.00	4,674,600	貸付株式数	1,600株
ＳＣＳＫ	14,800	5,770.00	85,396,000		
藤田観光	2,700	2,885.00	7,789,500	貸付株式数	100株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	3,900	1,497.00	5,838,300		
日本管財	6,500	1,970.00	12,805,000		
トーカイ	6,000	2,881.00	17,286,000		
白　洋　舎	700	2,907.00	2,034,900	貸付株式数	200株
セコム	65,800	9,920.00	652,736,000		
日本システムウエア	2,200	2,476.00	5,447,200		
セントラル警備保障	3,000	6,230.00	18,690,000		
アイネス	6,500	1,336.00	8,684,000		
丹青社	11,700	1,292.00	15,116,400		
メイテツク	7,700	6,180.00	47,586,000		
ＴＫＣ	5,500	5,290.00	29,095,000		
富士ソフト	8,200	4,250.00	34,850,000		
応用地質	6,700	1,507.00	10,096,900		
船井総研ホールディン	12,800	2,508.00	32,102,400		
ＮＳＤ	10,600	3,640.00	38,584,000		
進学会ホールディングス	2,500	528.00	1,320,000		

丸紅建材リース	600	1,772.00	1,063,200		
オ　オ　バ	4,900	915.00	4,483,500	貸付株式数	1,900株
コナミホールディングス	23,100	4,515.00	104,296,500	貸付株式数	9,200株
いであ	1,200	3,030.00	3,636,000	貸付株式数	400株
学　究　社	1,800	1,399.00	2,518,200		
ベネッセホールディングス	20,700	2,924.00	60,526,800		
イオンディライト	7,600	3,960.00	30,096,000		
ナック	3,500	1,015.00	3,552,500		
福井コンピュータＨＬＤＳ	2,600	3,730.00	9,698,000	貸付株式数	800株 (800株)
ニチイ学館	8,900	1,576.00	14,026,400		
ダイセキ	10,400	3,200.00	33,280,000	貸付株式数	4,100株
ステップ	2,200	1,550.00	3,410,000		
日鉄物産	4,600	5,250.00	24,150,000		
泉州電業	2,000	3,445.00	6,890,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,600	2,890.00	4,624,000		
トラスコ中山	13,300	2,944.00	39,155,200	貸付株式数	5,300株
ヤマダ電機	194,700	560.00	109,032,000		
オートバックスセブン	23,600	1,744.00	41,158,400		
モリト	4,700	803.00	3,774,100		
アークランドサカモト	9,900	1,285.00	12,721,500		
ニトリホールディングス	27,700	17,580.00	486,966,000		
グルメ杵屋	4,500	1,216.00	5,472,000		
愛　眼	5,100	242.00	1,234,200		
ケーユーホールディングス	3,300	945.00	3,118,500		
吉野家ホールディングス	21,100	2,714.00	57,265,400	貸付株式数	8,400株 (5,200株)
加藤産業	10,000	3,740.00	37,400,000		
北恵	1,200	954.00	1,144,800		
イノテック	3,800	1,095.00	4,161,000		
イエローハット	12,100	1,966.00	23,788,600		
松屋フーズＨＬＤＧＳ	3,100	4,400.00	13,640,000		
ＪＢＣＣホールディングス	4,500	1,892.00	8,514,000	貸付株式数	300株
ＪＫホールディングス	5,900	681.00	4,017,900		
サガミホールディングス	8,400	1,380.00	11,592,000	貸付株式数	100株
日　伝	5,800	2,130.00	12,354,000		
関西スーパーマーケット	5,300	1,075.00	5,697,500	貸付株式数	200株
ミロク情報サービス	5,700	3,400.00	19,380,000	貸付株式数	2,400株 (100株)
北沢産業	5,000	282.00	1,410,000	貸付株式数	1,100株

杉本商事	3,500	2,061.00	7,213,500		
因幡電機産業	18,200	2,825.00	51,415,000		
王将フードサービス	4,700	6,480.00	30,456,000		
プレナス	7,100	1,926.00	13,674,600	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,700	1,475.00	6,932,500	貸付株式数	1,800株
アークス	13,000	2,325.00	30,225,000		
バローホールディングス	14,100	2,121.00	29,906,100		
東　テ　ク	2,100	2,727.00	5,726,700		
ミスミグループ本社	80,100	2,701.00	216,350,100		
藤　　久	500	782.00	391,000	貸付株式数	200株
アルテック	5,000	230.00	1,150,000		
ベ　ル　ク	3,100	5,470.00	16,957,000		
大　庄	3,400	1,646.00	5,596,400	貸付株式数	1,200株
タキヒヨー	2,000	1,995.00	3,990,000		
ファーストリテイリング	8,600	67,020.00	576,372,000	貸付株式数	3,400株
ソフトバンクグループ	505,500	4,607.00	2,328,838,500		
蔵王産業	1,200	1,475.00	1,770,000		
スズケン	27,100	4,530.00	122,763,000		
サンドラッグ	24,100	3,985.00	96,038,500		
サックスバーホールディング	5,300	927.00	4,913,100		
ジェコス	4,300	1,087.00	4,674,100		
ヤマザワ	1,500	1,710.00	2,565,000	貸付株式数	400株
や　ま　や	1,300	2,248.00	2,922,400	貸付株式数	500株
グローセル	6,100	459.00	2,799,900		
ベルーナ	13,700	717.00	9,822,900		
合計			159,283,041,130		

（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。

「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12月18日現在	2019年12月18日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	328,173,314	707,357,143
金銭信託	63,196,362	－
コール・ローン	264,708,392	3,881,924,324
株式	96,598,974,693	123,585,676,323
投資証券	2,730,416,158	3,533,744,490
派生商品評価勘定	－	9,627,771
未収入金	461,333	2,144,789
未収配当金	136,354,519	145,384,795
差入委託証拠金	744,120,976	1,916,588,000
流動資産合計	100,866,405,747	133,782,447,635
資産合計	100,866,405,747	133,782,447,635
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	29,605,952	6,395,573
未払金	－	20,849,385
未払解約金	3,167,800	194,134,100
その他未払費用	3,729	－
流動負債合計	32,777,481	221,379,058
負債合計	32,777,481	221,379,058
純資産の部		
元本等		
元本　※1	44,096,261,199	47,884,230,145

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	56,737,367,067	85,676,838,432
元本等合計	100,833,628,266	133,561,068,577
純資産合計	100,833,628,266	133,561,068,577
負債純資産合計	100,866,405,747	133,782,447,635

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2018年12月19日 至　2019年12月18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12月18日現在	2019年12月18日現在
1．※1　期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	39,738,227,827円	44,096,261,199円
期中追加設定元本額	7,465,582,702円	10,685,063,775円
期中一部解約元本額	3,107,549,330円	6,897,094,829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	499,385,747円	459,891,676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)	195,204,265円	133,457,323円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	25,078,769円	18,713,870円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	623,000,121円	459,765,228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）	846,375円	9,340,416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）	553,148,518円	543,057,737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）	1,514,122,256円	1,911,761,435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）	532,534,499円	535,710,578円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	5,540,781円	2,791,904円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	197,868円	2,288,919円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	737,760,888円	1,176,446,112円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	579,355,553円	835,395,033円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	8,552,977円	26,977,520円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	27,685,196,810円	29,487,171,890円
ダイワ・ライフ・バランス３０	571,047,005円	573,572,423円
ダイワ・ライフ・バランス５０	844,962,807円	873,279,649円
ダイワ・ライフ・バランス７０	681,438,616円	678,322,151円

大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,490,108,018円	1,501,546,937円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	4,180,386円	2,984,064円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	13,352,537円	14,416,386円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	4,236,847円	5,930,998円
ダイワつみたてインデックス外国株式	6,232,510円	164,215,275円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	348,591円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	121,712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	238,397,161円	177,817,695円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	348,671,890円	313,874,830円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,140,769,877円	2,605,295,399円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	153,782,925円	126,914,123円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	635,373,798円	675,635,286円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	88,789,723円	114,168,565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）	453,618円	1,595,581,808円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,748,317,297円	2,705,159,602円

ダイワライフスタイル２５	19,476,612円	18,324,834円
ダイワライフスタイル５０	70,259,055円	67,071,616円
ダイワライフスタイル７５	58,811,526円	54,212,966円
計	44,096,261,199円	47,884,230,145円
2. 期末日における受益権の総数	44,096,261,199口	47,884,230,145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19日 至　2019年12月18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18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12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△6,210,725,766	1,939,703,834
投資証券	△87,905,261	△116,003,488
合計	△6,298,631,027	1,823,700,346

（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12月1日から2018年12月18日まで、及び2019年12月3日から2019年12月18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12月18日 現在				2019年12月18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	1,454,705,923	－	1,426,902,061	△27,803,862	6,479,532,777	－	6,473,561,985	△5,970,792
合計	1,454,705,923	－	1,426,902,061	△27,803,862	6,479,532,777	－	6,473,561,985	△5,970,792

（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12月18日 現在				2019年12月18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	271,802,090	－	270,000,000	△1,802,090	3,732,321,510	－	3,741,524,500	9,202,990
アメリカ・ドル	271,802,090	－	270,000,000	△1,802,090	3,016,718,160	－	3,017,784,000	1,065,840
イギリス・ポンド	－	－	－	－	49,485,450	－	50,253,000	767,550
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	51,869,440	－	52,451,000	581,560
カナダ・ドル	－	－	－	－	127,720,310	－	128,789,500	1,069,190
スイス・フラン	－	－	－	－	87,713,600	－	89,416,000	1,702,400
ユーロ	－	－	－	－	398,814,550	－	402,831,000	4,016,450
合計	271,802,090	－	270,000,000	△1,802,090	3,732,321,510	－	3,741,524,500	9,202,990

（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12月18日現在	2019年12月18日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2867円 (22,867円)	2.7892円 (27,892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	122.470	404,151.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,850	230.670	657,409.500	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5,550	103.940	576,867.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,100	70.000	287,000.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,600	149.300	238,880.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	18,500	36.910	682,835.000	
	ABBOTT LABORATORIES	49,916	87.060	4,345,686.960	
	ARCONIC INC	11,133	31.480	350,466.840	
	VERISK ANALYTICS INC	4,350	150.810	656,023.500	
	LAS VEGAS SANDS CORP	9,800	68.210	668,458.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	8,550	106.900	913,995.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	17,362	137.860	2,393,525.320	
	QORVO INC	3,400	114.350	388,790.000	
	AFLAC INC	21,600	53.110	1,147,176.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,650	116.010	423,436.500	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,200	62.910	264,222.000	

ADOBE INC	13,750	322.850	4,439,187.500	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,450	46.920	302,634.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,100	222.980	691,238.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	11,300	17.050	192,665.000	
GARMIN LTD	3,900	97.880	381,732.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,130	235.610	1,444,289.300	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	20,550	176.700	3,631,185.000	
WR BERKLEY CORP	4,175	69.570	290,454.750	
AUTOZONE INC	730	1,221.830	891,935.900	
DOLLAR TREE INC	6,971	92.040	641,610.840	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	31,400	9.700	304,580.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,200	87.600	280,320.000	
CELANESE CORP	3,500	123.230	431,305.000	
DR HORTON INC	10,116	53.700	543,229.200	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,450	33.960	83,202.000	
DENTSPLY SIRONA INC	7,000	57.510	402,570.000	
AUTODESK INC	6,100	181.490	1,107,089.000	
MOODY'S CORP	4,800	235.360	1,129,728.000	
DEVON ENERGY CORP	11,650	24.170	281,580.500	
ALBEMARLE CORP	3,150	68.770	216,625.500	
ATMOS ENERGY CORP	3,350	108.650	363,977.500	
ALLIANT ENERGY CORP	6,700	53.875	360,962.500	
CITIGROUP INC	65,373	77.740	5,082,097.020	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	12,250	168.320	2,061,920.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	14,250	93.220	1,328,385.000	
ALLEGHANY CORP	410	801.850	328,758.500	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	291.750	320,925.000	
HESS CORP	7,800	64.670	504,426.000	
DAVITA INC	3,500	71.580	250,530.000	
DANAHER CORP	18,200	150.770	2,744,014.000	
FORTIVE CORP	8,700	76.740	667,638.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	16,250	92.600	1,504,750.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,900	20.560	100,744.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	5,628	18.690	105,187.320	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,800	46.210	730,118.000	
BUNGE LTD	4,000	55.840	223,360.000	

TE CONNECTIVITY LTD	9,825	95.450	937,796.250	
APPLE INC	129,800	280.410	36,397,218.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,400	86.510	813,194.000	
BOEING CO/THE	14,990	327.000	4,901,730.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,465	105.580	471,414.700	
BECTON DICKINSON AND CO	7,649	269.030	2,057,810.470	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	23.210	155,507.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,850	91.530	352,390.500	
CDK GLOBAL INC	3,600	55.310	199,116.000	
NISOURCE INC	11,050	27.260	301,223.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,850	77.770	299,414.500	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	24,321	51.160	1,244,262.360	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	116,904	61.490	7,188,426.960	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	36,350	227.050	8,253,267.500	
ANSYS INC	2,450	257.070	629,821.500	
TRUIST FINANCIAL CORP	38,317	56.670	2,171,424.390	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	19,000	54.580	1,037,020.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	66,850	64.110	4,285,753.500	
JPMORGAN CHASE & CO	91,070	138.180	12,584,052.600	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,950	123.020	854,989.000	
LKQ CORP	9,400	36.060	338,964.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,350	200.820	271,107.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,062	64.380	583,411.560	
CADENCE DESIGN SYS INC	8,300	69.130	573,779.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,810	167.340	637,565.400	
DOLLAR GENERAL CORP	7,500	155.180	1,163,850.000	
SERVICENOW INC	5,160	276.140	1,424,882.400	
CATERPILLAR INC	16,200	146.370	2,371,194.000	
BROWN & BROWN INC	7,000	39.540	276,780.000	
AQUA AMERICA INC	6,300	45.720	288,036.000	
CMS ENERGY CORP	8,200	62.080	509,056.000	
MOSAIC CO/THE	10,950	20.150	220,642.500	
DELTA AIR LINES INC	4,750	58.690	278,777.500	
CORNING INC	23,200	28.510	661,432.000	
CISCO SYSTEMS INC	121,050	46.440	5,621,562.000	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	3,700	63.930	236,541.000	
MORGAN STANLEY	35,650	50.900	1,814,585.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,550	135.220	209,591.000	

MSCI INC	2,450	258.490	633,300.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,000	258.580	258,580.000	
MIDDLEBY CORP	1,600	110.520	176,832.000	
COTY INC-CL A	8,439	11.150	94,094.850	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	6,500	60.100	390,650.000	
BROADCOM INC	11,122	323.800	3,601,303.600	
ACUITY BRANDS INC	1,150	137.030	157,584.500	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,330	116.550	388,111.500	
ARAMARK	7,050	44.070	310,693.500	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,050	30.450	184,222.500	
DTE ENERGY COMPANY	5,250	128.670	675,517.500	
CENTENE CORP	12,150	58.940	716,121.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,200	116.710	373,472.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	13,050	40.530	528,916.500	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,350	95.670	511,834.500	
GARTNER INC	2,720	153.490	417,492.800	
SPLUNK INC	4,500	145.100	652,950.000	
DOMINION ENERGY INC	22,641	81.560	1,846,599.960	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,700	62.770	734,409.000	
SMITH (A.O.) CORP	4,150	46.810	194,261.500	
DEERE & CO	8,750	173.840	1,521,100.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	8,184	180.470	1,476,966.480	
VMWARE INC-CLASS A	2,500	148.940	372,350.000	
BURLINGTON STORES INC	1,900	225.290	428,051.000	
NASDAQ INC	3,450	106.000	365,700.000	
VAIL RESORTS INC	1,120	246.820	276,438.400	
EAST WEST BANCORP INC	4,100	49.440	202,704.000	
TARGA RESOURCES CORP	6,550	38.000	248,900.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,800	167.420	301,356.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,180	111.580	243,244.400	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,050	69.590	73,069.500	
CONSOLIDATED EDISON INC	9,200	88.530	814,476.000	
COGNEX CORP	5,050	56.510	285,375.500	
TELEFLEX INC	1,330	367.230	488,415.900	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,600	114.600	297,960.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,200	148.390	326,458.000	

BIO-RAD LABORATORIES-A	650	365.090	237,308.500	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,520	317.260	482,235.200	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,800	144.630	549,594.000	
IDEX CORP	2,250	169.190	380,677.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	23,050	67.840	1,563,712.000	
ROLLINS INC	4,325	32.990	142,681.750	
AMETEK INC	6,525	99.200	647,280.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,350	68.740	505,239.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,650	36.830	134,429.500	
HEICO CORP	1,200	120.670	144,804.000	
XPO LOGISTICS INC	2,550	81.890	208,819.500	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,150	268.590	308,878.500	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,500	94.870	711,525.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,100	291.850	321,035.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	12,400	295.550	3,664,820.000	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,400	104.980	251,952.000	
GRUBHUB INC	2,600	45.790	119,054.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,650	209.220	345,213.000	
RPM INTERNATIONAL INC	3,800	75.250	285,950.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	690	832.050	574,114.500	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6,950	21.610	150,189.500	
UGI CORP	5,200	45.120	234,624.000	
CUMMINS INC	4,350	182.270	792,874.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	21,550	58.260	1,255,503.000	
SABRE CORP	7,650	22.580	172,737.000	
CDW CORP/DE	4,350	139.360	606,216.000	
SIGNATURE BANK	1,500	137.230	205,845.000	
COSTAR GROUP INC	990	594.000	588,060.000	
SVB FINANCIAL GROUP	1,490	254.210	378,772.900	
AMERCO	220	370.240	81,452.800	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,850	186.680	345,358.000	
MERCADOLIBRE INC	1,270	585.840	744,016.800	
HANESBRANDS INC	11,000	14.640	161,040.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,300	146.980	338,054.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	8,166	108.800	888,460.800	
IPG PHOTONICS CORP	1,020	148.720	151,694.400	

DEXCOM INC	2,700	217.330	586,791.000	
COPART INC	5,850	90.380	528,723.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,650	86.610	402,736.500	
SEATTLE GENETICS INC	3,250	113.210	367,932.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,270	268.290	609,018.300	
TRANSDIGM GROUP INC	1,330	570.320	758,525.600	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,600	108.500	282,100.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,900	19.740	195,426.000	
KINDER MORGAN INC	57,581	20.510	1,180,986.310	
HCA HEALTHCARE INC	7,900	143.430	1,133,097.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,150	373.540	429,571.000	
CABOT OIL & GAS CORP	12,050	16.690	201,114.500	
T-MOBILE US INC	10,000	75.490	754,900.000	
ZILLOW GROUP INC - C	3,450	43.290	149,350.500	
COCA-COLA CO/THE	114,150	54.420	6,212,043.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	7,100	49.810	353,651.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,850	76.600	371,510.000	
EATON VANCE CORP	3,050	47.550	145,027.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,650	26.240	226,976.000	
CSX CORP	22,150	72.100	1,597,015.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,680	167.500	448,900.000	
EXPEDIA GROUP INC	4,075	111.510	454,403.250	
AUTOLIV INC	2,400	86.000	206,400.000	
AMAZON.COM INC	11,770	1,790.660	21,076,068.200	
FLOWSERVE CORP	3,550	47.920	170,116.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,000	237.920	1,427,520.000	
EXXON MOBIL CORP	119,655	69.680	8,337,560.400	
FLIR SYSTEMS INC	3,750	52.600	197,250.000	
AES CORP	20,100	18.920	380,292.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,240	279.010	345,972.400	
EOG RESOURCES INC	16,400	78.810	1,292,484.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,850	84.290	408,806.500	
ABIOMED INC	1,290	178.930	230,819.700	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,650	83.150	386,647.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,240	83.950	775,698.000	
FORD MOTOR CO	110,923	9.390	1,041,566.970	
DISCOVERY INC - A	4,690	32.370	151,815.300	
EXACT SCIENCES CORP	3,700	91.450	338,365.000	

LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	21.720	106,145.640	
DISCOVERY INC-C	10,089	30.090	303,578.010	
AERCAP HOLDINGS NV	4,000	61.530	246,120.000	
FORTINET INC	4,150	106.350	441,352.500	
MARKEL CORP	410	1,141.080	467,842.800	
NEXTERA ENERGY INC	13,550	239.820	3,249,561.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	43,408	12.960	562,567.680	
INSULET CORP	1,750	175.350	306,862.500	
US BANCORP	42,800	60.680	2,597,104.000	
UNITED RENTALS INC	2,300	164.510	378,373.000	
F5 NETWORKS INC	1,750	141.220	247,135.000	
FASTENAL CO	16,300	36.870	600,981.000	
FISERV INC	16,163	116.780	1,887,515.140	
GENERAL ELECTRIC CO	246,850	11.100	2,740,035.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	6,100	55.270	337,147.000	
GENERAL MOTORS CO	36,100	36.310	1,310,791.000	
TRIPADVISOR INC	3,300	29.210	96,393.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,900	181.100	1,249,590.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,290	231.150	2,147,383.500	
ALPHABET INC-CL A	8,400	1,354.890	11,381,076.000	
ALPHABET INC-CL C	8,747	1,355.120	11,853,234.640	
OWENS CORNING	3,150	65.020	204,813.000	
GENERAL MILLS INC	16,850	52.170	879,064.500	
FIRSTENERGY CORP	15,268	48.280	737,139.040	
GENUINE PARTS CO	4,300	105.890	455,327.000	
IHS MARKIT LTD	10,634	75.130	798,932.420	
FIFTH THIRD BANCORP	20,700	31.310	648,117.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	6,410	199.080	1,276,102.800	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	28.280	84,840.000	
HALLIBURTON CO	24,800	24.690	612,312.000	
HOME DEPOT INC	31,000	217.720	6,749,320.000	
ASSURANT INC	1,750	131.680	230,440.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	29,900	15.330	458,367.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,190	252.400	300,356.000	
HERSHEY CO/THE	4,350	144.710	629,488.500	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,450	37.430	166,563.500	
HUMANA INC	3,830	363.920	1,393,813.600	

NXP SEMICONDUCTORS NV	8,150	125.930	1,026,329.500	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,100	165.760	348,096.000	
HENRY SCHEIN INC	4,500	68.150	306,675.000	
HP INC	42,600	20.370	867,762.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	39,400	15.840	624,096.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,800	47.060	225,888.000	
HOLLYFRONTIER CORP	4,700	50.870	239,089.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,000	44.140	264,840.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,500	47.430	118,575.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,900	42.620	507,178.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	19,853	31.620	627,751.860	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	25,000	134.220	3,355,500.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	10,700	46.590	498,513.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,000	65.980	263,920.000	
ZOETIS INC	13,550	127.100	1,722,205.000	
INGERSOLL-RAND PLC	6,979	133.610	932,464.190	
CHENIERE ENERGY INC	6,550	61.520	402,956.000	
ALLEGION PLC	2,650	123.530	327,354.500	
LEGGETT & PLATT INC	3,500	51.530	180,355.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	11,773	20.725	243,995.420	
WASTE CONNECTIONS INC	7,557	90.410	683,228.370	
JUNIPER NETWORKS INC	9,650	24.210	233,626.500	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,200	131.470	289,234.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,420	102.140	349,318.800	
JOHNSON & JOHNSON	74,800	143.560	10,738,288.000	
ABBVIE INC	41,779	90.080	3,763,452.320	
HOLOGIC INC	7,550	53.030	400,376.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	9,950	135.210	1,345,339.500	
KROGER CO	22,950	28.700	658,665.000	
KLA CORP	4,650	175.960	818,214.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	7,170	386.890	2,774,001.300	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,560	303.620	777,267.200	
LOWE'S COS INC	22,450	119.320	2,678,734.000	
ELI LILLY & CO	24,605	125.330	3,083,744.650	
LAM RESEARCH CORP	4,230	290.570	1,229,111.100	

JONES LANG LASALLE INC	1,450	169.660	246,007.000	
LOEWS CORP	7,900	51.400	406,060.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,799	61.010	353,796.990	
MCDONALD'S CORP	21,600	196.520	4,244,832.000	
3M CO	16,250	169.930	2,761,362.500	
FACEBOOK INC-CLASS A	67,650	198.390	13,421,083.500	
MANPOWERGROUP INC	1,780	96.480	171,734.400	
S&P GLOBAL INC	6,980	271.560	1,895,488.800	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,840	274.220	504,564.800	
CONCHO RESOURCES INC	5,800	80.730	468,234.000	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	6,600	34.380	226,908.000	
PHILLIPS 66	12,850	113.030	1,452,435.500	
TECHNIPFMC PLC	12,100	20.010	242,121.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,450	33.080	478,006.000	
DXC TECHNOLOGY CO	7,788	36.920	287,532.960	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,350	167.030	559,550.500	
MYLAN NV	14,850	18.830	279,625.500	
METLIFE INC	23,500	51.170	1,202,495.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,100	25.770	466,437.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,510	199.000	300,490.000	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	46.660	223,968.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,778	160.980	769,162.440	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	640	777.170	497,388.800	
BAKER HUGHES CO	14,473	24.370	352,707.010	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,380	203.620	688,235.600	
MERCK & CO. INC.	72,721	89.020	6,473,623.420	
DUPONT DE NEMOURS INC	21,168	64.220	1,359,408.960	
MASCO CORP	8,600	47.450	408,070.000	
M & T BANK CORP	3,569	169.780	605,944.820	
MARSH & MCLENNAN COS	14,450	112.050	1,619,122.500	
BLACK KNIGHT INC	4,400	63.930	281,292.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,300	93.410	214,843.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,872	148.910	1,172,219.520	
WORKDAY INC-CLASS A	4,800	159.610	766,128.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,850	83.640	154,734.000	
SQUARE INC - A	10,100	65.550	662,055.000	

TRANSUNION	5,500	85.130	468,215.000	
VISTRA ENERGY CORP	10,050	23.940	240,597.000	
CAPRI HOLDINGS LTD	4,450	37.880	168,566.000	
BEIGENE LTD-ADR	1,050	162.860	171,003.000	
NETAPP INC	7,450	63.460	472,777.000	
NIKE INC -CL B	35,550	99.650	3,542,557.500	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,500	190.430	1,428,225.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,800	102.470	696,796.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,750	91.320	342,450.000	
ALLY FINANCIAL INC	11,450	31.750	363,537.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,450	345.840	1,538,988.000	
APTIV PLC	7,200	95.840	690,048.000	
NEWMONT GOLDCORP CORP	23,161	40.470	937,325.670	
MCKESSON CORP	5,550	137.900	765,345.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,100	60.550	490,455.000	
XYLEM INC	5,150	77.980	401,597.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	44,050	85.950	3,786,097.500	
NUCOR CORP	8,700	57.170	497,379.000	
WESTERN UNION CO	12,946	26.860	347,729.560	
GODADDY INC - CLASS A	5,300	67.480	357,644.000	
NEWELL BRANDS INC	12,292	18.920	232,564.640	
EVERGY INC	6,850	63.600	435,660.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	25,724	38.320	985,743.680	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	700	172.080	120,456.000	
OKTA INC	3,000	114.100	342,300.000	
LIBERTY BROADBAND-C	3,150	120.580	379,827.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	10,705	28.760	307,875.800	
LINDE PLC	15,296	209.660	3,206,959.360	
WIX.COM LTD	1,450	119.600	173,420.000	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	8,300	24.750	205,425.000	
KKR & CO INC -A	14,700	29.410	432,327.000	
PAYCHEX INC	9,350	85.210	796,713.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,200	443.700	976,140.000	
ALTRIA GROUP INC	52,850	50.830	2,686,365.500	
PFIZER INC	157,113	38.900	6,111,695.700	
CIGNA CORP	10,680	193.520	2,066,793.600	
DELL TECHNOLOGIES -C	4,551	49.930	227,231.430	
ALTICE USA INC- A	4,100	26.290	107,789.000	
XCEL ENERGY INC	14,850	63.460	942,381.000	

STERIS PLC	2,500	151.520	378,800.000	
FOX CORP - CLASS B	4,833	36.240	175,147.920	
FOX CORP - CLASS A	9,999	37.160	371,562.840	
STRYKER CORP	9,500	203.460	1,932,870.000	
DOW INC	21,068	54.660	1,151,576.880	
PARKER HANNIFIN CORP	3,750	203.720	763,950.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	5,200	29.750	154,700.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,650	144.030	669,739.500	
POLARIS INC	1,550	100.420	155,651.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	70,767	125.310	8,867,812.770	
EXELON CORP	27,372	44.980	1,231,192.560	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,600	109.820	724,812.000	
NVR INC	100	3,817.270	381,727.000	
CONOCOPHILLIPS	31,900	63.520	2,026,288.000	
TWILIO INC - A	3,150	97.590	307,408.500	
DOCUSIGN INC	2,900	73.630	213,527.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,400	256.510	359,114.000	
MATCH GROUP INC	1,800	71.040	127,872.000	
PEPSICO INC	39,550	136.170	5,385,523.500	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,100	123.380	135,718.000	
DROPBOX INC-CLASS A	5,200	17.160	89,232.000	
MONGODB INC	1,250	129.390	161,737.500	
SNAP INC - A	20,800	15.100	314,080.000	
CORTEVA INC	21,568	26.770	577,375.360	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,800	95.130	1,122,534.000	
AMCOR PLC	47,900	10.810	517,799.000	
ROKU INC	2,400	135.280	324,672.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,150	120.900	622,635.000	
ACCENTURE PLC-CL A	18,080	203.400	3,677,472.000	
PENTAIR PLC	4,705	45.380	213,512.900	
QUALCOMM INC	34,350	88.320	3,033,792.000	
INVESCO LTD	10,950	18.220	199,509.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,050	157.980	323,859.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,350	54.660	456,411.000	
PINTEREST INC- CLASS A	4,500	18.210	81,945.000	
RAYTHEON COMPANY	7,920	217.790	1,724,896.800	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,200	369.100	812,020.000	

REPUBLIC SERVICES INC	6,750	89.690	605,407.500	
BOOKING HOLDINGS INC	1,230	2,001.870	2,462,300.100	
ROSS STORES INC	10,700	113.810	1,217,767.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,650	112.310	297,621.500	
RESMED INC	4,150	156.480	649,392.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,800	106.750	405,650.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,350	62.020	207,767.000	
RALPH LAUREN CORP	1,450	117.460	170,317.000	
PERKINELMER INC	3,100	95.190	295,089.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	30,235	17.430	526,996.050	
CHEVRON CORP	53,818	118.600	6,382,814.800	
EDISON INTERNATIONAL	10,300	73.550	757,565.000	
TESLA INC	3,770	378.990	1,428,792.300	
NORTONLIFELOCK INC	18,450	25.920	478,224.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,422	165.010	729,674.220	
SYNOPSYS INC	4,350	136.940	595,689.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,415	471.130	2,080,038.950	
CBRE GROUP INC - A	9,150	58.840	538,386.000	
TWITTER INC	21,150	30.700	649,305.000	
SOUTHERN CO/THE	29,350	63.700	1,869,595.000	
SYSCO CORP	13,700	84.140	1,152,718.000	
TRAVELERS COS INC/THE	7,303	136.990	1,000,437.970	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,950	66.700	263,465.000	
STEEL DYNAMICS INC	6,200	34.890	216,318.000	
SCHLUMBERGER LTD	39,202	39.460	1,546,910.920	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,600	53.140	244,444.000	
AT&T INC	206,591	38.500	7,953,753.500	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,050	54.180	219,429.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	12,300	23.630	290,649.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,330	578.140	1,347,066.200	
SEMPRA ENERGY	7,900	150.120	1,185,948.000	
TIFFANY & CO	3,250	133.700	434,525.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,100	59.170	420,107.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	26,500	127.090	3,367,885.000	
SALESFORCE.COM INC	23,421	161.630	3,785,536.230	
WESTROCK CO	7,130	42.010	299,531.300	

JOHNSON CONTROLS INTERNATION	22,984	40.680	934,989.120	
TERADYNE INC	5,000	68.520	342,600.000	
UNION PACIFIC CORP	19,950	177.390	3,538,930.500	
MARATHON OIL CORP	24,800	13.370	331,576.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	19,388	61.210	1,186,739.480	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	23,137	148.620	3,438,620.940	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	19,700	120.290	2,369,713.000	
UNUM GROUP	5,900	30.510	180,009.000	
SPRINT CORP	23,165	5.200	120,458.000	
IQVIA HOLDINGS INC	4,894	147.990	724,263.060	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	58.590	254,866.500	
AMEREN CORPORATION	7,200	75.610	544,392.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	26,776	290.470	7,777,624.720	
VERISIGN INC	3,000	190.930	572,790.000	
VALERO ENERGY CORP	11,742	95.680	1,123,474.560	
ULTA BEAUTY INC	1,610	255.960	412,095.600	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8,188	47.050	385,245.400	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,500	141.520	353,800.000	
ANTHEM INC	7,280	290.740	2,116,587.200	
WALT DISNEY CO/THE	50,912	147.730	7,521,229.760	
WELLS FARGO & CO	120,922	54.340	6,570,901.480	
WASTE MANAGEMENT INC	11,950	112.960	1,349,872.000	
WILLIAMS COS INC	34,700	22.940	796,018.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,450	93.450	322,402.500	
WHIRLPOOL CORP	1,900	146.650	278,635.000	
WALMART INC	40,500	121.280	4,911,840.000	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	76.630	222,227.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,800	149.860	869,188.000	
WYNN RESORTS LTD	2,900	133.500	387,150.000	
XEROX HOLDINGS CORP	5,911	37.080	219,179.880	
WABTEC CORP	5,411	74.420	402,686.620	
TJX COMPANIES INC	34,250	60.750	2,080,687.500	
WATERS CORP	2,050	231.300	474,165.000	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,800	89.360	160,848.000	
ALLERGAN PLC	9,157	190.630	1,745,598.910	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,650	253.440	418,176.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	22,000	57.090	1,255,980.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,723	201.230	749,179.290	
WESTERN DIGITAL CORP	8,400	57.240	480,816.000	
WEC ENERGY GROUP INC	9,080	91.090	827,097.200	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	14,600	59.250	865,050.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	48,950	185.520	9,081,204.000	
PPL CORP	21,100	35.970	758,967.000	
PULTEGROUP INC	7,500	39.550	296,625.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,750	133.100	898,425.000	
NORTHERN TRUST CORP	6,000	108.760	652,560.000	
NVIDIA CORP	16,300	228.290	3,721,127.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,350	223.240	524,614.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12,743	160.360	2,043,467.480	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,300	39.940	211,682.000	
TYSON FOODS INC-CL A	8,300	90.380	750,154.000	
NETFLIX INC	12,320	315.480	3,886,713.600	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	11,300	319.790	3,613,627.000	
NRG ENERGY INC	7,950	39.590	314,740.500	
GLOBE LIFE INC	2,925	106.450	311,366.250	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,850	117.430	569,535.500	
TEXTRON INC	6,850	44.440	304,414.000	
NEWS CORP - CLASS A	11,737	13.790	161,853.230	
OGE ENERGY CORP	5,950	43.670	259,836.500	
OMNICOM GROUP	6,400	81.010	518,464.000	
ORACLE CORP	67,683	52.840	3,576,369.720	
MASTERCARD INC - A	25,500	296.000	7,548,000.000	
ONEOK INC	11,900	73.360	872,984.000	
CENTURYLINK INC	29,452	13.130	386,704.760	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,020	353.190	1,066,633.800	
YUM! BRANDS INC	8,950	99.620	891,599.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	3,050	122.570	373,838.500	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,330	109.830	146,073.900	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,650	52.450	296,342.500	

NOBLE ENERGY INC	14,550	22.700	330,285.000	
BANK OF AMERICA CORP	255,401	35.040	8,949,251.040	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,050	344.300	361,515.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,250	83.380	437,745.000	
NORDSTROM INC	3,000	39.290	117,870.000	
AMERICAN EXPRESS CO	20,000	124.950	2,499,000.000	
ANALOG DEVICES INC	10,649	118.820	1,265,314.180	
ADVANCED MICRO DEVICES	29,100	42.770	1,244,607.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,300	51.550	427,865.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	24,522	51.790	1,269,994.380	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,150	113.100	582,465.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,950	127.050	628,897.500	
AVERY DENNISON CORP	2,500	130.660	326,650.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	16,500	61.760	1,019,040.000	
EMERSON ELECTRIC CO	17,400	76.150	1,325,010.000	
AON PLC	6,970	207.600	1,446,972.000	
AMGEN INC	17,300	242.840	4,201,132.000	
TAPESTRY INC	8,350	25.510	213,008.500	
EATON CORP PLC	12,136	94.230	1,143,575.280	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,680	183.120	857,001.600	
APPLIED MATERIALS INC	27,200	60.790	1,653,488.000	
CME GROUP INC	10,100	203.570	2,056,057.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,694	23.730	277,498.620	
ECOLAB INC	7,550	186.900	1,411,095.000	
EQUIFAX INC	3,350	136.160	456,136.000	
GAP INC/THE	5,950	17.320	103,054.000	
GILEAD SCIENCES INC	35,950	66.200	2,379,890.000	
HORMEL FOODS CORP	8,350	44.500	371,575.000	
STATE STREET CORP	10,943	80.330	879,051.190	
SCHWAB (CHARLES) CORP	34,000	49.490	1,682,660.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,600	83.250	1,132,200.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,850	47.760	231,636.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,850	72.500	279,125.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,000	51.570	464,130.000	
FEDEX CORP	6,900	163.230	1,126,287.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,504	104.340	1,409,007.360	
FMC CORP	3,950	100.920	398,634.000	
FLEX LTD	14,750	12.650	186,587.500	

CERNER CORP	9,350	71.610	669,553.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,024	121.080	366,145.920	
CITRIX SYSTEMS INC	3,700	111.210	411,477.000	
INTEL CORP	126,650	57.300	7,257,045.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,500	22.550	259,325.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10,350	60.890	630,211.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	9,450	177.800	1,680,210.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	46,100	6.990	322,239.000	
ILLUMINA INC	4,040	323.450	1,306,738.000	
SEALED AIR CORP	4,400	38.950	171,380.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,210	593.720	1,905,841.200	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,450	111.000	382,950.000	
SNAP-ON INC	1,550	171.850	266,367.500	
CARMAX INC	4,950	98.900	489,555.000	
COMERICA INC	4,500	72.760	327,420.000	
INGREDION INC	1,900	89.430	169,917.000	
DUKE ENERGY CORP	20,528	90.550	1,858,810.400	
TARGET CORP	14,400	128.380	1,848,672.000	
DOVER CORP	4,250	114.260	485,605.000	
WW GRAINGER INC	1,400	331.480	464,072.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,950	89.440	353,288.000	
CINTAS CORP	2,620	260.760	683,191.200	
CONAGRA BRANDS INC	13,800	29.190	402,822.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,100	84.090	344,769.000	
CLOROX COMPANY	3,750	150.080	562,800.000	
ENTERGY CORP	5,400	118.820	641,628.000	
MICROSOFT CORP	205,650	154.690	31,811,998.500	
INCYTE CORP	5,350	91.310	488,508.500	
CVS HEALTH CORP	36,769	73.350	2,697,006.150	
MEDTRONIC PLC	37,938	114.350	4,338,210.300	
MICRON TECHNOLOGY INC	31,200	53.000	1,653,600.000	
BLACKROCK INC	3,200	502.290	1,607,328.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	14,900	26.410	393,509.000	
HASBRO INC	3,600	102.890	370,404.000	
KELLOGG CO	7,300	66.100	482,530.000	
KEYCORP	29,900	20.360	608,764.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,000	154.040	462,120.000	

MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	40,661	54.090	2,199,353.490	
KOHLS CORP	4,950	50.460	249,777.000	
COOPER COS INC/THE	1,400	318.270	445,578.000	
APACHE CORP	10,610	22.470	238,406.700	
CHUBB LTD	12,949	156.200	2,022,633.800	
ARROW ELECTRONICS INC	2,400	84.610	203,064.000	
ALLSTATE CORP	9,600	109.850	1,054,560.000	
EBAY INC	23,350	35.900	838,265.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	31,500	108.460	3,416,490.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	4,150	79.400	329,510.000	
XILINX INC	7,150	96.000	686,400.000	
DISH NETWORK CORP-A	6,450	34.470	222,331.500	
ZIONS BANCORP NA	5,200	51.510	267,852.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,100	202.430	1,234,823.000	
TRIMBLE INC	7,050	40.150	283,057.500	
LENNAR CORP-A	8,100	57.210	463,401.000	
LEAR CORP	1,800	141.500	254,700.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,000	45.700	319,900.000	
PROGRESSIVE CORP	16,800	72.000	1,209,600.000	
PACCAR INC	10,037	82.150	824,539.550	
PVH CORP	2,000	105.370	210,740.000	
BIOGEN INC	5,610	297.110	1,666,787.100	
IDEXX LABORATORIES INC	2,520	257.170	648,068.400	
STARBUCKS CORP	34,250	88.130	3,018,452.500	
PTC INC	3,150	73.770	232,375.500	
PERRIGO CO PLC	3,800	53.990	205,162.000	
EVERSOURCE ENERGY	8,880	82.800	735,264.000	
INTUIT INC	7,340	260.400	1,911,336.000	
BORGWARNER INC	6,300	44.630	281,169.000	
BEST BUY CO INC	6,900	86.360	595,884.000	
BALL CORP	9,184	64.190	589,520.960	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	39,297	44.750	1,758,540.750	
ELECTRONIC ARTS INC	8,650	105.750	914,737.500	
VULCAN MATERIALS CO	3,650	143.030	522,059.500	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,250	217.620	1,577,745.000	
VF CORP	9,500	95.020	902,690.000	
VIACOMCBS INC - CLASS B	16,075	40.280	647,501.000	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,720	135.310	232,733.200	

	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,600	142.810	371,306.000	
	CARNIVAL CORP	11,850	47.200	559,320.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	128,190	43.390	5,562,164.100	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,700	30.920	207,164.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,700	54.890	367,763.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	5.870	52,830.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	35,300	5.520	194,856.000	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 775,039,929.850 (84,897,873,916)	
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	9.818	135,458.940	
	BP PLC	575,000	4.788	2,753,387.500	
	UNILEVER PLC	31,760	42.990	1,365,362.400	
	BARCLAYS PLC	496,800	1.873	930,804.480	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	52,700	6.900	363,630.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	56,100	2.190	122,859.000	
	PRUDENTIAL PLC	75,700	14.455	1,094,243.500	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	145,791	2.533	369,288.600	
	EVRAZ PLC	15,000	3.971	59,565.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,064	29.780	180,585.920	
	BAE SYSTEMS PLC	94,300	5.676	535,246.800	
	AVIVA PLC	113,866	4.259	484,955.290	
	AVEVA GROUP PLC	2,000	45.820	91,640.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	141,000	17.782	2,507,262.000	
	INFORMA PLC	36,200	8.242	298,360.400	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	10,540	10.700	112,778.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	145,500	2.373	345,271.500	
	AUTO TRADER GROUP PLC	28,300	5.956	168,554.800	
	DCC PLC	2,800	66.160	185,248.000	
	OCADO GROUP PLC	13,500	12.380	167,130.000	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,100	90.300	189,630.000	
	HALMA PLC	11,000	21.640	238,040.000	
	GVC HOLDINGS PLC	16,700	8.782	146,659.400	
	NMC HEALTH PLC	2,700	17.475	47,182.500	
	JD SPORTS FASHION PLC	13,000	8.210	106,730.000	
	M&G PLC	75,700	2.352	178,046.400	

RELX PLC	55,546	18.875	1,048,430.750	
DIAGEO PLC	67,500	31.550	2,129,625.000	
RIO TINTO PLC	32,250	44.565	1,437,221.250	
STANDARD CHARTERED PLC	82,100	7.294	598,837.400	
TESCO PLC	281,700	2.533	713,546.100	
SMITH & NEPHEW PLC	26,450	18.050	477,422.500	
GLENCORE PLC	324,525	2.322	753,547.050	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	8,150	20.400	166,260.000	
SMITHS GROUP PLC	11,383	17.045	194,023.230	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	41,983	3.177	133,379.990	
PEARSON PLC	23,563	6.440	151,745.720	
SAINSBURY (J) PLC	54,225	2.300	124,717.500	
NEXT PLC	4,200	72.840	305,928.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	93,200	1.959	182,578.800	
WHITBREAD PLC	3,861	49.330	190,463.130	
BUNZL PLC	9,605	20.730	199,111.650	
VODAFONE GROUP PLC	766,183	1.492	1,143,757.980	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,661	49.200	180,121.200	
KINGFISHER PLC	62,411	2.193	136,867.320	
WPP PLC	38,400	10.365	398,016.000	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	20,627	9.526	196,492.800	
SEVERN TRENT PLC	7,133	25.230	179,965.590	
RENTOKIL INITIAL PLC	54,000	4.473	241,542.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	20,300	60.210	1,222,263.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	15,150	11.895	180,209.250	
SCHRODERS PLC	3,450	33.790	116,575.500	
SSE PLC	30,000	14.505	435,150.000	
WEIR GROUP PLC/THE	7,950	15.560	123,702.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	31,000	7.598	235,538.000	
ASTRAZENECA PLC	37,050	74.500	2,760,225.000	
FERGUSON PLC	7,087	69.700	493,963.900	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	183,000	3.143	575,169.000	
3I GROUP PLC	29,391	11.045	324,623.590	
ASHTEAD GROUP PLC	13,650	23.680	323,232.000	
SAGE GROUP PLC/THE	32,314	7.464	241,191.690	
NATIONAL GRID PLC	98,134	9.492	931,487.920	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,081,465	0.633	1,317,567.340	
RSA INSURANCE GROUP PLC	31,760	5.664	179,888.640	
IMPERIAL BRANDS PLC	28,800	17.742	510,969.600	

	CENTRICA PLC	176,160	0.901	158,861.080	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,600	50.820	182,952.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	65,010	31.995	2,079,994.950	
	BHP GROUP PLC	60,527	17.958	1,086,943.860	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,600	25.670	272,102.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	571,650	5.936	3,393,314.400	
	ANGLO AMERICAN PLC	31,083	21.875	679,940.620	
	MONDI PLC	14,250	17.140	244,245.000	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	66,300	1.992	132,102.750	
	CARNIVAL PLC	4,861	33.520	162,940.720	
	EASYJET PLC	4,000	14.270	57,080.000	
	COMPASS GROUP PLC	46,489	18.690	868,879.410	
	PERSIMMON PLC	9,300	27.210	253,053.000	
	BT GROUP PLC	246,100	2.045	503,274.500	
	COCA-COLA HBC AG-DI	5,800	25.290	146,682.000	
	BURBERRY GROUP PLC	12,189	21.580	263,038.620	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	5,136	50.790	260,857.440	
	INTERTEK GROUP PLC	4,800	57.400	275,520.000	
	ITV PLC	102,100	1.520	155,243.050	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	9,199	74.360	684,037.640	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	123,300	22.330	2,753,289.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	105,718	22.290	2,356,454.220	
	MEGGITT PLC	24,100	6.598	159,011.800	
	G4S PLC	43,500	2.136	92,916.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,550	22.770	126,373.500	
	ANTOFAGASTA PLC	11,400	9.474	108,003.600	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	3.243	229,805.460	
	EXPERIAN PLC	26,154	25.280	661,173.120	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 52,781,367.560 (7,585,210,332)	
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	15.990	551,655.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	257.200	257,200.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	17,600	15.990	281,424.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	568.500	341,100.000	

	BANK HAPOALIM BM	30,700	27.930	857,451.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	45,200	24.730	1,117,796.000	
	NICE LTD	1,850	543.400	1,005,290.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,100	93.560	383,596.000	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 4,795,512.000 (150,483,166)	
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	3.360	264,768.000	
	BHP GROUP LTD	83,650	40.200	3,362,730.000	
	SOUTH32 LTD	151,600	2.880	436,608.000	
	ALUMINA LTD	69,300	2.380	164,934.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	26,650	35.230	938,879.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	42,500	10.830	460,275.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	13,300	9.890	131,537.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	79,450	25.470	2,023,591.500	
	WESTPAC BANKING CORP	97,348	24.640	2,398,654.720	
	SANTOS LTD	53,100	8.400	446,040.000	
	AUSNET SERVICES	50,000	1.745	87,250.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	79,850	25.080	2,002,638.000	
	RIO TINTO LTD	10,500	103.300	1,084,650.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	53,500	8.780	469,730.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	5.380	322,800.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	22.640	76,976.000	
	COLES GROUP LTD	34,545	15.320	529,229.400	
	WISETECH GLOBAL LTD	4,500	23.400	105,300.000	
	OIL SEARCH LTD	38,400	7.310	280,704.000	
	SEEK LTD	9,600	23.310	223,776.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	20,500	16.690	342,145.000	
	NEWCREST MINING LTD	23,400	28.200	659,880.000	
	INCITEC PIVOT LTD	49,800	3.290	163,842.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	50,150	81.900	4,107,285.000	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	7,150	34.350	245,602.500	
	ORICA LTD	11,500	23.330	268,295.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	38,450	13.280	510,616.000	
	CIMIC GROUP LTD	2,800	34.950	97,860.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	36,200	37.540	1,358,948.000	

	COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	11.310	154,947.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	57,700	4.740	273,498.000	
	CROWN RESORTS LTD	11,600	12.400	143,840.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	24,000	7.280	174,720.000	
	TELSTRA CORP LTD	120,200	3.710	445,942.000	
	AMP LTD	102,000	1.930	196,860.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	13,350	28.140	375,669.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	9,184	138.100	1,268,310.400	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	17,450	35.240	614,938.000	
	CSL LTD	12,750	284.720	3,630,180.000	
	WESFARMERS LTD	32,300	41.780	1,349,494.000	
	COCHLEAR LTD	1,650	231.390	381,793.500	
	BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	15.580	253,954.000	
	SUNCORP GROUP LTD	38,257	13.340	510,348.380	
	BORAL LTD	35,800	4.530	162,174.000	
	ASX LTD	5,800	82.350	477,630.000	
	COMPUTERSHARE LTD	13,900	17.380	241,582.000	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	4.220	59,080.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	70,936	8.100	574,581.600	
	SONIC HEALTHCARE LTD	13,250	29.380	389,285.000	
	CHALLENGER LTD	17,400	8.360	145,464.000	
	WORLEY LTD	9,400	15.660	147,204.000	
	AGL ENERGY LTD	19,000	20.850	396,150.000	
	BRAMBLES LTD	47,400	12.360	585,864.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	44.860	62,804.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,250	73.200	311,100.000	
	TPG TELECOM LTD	8,700	6.980	60,726.000	
	REA GROUP LTD	1,600	108.090	172,944.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	3,800	56.260	213,788.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 37,340,415.500 (2,801,277,972)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	8,300	33.400	277,220.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	600	1,249.360	749,616.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,996	15.200	91,139.200	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	7,187	85.800	616,644.600	

WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13,200	36.100	476,520.000	
INTACT FINANCIAL CORP	4,050	139.070	563,233.500	
BCE INC	4,530	61.510	278,640.300	
FRANCO-NEVADA CORP	5,700	127.470	726,579.000	
SUNCOR ENERGY INC	44,430	42.490	1,887,830.700	
METRO INC/CN	7,700	55.600	428,120.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	9,500	72.140	685,330.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	34,600	74.480	2,577,008.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	12,550	110.270	1,383,888.500	
TORONTO-DOMINION BANK	51,600	74.720	3,855,552.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	8,300	33.520	278,216.000	
ROYAL BANK OF CANADA	40,550	104.750	4,247,612.500	
TC ENERGY CORP	26,150	68.520	1,791,798.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	14,629	48.210	705,264.090	
BOMBARDIER INC-B	62,800	1.900	119,320.000	
BARRICK GOLD CORP	51,400	22.900	1,177,060.000	
CAE INC	7,900	34.320	271,128.000	
THOMSON REUTERS CORP	5,812	95.800	556,789.600	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,300	31.470	166,791.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	57.160	91,456.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,650	56.870	264,445.500	
HYDRO ONE LTD	9,200	25.560	235,152.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	69.300	378,378.000	
WSP GLOBAL INC	3,000	89.840	269,520.000	
PARKLAND FUEL CORP	4,400	47.860	210,584.000	
QUEBECOR INC -CL B	5,300	32.900	174,370.000	
EMERA INC	7,200	54.900	395,280.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,000	39.640	158,560.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	10,600	63.660	674,796.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	7,200	77.780	560,016.000	
STARS GROUP INC/THE	6,300	32.070	202,041.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	15,000	18.610	279,150.000	
AIR CANADA	4,100	50.330	206,353.000	
KINROSS GOLD CORP	37,900	5.540	209,966.000	
BANK OF MONTREAL	18,000	102.000	1,836,000.000	
POWER CORP OF CANADA	9,400	33.900	318,660.000	
METHANEX CORP	1,700	51.020	86,734.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	2,800	510.850	1,430,380.000	

NUTRIEN LTD	16,519	63.830	1,054,407.770	
AURORA CANNABIS INC	19,800	3.080	60,984.000	
CANOPY GROWTH CORP	6,200	27.180	168,516.000	
CRONOS GROUP INC	5,500	9.160	50,380.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,800	54.970	318,826.000	
CAMECO CORP	10,600	11.490	121,794.000	
TELUS CORP	5,400	50.180	270,972.000	
POWER FINANCIAL CORP	8,000	35.620	284,960.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	15,100	22.700	342,770.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	143.560	258,408.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	35,100	40.550	1,423,305.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	800	602.110	481,688.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,200	73.930	680,156.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,237	104.890	234,638.930	
BLACKBERRY LTD	16,000	7.510	120,160.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	17,450	59.530	1,038,798.500	
ENBRIDGE INC	57,100	50.720	2,896,112.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	23,950	76.310	1,827,624.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	56,000	25.930	1,452,080.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	9,500	38.820	368,790.000	
ENCANA CORP	36,800	5.930	218,224.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,900	336.190	1,311,141.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,300	69.760	230,208.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,300	38.120	240,156.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	20,450	119.580	2,445,411.000	
CGI INC - CLASS A	7,300	109.410	798,693.000	
HUSKY ENERGY INC	9,358	10.230	95,732.340	
ONEX CORPORATION	2,600	82.100	213,460.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,800	26.550	366,390.000	
IGM FINANCIAL INC	2,400	38.390	92,136.000	
OPEN TEXT CORP	8,100	57.540	466,074.000	
CI FINANCIAL CORP	7,000	21.910	153,370.000	
SAPUTO INC	7,100	40.100	284,710.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	13.740	265,182.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	25,600	42.920	1,098,752.000	
FORTIS INC	13,000	54.190	704,470.000	
LUNDIN MINING CORP	19,400	7.670	148,798.000	

	CENOVUS ENERGY INC	31,400	12.990	407,886.000	
	DOLLARAMA INC	9,000	44.080	396,720.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,200	50.030	110,066.000	
	ALTAGAS LTD	7,900	19.780	156,262.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,800	20.850	100,080.000	
	KEYERA CORP	6,000	33.890	203,340.000	
	INTER PIPELINE LTD	12,800	22.350	286,080.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 56,141,854.530 (4,672,125,134)	
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	26.240	913,152.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	49,700	25.660	1,275,302.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	14,970	9.120	136,526.400	
	KEPPEL CORP LTD	42,900	6.720	288,288.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	8.030	112,420.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	13,600	10.750	146,200.000	
	CAPITALAND LTD	77,500	3.670	284,425.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	69,300	1.070	74,151.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	51,400	2.120	108,968.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	30.830	83,241.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	93,700	10.890	1,020,393.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	170,000	0.935	158,950.000	
	VENTURE CORP LTD	8,600	16.260	139,836.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	225,450	3.380	762,021.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	44,000	3.940	173,360.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	28,800	2.240	64,512.000	
	SATS LTD	19,600	5.140	100,744.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	23,300	8.980	209,234.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	64,800	2.400	155,520.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	58,900	4.080	240,312.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 6,447,555.400 (521,091,427)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	

DUFRY AG-REG	1,250	96.680	120,850.000	
UBS GROUP AG-REG	110,400	12.315	1,359,576.000	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	230	626.500	144,095.000	
ADECCO GROUP AG-REG	4,650	61.900	287,835.000	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	19,940	303.750	6,056,775.000	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,100	81.650	89,815.000	
SIKA AG-REG	3,840	178.850	686,784.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	83,900.000	251,700.000	
ABB LTD-REG	53,800	23.570	1,268,066.000	
SWISS RE AG	9,000	108.950	980,550.000	
NESTLE SA-REG	86,900	103.560	8,999,364.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	520	874.200	454,584.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,260	252.800	318,528.000	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	75,170	13.430	1,009,533.100	
JULIUS BAER GROUP LTD	6,400	49.780	318,592.000	
SGS SA-REG	160	2,611.000	417,760.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	580	243.000	140,940.000	
VIFOR PHARMA AG	1,300	176.750	229,775.000	
TEMENOS AG - REG	1,970	152.900	301,213.000	
ALCON INC	12,430	55.350	688,000.500	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	850	274.600	233,410.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,472	400.100	1,789,247.200	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	175.600	244,084.000	
CLARIANT AG-REG	5,700	21.030	119,871.000	
NOVARTIS AG-REG	61,050	91.870	5,608,663.500	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	70	2,110.000	147,700.000	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	15,310	75.700	1,158,967.000	
SWISSCOM AG-REG	770	519.200	399,784.000	
GEBERIT AG-REG	1,130	543.600	614,268.000	
GIVAUDAN-REG	260	2,951.000	767,260.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	945.400	274,166.000	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,690	218.300	368,927.000	
LONZA GROUP AG-REG	2,200	347.700	764,940.000	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	51.650	78,508.000	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	14,290	53.060	758,227.400	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,040	495.800	515,632.000	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,670	162.350	271,124.500	

	SWISS PRIME SITE-REG	2,330	107.700	250,941.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	7,375.000	250,750.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 38,740,806.200 (4,329,285,093)	
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	429.300	1,159,110.000	
	ERICSSON LM-B SHS	85,630	86.940	7,444,672.200	
	VOLVO AB-B SHS	41,400	150.100	6,214,140.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,800	447.200	804,960.000	
	SKF AB-B SHARES	10,550	197.700	2,085,735.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,650	232.800	1,548,120.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,900	475.200	2,328,480.000	
	TELE2 AB-B SHS	15,600	140.300	2,188,680.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	48,250	89.000	4,294,250.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	46,550	102.450	4,769,047.500	
	SWEDBANK AB - A SHARES	26,600	132.750	3,531,150.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	23,550	191.800	4,516,890.000	
	SKANSKA AB-B SHS	10,250	211.800	2,170,950.000	
	SANDVIK AB	33,150	190.350	6,310,102.500	
	INVESTOR AB-B SHS	12,700	519.200	6,593,840.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	18,450	386.300	7,127,235.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,550	163.850	1,564,767.500	
	TELIA CO AB	83,000	41.300	3,427,900.000	
	ALFA LAVAL AB	8,800	237.900	2,093,520.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	11,250	336.900	3,790,125.000	
	ASSA ABLOY AB-B	29,350	220.900	6,483,415.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,200	405.800	892,760.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,250	312.200	1,639,050.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	16,850	299.800	5,051,630.000	
	BOLIDEN AB	7,800	256.000	1,996,800.000	
	EPIROC AB-A	20,650	117.400	2,424,310.000	
	EPIROC AB-B	11,600	114.500	1,328,200.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,450	76.020	870,429.000	
	NORDEA BANK ABP	89,700	74.500	6,682,650.000	
	KINNEVIK AB - B	7,300	229.000	1,671,700.000	
	HEXAGON AB-B SHS	7,200	541.000	3,895,200.000	

	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,600	227.200	1,045,120.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 107,944,938.700 (1,258,637,985)	
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	390.100	19,739,060.000	
	DANSKE BANK A/S	18,400	108.050	1,988,120.000	
	ISS A/S	4,400	160.750	707,300.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	9,335.000	886,825.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	258.900	440,130.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,600	690.600	3,867,360.000	
	CARLSBERG AS-B	3,000	975.800	2,927,400.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,400	321.500	2,057,600.000	
	COLOPLAST-B	3,350	813.800	2,726,230.000	
	DSV PANALPINA A/S	6,210	769.000	4,775,490.000	
	DEMANT A/S	3,425	214.600	735,005.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	200	9,974.000	1,994,800.000	
	TRYG A/S	3,300	198.200	654,060.000	
	PANDORA A/S	3,150	277.000	872,550.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,050	528.000	1,610,400.000	
	GENMAB A/S	1,950	1,490.500	2,906,475.000	
	ORSTED A/S	5,500	666.000	3,663,000.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 52,551,805.000 (858,696,493)	
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	4.860	167,670.000	
	MERCURY NZ LTD	23,000	4.795	110,285.000	
	A2 MILK CO LTD	21,400	15.200	325,280.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	4.245	223,664.800	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	29,400	8.810	259,014.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	5.300	106,530.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	18,700	21.800	407,660.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	11,800	15.900	187,620.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 1,787,723.800 (128,537,341)	

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	32.980	1,375,266.000	
	DNB ASA	28,100	157.600	4,428,560.000	
	ORKLA ASA	21,950	87.820	1,927,649.000	
	TELENOR ASA	20,800	160.250	3,333,200.000	
	EQUINOR ASA	27,973	171.950	4,809,957.350	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,960	354.700	1,759,312.000	
	MOWI ASA	12,850	224.100	2,879,685.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	5,550	183.950	1,020,922.500	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,100	241.800	749,580.000	
	AKER BP ASA	2,900	279.300	809,970.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 23,094,101.850 (280,362,396)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	26,820	70.060	1,879,009.200	
	EVONIK INDUSTRIES AG	5,300	26.820	142,146.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	59,350	6.989	414,797.150	
	COMMERZBANK AG	28,135	5.581	157,021.430	
	VOLKSWAGEN AG	890	177.800	158,242.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	5,270	181.100	954,397.000	
	SIEMENS AG-REG	21,750	118.240	2,571,720.000	
	E.ON SE	64,200	9.676	621,199.200	
	UNIPER SE	5,950	29.850	177,607.500	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,850	74.990	738,651.500	
	GEA GROUP AG	4,500	29.410	132,345.000	
	CONTINENTAL AG	3,170	120.860	383,126.200	
	BASF SE	26,170	67.250	1,759,932.500	
	ALLIANZ SE-REG	12,040	222.600	2,680,104.000	
	THYSSENKRUPP AG	11,450	12.035	137,800.750	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,200	90.940	472,888.000	
	RWE AG	16,250	26.460	429,975.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,650	16.900	112,385.000	
	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	77.000	90,860.000	
	BRENNTAG AG	4,700	49.020	230,394.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	12,200	50.000	610,000.000	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	29.620	98,338.400	

HOCHTIEF AG	710	116.400	82,644.000	
SAP SE	27,992	120.560	3,374,715.520	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,160	267.300	1,111,968.000	
ZALANDO SE	3,550	43.720	155,206.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	4,500	67.160	302,220.000	
KION GROUP AG	1,850	65.460	121,101.000	
WIRECARD AG	3,470	104.900	364,003.000	
COVESTRO AG	5,200	41.960	218,192.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,050	190.300	199,815.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	4,650	68.080	316,572.000	
DELIVERY HERO SE	3,200	65.000	208,000.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	115.600	144,500.000	
METRO AG	5,000	13.950	69,750.000	
AROUNDTOWN SA	27,100	7.844	212,572.400	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,500	42.300	190,350.000	
KNORR-BREMSE AG	1,450	88.630	128,513.500	
BEIERSDORF AG	3,090	102.950	318,115.500	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,950	43.000	83,850.000	
MERCK KGAA	3,750	104.250	390,937.500	
ADIDAS AG	5,120	286.900	1,468,928.000	
PUMA SE	2,360	67.550	159,418.000	
HENKEL AG & CO KGAA	3,100	83.650	259,315.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	95,950	14.860	1,425,817.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,270	64.760	406,045.200	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	26,100	51.050	1,332,405.000	
QIAGEN N.V.	6,498	36.980	240,296.040	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	37,150	20.720	769,748.000	
HANNOVER RUECK SE	1,730	175.200	303,096.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	29,200	34.790	1,015,868.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,640	140.050	789,882.000	
LANXESS AG	2,500	60.840	152,100.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,530	249.800	382,194.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	10,600	35.870	380,222.000	
SYMRISE AG	3,920	89.520	350,918.400	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	26,300	2.669	70,194.700	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,550	56.600	87,730.000	

VONOVIA SE	15,300	46.640	713,592.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	26,426	43.245	1,142,792.370	
NN GROUP NV	9,050	34.950	316,297.500	
ARCELORMITTAL	20,300	16.358	332,067.400	
HEINEKEN NV	7,600	94.580	718,808.000	
AEGON NV	53,644	4.214	226,055.810	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	33,633	22.340	751,361.220	
AKZO NOBEL N.V.	6,538	89.850	587,439.300	
KONINKLIJKE DSM NV	5,300	116.300	616,390.000	
WOLTERS KLUWER	8,300	63.980	531,034.000	
ING GROEP NV	111,050	10.890	1,209,334.500	
KONINKLIJKE KPN NV	100,950	2.632	265,700.400	
ASML HOLDING NV	12,060	263.000	3,171,780.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	11,700	16.355	191,353.500	
GALAPAGOS NV	1,300	190.750	247,975.000	
ADYEN NV	300	721.200	216,360.000	
UNILEVER NV	41,600	51.450	2,140,320.000	
PROSUS NV	14,500	64.830	940,035.000	
VOPAK	1,900	47.800	90,820.000	
RANDSTAD NV	3,200	54.900	175,680.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,400	86.650	294,610.000	
ALTICE EUROPE NV	20,500	5.600	114,800.000	
JCDECAUX SA	1,900	27.080	51,452.000	
TOTAL SA	67,950	48.785	3,314,940.750	
MICHELIN (CGDE)	5,000	112.600	563,000.000	
AIR LIQUIDE SA	13,477	124.350	1,675,864.950	
KERING	2,180	573.800	1,250,884.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	15,650	92.260	1,443,869.000	
BOUYGUES SA	6,700	38.560	258,352.000	
BNP PARIBAS	32,050	53.080	1,701,214.000	
PEUGEOT SA	17,550	22.110	388,030.500	
NATIXIS	29,550	3.958	116,958.900	
THALES SA	3,230	89.940	290,506.200	
DANONE	17,600	73.080	1,286,208.000	
CARREFOUR SA	17,000	15.015	255,255.000	
SUEZ	9,925	13.645	135,426.620	
VIVENDI	26,891	25.400	683,031.400	
L'OREAL	7,170	256.000	1,835,520.000	

COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	14,550	37.855	550,790.250	
LEGRAND SA	8,017	73.900	592,456.300	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	43.230	67,006.500	
PERNOD RICARD SA	6,087	160.300	975,746.100	
EURAZEO SE	1,254	61.750	77,434.500	
SOCIETE GENERALE SA	22,050	30.755	678,147.750	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,930	402.650	3,193,014.500	
ACCOR SA	5,350	42.250	226,037.500	
CAPGEMINI SE	4,770	108.900	519,453.000	
VALEO SA	7,150	32.700	233,805.000	
PUBLICIS GROUPE	6,400	39.590	253,376.000	
BUREAU VERITAS SA	8,800	23.660	208,208.000	
EIFFAGE	2,340	101.600	237,744.000	
SODEXO SA	2,700	105.600	285,120.000	
IPSEN	1,150	79.900	91,885.000	
INGENICO GROUP	1,800	95.200	171,360.000	
AMUNDI SA	1,700	69.500	118,150.000	
TELEPERFORMANCE	1,770	218.800	387,276.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,450	60.340	147,833.000	
FAURECIA	2,250	50.640	113,940.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	320	495.800	158,656.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	800	144.500	115,600.000	
SEB SA	650	133.500	86,775.000	
ESSILORLUXOTTICA	8,300	140.500	1,166,150.000	
DASSAULT AVIATION SA	80	1,138.000	91,040.000	
WORLDLINE SA	2,364	62.150	146,922.600	
AXA SA	55,350	25.060	1,387,071.000	
EDENRED	6,900	45.870	316,503.000	
RENAULT SA	5,800	43.600	252,880.000	
HERMES INTERNATIONAL	900	668.800	601,920.000	
STMICROELECTRONICS NV	19,950	24.340	485,583.000	
REMY COINTREAU	630	113.600	71,568.000	
ATOS SE	2,960	74.720	221,171.200	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,980	143.950	572,921.000	
WENDEL	780	122.500	95,550.000	
ORANGE	58,300	13.445	783,843.500	
ALSTOM	4,450	41.970	186,766.500	
CNP ASSURANCES	4,850	18.000	87,300.000	

SANOFI	31,875	89.600	2,856,000.000	
VINCI SA	14,550	98.880	1,438,704.000	
AIRBUS SE	16,550	131.500	2,176,325.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	16,450	23.840	392,168.000	
CREDIT AGRICOLE SA	34,300	13.125	450,187.500	
BIOMERIEUX	1,150	80.400	92,460.000	
ENGIE	52,123	14.730	767,771.790	
EDF	17,050	9.740	166,067.000	
SES	11,000	12.500	137,500.000	
SAFRAN SA	9,320	139.400	1,299,208.000	
ILIAD SA	740	115.050	85,137.000	
ARKEMA	1,920	93.720	179,942.400	
ADP	910	177.000	161,070.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,700	15.060	70,782.000	
SCOR SE	4,950	37.930	187,753.500	
GETLINK SE	12,400	15.610	193,564.000	
BOLLORE	24,100	3.968	95,628.800	
UCB SA	3,550	72.440	257,162.000	
KBC GROUP NV	7,450	67.520	503,024.000	
COLRUYT SA	1,600	46.940	75,104.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,200	94.200	207,240.000	
SOLVAY SA	2,200	101.550	223,410.000	
UMICORE	5,800	42.350	245,630.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	21,600	71.230	1,538,568.000	
AGEAS	5,240	54.420	285,160.800	
PROXIMUS	4,100	25.640	105,124.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	38.960	56,492.000	
PRYSMIAN SPA	6,850	21.660	148,371.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	31,543	18.510	583,860.930	
MEDIOBANCA SPA	17,065	10.075	171,929.870	
TENARIS SA	13,300	10.145	134,928.500	
UNICREDIT SPA	57,656	13.236	763,134.810	
TELECOM ITALIA SPA	262,982	0.556	146,217.990	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.544	93,609.580	
INTESA SANPAOLO	426,237	2.363	1,007,198.030	
ATLANTIA SPA	14,657	22.000	322,454.000	
POSTE ITALIANE SPA	16,000	10.165	162,640.000	
MONCLER SPA	5,150	40.440	208,266.000	
RECORDATI SPA	3,050	37.740	115,107.000	

ENI SPA	72,500	13.702	993,395.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	16,200	8.135	131,787.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	5.262	57,882.000	
LEONARDO SPA	10,975	10.595	116,280.120	
ENEL SPA	230,734	7.010	1,617,445.340	
SNAM SPA	61,600	4.568	281,388.800	
TERNA SPA	42,800	5.848	250,294.400	
EXOR NV	3,230	69.780	225,389.400	
CNH INDUSTRIAL NV	29,800	9.848	293,470.400	
FINECOBANK SPA	18,000	11.000	198,000.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	32,350	13.598	439,895.300	
FERRARI NV	3,495	149.800	523,551.000	
TELEFONICA SA	132,027	6.621	874,150.760	
ENDESA SA	9,250	24.550	227,087.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	191,012	5.048	964,228.570	
IBERDROLA SA	170,334	9.158	1,559,918.770	
BANCO DE SABADELL SA	160,109	1.078	172,597.500	
BANKINTER SA	18,300	6.658	121,841.400	
REPSOL SA	41,800	13.960	583,528.000	
GRIFOLS SA	8,500	31.470	267,495.000	
BANCO SANTANDER SA	477,250	3.765	1,797,084.870	
AMADEUS IT GROUP SA	12,350	73.140	903,279.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	22.910	215,354.000	
MAPFRE SA	30,650	2.465	75,552.250	
CAIXABANK SA	109,300	2.774	303,198.200	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	35.610	280,464.360	
AENA SME SA	2,000	175.000	350,000.000	
CELLNEX TELECOM SA	5,800	37.420	217,036.000	
REPSOL SA-RTS	41,800	0.419	17,514.200	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	32,300	31.030	1,002,269.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	6,650	15.525	103,241.250	
ENAGAS SA	6,900	22.600	155,940.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	12,550	17.735	222,574.250	
FERROVIAL SA	14,200	27.120	385,104.000	
BANKIA SA	30,105	1.871	56,326.450	

	UPM-KYMMENE OYJ	15,600	30.900	482,040.000	
	NOKIA OYJ	158,500	3.265	517,581.750	
	WARTSILA OYJ ABP	12,000	9.956	119,472.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	17,050	12.225	208,436.250	
	METSO OYJ	2,800	35.820	100,296.000	
	ELISA OYJ	4,150	48.660	201,939.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	12,500	38.220	477,750.000	
	FORTUM OYJ	13,850	22.000	304,700.000	
	KONE OYJ-B	9,900	58.100	575,190.000	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	3,650	25.480	93,002.000	
	NESTE OYJ	12,050	29.000	349,450.000	
	ORION OYJ-CLASS B	2,750	39.660	109,065.000	
	VERBUND AG	2,000	46.720	93,440.000	
	OMV AG	4,450	50.780	225,971.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	8,700	33.650	292,755.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	24.480	69,768.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	22.900	77,860.000	
	ANDRITZ AG	2,100	38.700	81,270.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,800	33.800	229,840.000	
	AIB GROUP PLC	23,000	3.132	72,036.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	27,460	4.910	134,828.600	
	KINGSPAN GROUP PLC	4,400	53.400	234,960.000	
	JERONIMO MARTINS	6,000	14.710	88,260.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	74,700	3.814	284,905.800	
	GALP ENERGIA SGPS SA	13,950	14.930	208,273.500	
	KERRY GROUP PLC-A	4,570	111.100	507,727.000	
	CRH PLC	23,100	35.580	821,898.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,200	104.600	230,120.000	
ユーロ　小計				ユーロ 120,024,566.600 (14,651,398,844)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	40,500	57.000	2,308,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	58.400	3,796,000.000	
	MTR CORP	45,500	46.050	2,095,275.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	45,500	115.800	5,268,900.000	
	SINO LAND CO	90,000	11.420	1,027,800.000	

	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	77,169	75.450	5,822,401.050	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	15,500	72.250	1,119,875.000	
	CLP HOLDINGS LTD	47,000	82.150	3,861,050.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	43,507	38.200	1,661,967.400	
	HONG KONG & CHINA GAS	290,199	15.220	4,416,828.780	
	HANG SENG BANK LTD	22,500	163.300	3,674,250.000	
	WHEELOCK & CO LTD	24,000	50.650	1,215,600.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	183,000	10.460	1,914,180.000	
	WH GROUP LTD	295,000	8.090	2,386,550.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	33,700	256.600	8,647,420.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	16.720	953,040.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	9,300	108.700	1,010,910.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	19,000	22.400	425,600.000	
	NWS HOLDINGS LTD	42,500	11.300	480,250.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	17,500	25.000	437,500.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	36,640	17.800	652,192.000	
	SJM HOLDINGS LTD	58,000	8.860	513,880.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	32,600	25.400	828,040.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	74,169	53.500	3,968,041.500	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20,000	56.500	1,130,000.000	
	PCCW LTD	117,000	4.650	544,050.000	
	AIA GROUP LTD	373,000	81.800	30,511,400.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	36,000	43.800	1,576,800.000	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	22,000	29.150	641,300.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	34,400	28.000	963,200.000	
	SANDS CHINA LTD	72,000	40.300	2,901,600.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	41,000	63.550	2,605,550.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	107,500	27.600	2,967,000.000	
	WYNN MACAU LTD	42,000	18.540	778,680.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 103,105,630.730 (1,450,696,224)	
合計				123,585,676,323 [123,585,676,323]	

(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	799,076.880	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	8,887	1,285,593.420	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,250	571,497.500	
		VORNADO REALTY TRUST	5,097	331,305.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,150	716,940.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	10,700	857,177.000	
		EQUINIX INC	2,288	1,275,605.760	
		AMERICAN TOWER CORP	12,450	2,638,528.500	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	21,943	402,434.620	
		KIMCO REALTY CORP	12,600	257,040.000	
		INVITATION HOMES INC	12,700	364,363.000	
		VICI PROPERTIES INC	13,500	335,475.000	
		VENTAS INC	10,500	586,215.000	
		WEYERHAEUSER CO	21,164	627,724.240	
		AGNC INVESTMENT CORP	15,300	269,586.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	11,750	1,564,512.500	
		IRON MOUNTAIN INC	8,210	257,711.900	
		VEREIT INC	29,300	267,509.000	
		SUN COMMUNITIES INC	2,750	410,300.000	
		PROLOGIS INC	17,812	1,555,165.720	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,070	475,543.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,900	303,137.000	
		DUKE REALTY CORP	10,200	347,412.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,950	577,570.500	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,200	279,752.000	
		WELLTOWER INC	11,450	886,230.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	14,350	459,630.500	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	4,400	259,028.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,250	416,260.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,800	330,720.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	43,700	417,335.000	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,550	233,415.000	
		REALTY INCOME CORP	8,900	638,397.000	
		PUBLIC STORAGE	4,370	896,898.800	
		REGENCY CENTERS CORP	4,950	304,326.000	
		SL GREEN REALTY CORP	2,400	213,648.000	
		UDR INC	8,100	370,251.000	

	WP CAREY INC	5,100	391,017.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,400	260,288.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	6,050	688,550.500	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,750	385,087.500	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	13,000	258,570.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 24,766,827.840 (2,712,958,321)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,662	209,211.590	
	SEGRO PLC	33,150	289,598.400	
	BRITISH LAND CO PLC	25,550	154,270.900	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 653,080.890 (93,854,254)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	17,000	332,180.000	
	TRANSURBAN GROUP	76,500	1,165,095.000	
	SYDNEY AIRPORT	33,300	295,038.000	
	APA GROUP	35,800	403,466.000	
	SCENTRE GROUP	153,922	589,521.260	
	DEXUS	33,150	400,783.500	
	GPT GROUP	56,160	326,851.200	
	MIRVAC GROUP	111,600	359,352.000	
	STOCKLAND	72,000	344,160.000	
	GOODMAN GROUP	50,100	698,394.000	
	VICINITY CENTRES	99,273	253,146.150	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 5,167,987.110 (387,702,393)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,100	64,995.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,400	127,656.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,700	77,108.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	125,678.000	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 395,437.000 (32,908,267)	

	シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	79,600	156,016.000	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	76,000	221,160.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	77,200	186,052.000	
		SUNTEC REIT	63,000	113,400.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	65,500	150,650.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 827,278.000 (66,860,608)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,950	550,827.500	
		ICADE	950	88,635.000	
		GECINA SA	1,400	218,400.000	
		KLEPIERRE	6,250	202,000.000	
		COVIVIO	1,270	126,174.500	
	ユーロ　小計			ユーロ 1,186,037.000 (144,779,536)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	62,500	4,943,750.000	
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	75,000	585,000.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	107,000	1,200,540.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 6,729,290.000 (94,681,111)	
投資証券　合計				3,533,744,490 [3,533,744,490]	
合計				3,533,744,490 [3,533,744,490]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）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　609銘柄 投資証券　42銘柄	96.9%	3.1%	69.0%

イギリス・ポンド	株式 93銘柄 投資証券 3銘柄	98.8%	1.2%	6.0%
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	87.8%	12.2%	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	88.6%	11.4%	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 236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	93.9%	6.1%	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。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年12月18日現在	2019年12月18日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	586,413,834	―
コール・ローン	2,456,291,131	7,385,182,832
投資証券 ※2	218,552,442,750	357,070,085,750
派生商品評価勘定	13,305,600	―
未収配当金	1,086,606,834	1,517,781,411

前払金	―	178,605,000
流動資産合計	222,695,060,149	366,151,654,993
資産合計	222,695,060,149	366,151,654,993
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	―	189,832,100
前受金	39,600,000	―
未払金	―	2,116,330,041
未払解約金	28,367,900	291,333,000
その他未払費用	12,811	―
流動負債合計	67,980,711	2,597,495,141
負債合計	67,980,711	2,597,495,141
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	83,618,179,092	112,579,310,877
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	139,008,900,346	250,974,848,975
元本等合計	222,627,079,438	363,554,159,852
純資産合計	222,627,079,438	363,554,159,852
負債純資産合計	222,695,060,149	366,151,654,993

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19日 至　2019年12月18日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	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、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、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2018年12月18日現在	2019年12月18日現在
1．※1　期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	93,103,935,587円	83,618,179,092円
期中追加設定元本額	7,997,501,780円	35,700,341,757円
期中一部解約元本額	17,483,258,275円	6,739,209,972円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	7,302,744,511円	5,907,694,824円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）	68,216,833,743円	96,435,527,079円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）	373,979,635円	312,440,932円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	28,858円	352,959円
ｉＦｒｅｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	126,035,282円	130,587,507円
ｉＦｒｅｅ　８資産バランス	515,506,552円	703,418,176円
ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	3,890,262,175円	5,121,995,518円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	2,733,692円	2,036,683円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	5,348,275円	5,120,846円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	1,385,927円	1,865,960円
ダイワ・ノーロード　Ｊ－ＲＥＩＴファンド	46,340,607円	84,721,097円
ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	1,007,319,809円	1,270,235,750円

	ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	389,109,116円	1,117,282,843円
	ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	382,869,897円	349,273,748円
	ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ	1,357,681,013円	1,136,756,955円
	計	83,618,179,092円	112,579,310,877円
2.	期末日における受益権の総数	83,618,179,092口	112,579,310,877口
3. ※2	差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　414,600,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　1,106,000,000円

（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19日 至　2019年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2019年12月18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12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	5,723,692,910	△1,983,707,427
合計	5,723,692,910	△1,983,707,427

（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19日から2018年12月18日まで、及び2019年9月18日から2019年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種　類	2018年12月18日 現在				2019年12月18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	(円)	(円)	(円)	うち	(円)	(円)

		1年超				1年超		
市場取引 不動産投信 指数先物取引 買　建	3,189,600,000	－	3,203,100,000	13,500,000	6,661,400,000	－	6,471,910,000	△189,490,000
合計	3,189,600,000	－	3,203,100,000	13,500,000	6,661,400,000	－	6,471,910,000	△189,490,000

（注）　1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2018年12月18日現在	2019年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.6624円	3.2293円
（1万口当たり純資産額）	(26,624円)	(32,293円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1)　株式

該当事項はありません。

(2)　株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	3,414	424,360,200	
	サンケイリアルエステート	4,819	601,411,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	11,050	7,414,550,000	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	42,661	4,957,208,200	
	森ヒルズリート	38,259	6,668,543,700	
	産業ファンド	42,766	6,876,772,800	
	アドバンス・レジデンス	31,539	10,660,182,000	

ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	20,695	4,172,112,000	
ＡＰＩ投資法人	16,663	8,881,379,000	
ＧＬＰ投資法人	82,822	11,106,430,200	
コンフォリア・レジデンシャル	13,845	4,686,532,500	
日本プロロジスリート	47,777	13,329,783,000	
星野リゾート・リート	5,060	2,848,780,000	
ＯＮＥリート投資法人	5,183	1,775,177,500	
イオンリート投資	35,887	5,200,026,300	
ヒューリックリート投資法	28,280	5,446,728,000	
日本リート投資法人	10,801	5,006,263,500	
インベスコ・オフィス・Ｊリート	213,635	4,526,925,650	
日本ヘルスケア投資法	1,612	332,072,000	
積水ハウス・リート投資	97,229	8,643,658,100	
トーセイ・リート投資法人	7,238	941,663,800	
ケネディクス商業リート	12,843	3,468,894,300	
ヘルスケア&メディカル投資	7,093	918,543,500	
サムティ・レジデンシャル	6,656	748,134,400	
野村不動産マスターＦ	103,704	18,884,498,400	
いちごホテルリート投資	5,509	723,882,600	
ラサールロジポート投資	30,917	4,782,859,900	
スターアジア不動産投	11,036	1,277,968,800	
マリモ地方創生リート	2,859	368,525,100	
三井不ロジパーク	8,188	3,721,446,000	
大江戸温泉リート	5,650	519,800,000	
さくら総合リート	7,195	702,232,000	
投資法人みらい	36,070	2,110,095,000	
森トラスト・ホテルリート投	7,802	1,142,212,800	
三菱地所物流REIT	6,546	2,274,735,000	
CREロジスティクスファンド	4,668	614,308,800	
ザイマックス・リート	4,827	666,126,000	
タカラレーベン不動産投	9,437	1,154,145,100	
伊藤忠アドバンスロジ	5,144	587,959,200	
日本ビルファンド	32,201	25,438,790,000	※
ジャパンリアルエステイト	33,253	23,576,377,000	
日本リテールファンド	62,848	14,574,451,200	
オリックス不動産投資	66,256	15,059,988,800	
日本プライムリアルティ	21,050	10,125,050,000	
プレミア投資法人	30,035	4,583,341,000	
東急リアル・エステート	22,295	4,414,410,000	

	グローバル・ワン不動産投資法人	23,091	3,126,521,400	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	74,664	15,298,653,600	
	森トラスト総合リート	23,766	4,484,644,200	
	インヴィンシブル投資法人	145,862	8,912,168,200	
	フロンティア不動産投資	11,811	5,456,682,000	
	平和不動産リート	20,708	2,750,022,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	21,727	5,762,000,400	
	福岡リート投資法人	17,198	3,123,156,800	
	ケネディクス・オフィス投資法人	10,287	8,301,609,000	
	いちごオフィスリート投資法人	25,749	2,798,916,300	
	大和証券オフィス投資法人	7,675	6,247,450,000	
	阪急阪神リート投資法人	15,020	2,505,336,000	
	スターツプロシード投資法人	5,178	1,016,441,400	
	大和ハウスリート投資法人	44,831	12,530,264,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	107,123	8,784,086,000	
	日本賃貸住宅投資法人	37,403	3,818,846,300	
	ジャパンエクセレント投資法人	29,777	5,213,952,700	
投資証券　合計			357,070,085,750	
合計			357,070,085,750	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド　　1,400口

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年12月18日現在	2019年12月18日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	113,722,457	84,259,481
金銭信託	18,580,949	－

コール・ローン	77,829,373	617,829,784
投資信託受益証券	168,584,393	―
投資証券	18,608,705,787	26,082,798,515
派生商品評価勘定	26,626	1,669,974
未収入金	8,046	249,929
未収配当金	38,184,704	33,402,733
差入委託証拠金	51,308,493	96,785,805
流動資産合計	19,076,950,828	26,916,996,221
資産合計	19,076,950,828	26,916,996,221
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,625,585	4,658,406
未払金	63,681,085	81,776,260
未払解約金	4,748,300	19,922,080
その他未払費用	522	―
流動負債合計	75,055,492	106,356,746
負債合計	75,055,492	106,356,746
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	8,605,559,107	10,727,508,018
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,396,336,229	16,083,131,457
元本等合計	19,001,895,336	26,810,639,475
純資産合計	19,001,895,336	26,810,639,475
負債純資産合計	19,076,950,828	26,916,996,221

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19日 至　2019年12月18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)投資信託受益証券 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。 (3)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、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
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12月18日現在	2019年12月18日現在
1．※1　期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	6,102,884,330円	8,605,559,107円
期中追加設定元本額	3,189,233,518円	3,493,386,129円
期中一部解約元本額	686,558,741円	1,371,437,218円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）	4,250,708,821円	4,859,934,730円
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	607,517,253円	777,898,200円
ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）	332,616,245円	325,710,667円

	ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	243,780,173円	231,491,706円
	Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス	1,218,823円	1,374,584円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	33,252円	385,683円
	ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス	76,699,942円	99,386,729円
	ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	595,418,401円	914,351,451円
	グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	－円	386,806円
	グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	－円	386,806円
	ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド	1,752,831,763円	2,255,329,705円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	3,180,473円	2,670,316円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	6,164,552円	6,719,175円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	1,416,414円	2,137,765円
	ダイワ・インデックスセレクト グローバルＲＥＩＴ	258,789,793円	239,856,057円
	ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド	26,738,838円	35,933,971円
	ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）	227,933,210円	760,409,422円
	ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	220,511,154円	213,144,245円
計		8,605,559,107円	10,727,508,018円
2.	期末日における受益権の総数	8,605,559,107口	10,727,508,018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19日 至 2019年12月18日

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2019年12月18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12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	△10,094,705	－
投資証券	△696,492,363	△952,094,314
合計	△706,587,068	△952,094,314

（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12月1日から2018年12月18日まで、及び2019年12月3日から2019年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．不動産投信関連

種　類	2018年12月18日 現在				2019年12月18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								
不動産投信指数先物取引								
買　建	130,736,956	－	124,243,076	△6,493,880	737,803,068	－	733,270,153	△4,532,915
合計	130,736,956	－	124,243,076	△6,493,880	737,803,068	－	733,270,153	△4,532,915

（注）　1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

	2018年12月18日 現在	2019年12月18日 現在

種　類	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	32,401,000	－	32,400,000	1,000	－	－	－	－
オーストラリア・ドル	32,401,000	－	32,400,000	1,000	－	－	－	－
買　建	95,441,079	－	95,335,000	△106,079	608,809,817	－	610,354,300	1,544,483
アメリカ・ドル	73,289,079	－	73,179,000	△110,079	492,610,277	－	493,167,100	556,823
オーストラリア・ドル	8,080,600	－	8,082,000	1,400	－	－	－	－
カナダ・ドル	5,871,600	－	5,873,000	1,400	－	－	－	－
シンガポール・ドル	8,199,800	－	8,201,000	1,200	－	－	－	－
ユーロ	－	－	－	－	116,199,540	－	117,187,200	987,660
合計	127,842,079	－	127,735,000	△105,079	608,809,817	－	610,354,300	1,544,483

（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12月18日現在	2019年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.2081円	2.4992円
（1万口当たり純資産額）	(22,081円)	(24,992円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	24,000	631,680.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,700	103,846.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	21,982	410,184.120	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	21,400	455,820.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,600	5,289,984.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	56,347	8,151,157.020	
		BOSTON PROPERTIES INC	26,100	3,509,667.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	27,367	1,380,938.820	
		VORNADO REALTY TRUST	29,164	1,895,660.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	12,100	276,727.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,200	332,418.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,700	161,764.000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,400	529,568.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	63,800	5,111,018.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	39,300	626,442.000	
		EPR PROPERTIES	14,300	973,401.000	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	40,845.000	
		CITY OFFICE REIT INC	9,300	117,366.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	17,433	350,926.290	
		EQUINIX INC	15,500	8,641,560.000	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,829	320,092.740	
		CHATHAM LODGING TRUST	7,400	134,532.000	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,700	222,414.000	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,400	814,040.000	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19,700	338,840.000	

		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,900	127,658.000	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	36,934.740	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	134,200	2,461,228.000	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	46,908	1,188,648.720	
		CORESITE REALTY CORP	6,900	770,937.000	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	28,800	1,035,072.000	
		RLJ LODGING TRUST	31,871	559,336.050	
		FARMLAND PARTNERS INC	2,900	19,082.000	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	34,600	628,336.000	
		CYRUSONE INC	20,800	1,308,736.000	
		KIMCO REALTY CORP	75,900	1,548,360.000	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,000	91,420.000	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	37,850	1,105,598.500	
		WHITESTONE REIT	8,500	112,625.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	36,700	1,528,188.000	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,600	484,318.000	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	44,580	1,116,283.200	
		COLONY CAPITAL INC	93,511	417,994.170	
		INVITATION HOMES INC	97,997	2,811,533.930	
		JBG SMITH PROPERTIES	21,032	822,140.880	
		CLIPPER REALTY INC	1,400	13,986.000	
		GLADSTONE LAND CORP	2,500	32,212.500	
		AMERICOLD REALTY TRUST	35,300	1,170,195.000	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	12,300	257,439.000	
		VICI PROPERTIES INC	84,300	2,094,855.000	
		RETAIL VALUE INC	2,709	96,928.020	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12,500	230,125.000	
		BRT APARTMENTS CORP	1,300	22,139.000	
		FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,100	123,321.000	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,900	139,517.000	
		SAFEHOLD INC	2,600	100,256.000	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,960	109,054.400	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	18,100	241,816.000	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14,200	350,172.000	
		CORECIVIC INC	21,424	358,209.280	
		COREPOINT LODGING INC	6,700	72,762.000	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	62,798.000	
		STORE CAPITAL CORP	39,100	1,447,091.000	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17,800	213,244.000	

		LIFE STORAGE INC	8,600	889,756.000	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,700	385,932.000	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	16,182	223,149.780	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9,200	123,004.000	
		PARAMOUNT GROUP INC	36,300	489,687.000	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25,700	352,861.000	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	20,600	924,322.000	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	21,100	427,275.000	
		STAG INDUSTRIAL INC	22,600	685,910.000	
		VENTAS INC	67,779	3,784,101.570	
		CARETRUST REIT INC	17,203	352,833.530	
		GEO GROUP INC/THE	20,900	329,384.000	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	54,900	1,150,155.000	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,000	278,100.000	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,187	729,778.380	
		UMH PROPERTIES INC	5,600	87,864.000	
		IRON MOUNTAIN INC	53,100	1,666,809.000	
		TERRENO REALTY CORP	12,200	648,064.000	
		VEREIT INC	194,608	1,776,771.040	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	18,620	900,090.800	
		SUN COMMUNITIES INC	16,500	2,461,800.000	
		ACADIA REALTY TRUST	14,911	383,212.700	
		ALEXANDER'S INC	400	125,868.000	
		PROLOGIS INC	115,202	10,058,286.620	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,600	3,190,940.000	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	33,600	500,640.000	
		SAUL CENTERS INC	2,400	120,576.000	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	24,092.250	
		MACK-CALI REALTY CORP	15,600	318,552.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	17,900	1,871,087.000	
		COUSINS PROPERTIES INC	27,306	1,083,502.080	
		SITE CENTERS CORP	27,078	362,574.420	
		DUKE REALTY CORP	66,500	2,264,990.000	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	6,900	912,594.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,967	3,544,505.730	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	23,700	966,960.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,600	1,602,216.000	
		GETTY REALTY CORP	5,703	185,746.710	
		WELLTOWER INC	74,200	5,743,080.000	

		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	89,500	2,866,685.000	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	18,500	856,920.000	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	29,600	700,040.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,200	746,344.000	
		EQUITY COMMONWEALTH	21,875	689,281.250	
		KILROY REALTY CORP	16,700	1,370,402.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	29,100	1,713,117.000	
		LTC PROPERTIES INC	7,200	315,000.000	
		LEXINGTON REALTY TRUST	46,800	491,400.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,828	2,667,650.240	
		MACERICH CO/THE	20,900	542,355.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	33,500	2,308,150.000	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	8,000	628,960.000	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	31,700	1,626,210.000	
		REALTY INCOME CORP	57,817	4,147,213.410	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	21,000	594,510.000	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	45,064.000	
		PUBLIC STORAGE	27,500	5,644,100.000	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,600	587,880.000	
		REGENCY CENTERS CORP	30,920	1,900,961.600	
		RPT REALTY	13,800	201,204.000	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,600	262,064.000	
		SL GREEN REALTY CORP	15,100	1,344,202.000	
		SENIOR HOUSING PROP TRUST	41,000	305,860.000	
		TAUBMAN CENTERS INC	10,500	310,695.000	
		URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,000	141,060.000	
		UDR INC	53,400	2,440,914.000	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,200	250,426.000	
		WP CAREY INC	31,400	2,407,438.000	
		WASHINGTON REIT	15,400	451,528.000	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	21,800	671,222.000	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,300	30,510.000	
		AGREE REALTY CORP	7,400	503,052.000	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	40,148	1,632,819.160	
		CUBESMART	35,800	1,087,962.000	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	41,326	587,655.720	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	37,878	4,310,895.180	
		CEDAR REALTY TRUST INC	10,800	28,620.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	23,500	2,413,215.000	

	HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	112,061.250	
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,060	149,226.400	
	KITE REALTY GROUP TRUST	15,650	285,456.000	
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	17,000	252,620.000	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	60,984.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	25,300	1,151,403.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,300	141,120.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	36,342	397,218.060	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	91,500	1,819,935.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	178,080.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	30,300	1,282,599.000	
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	40,200	525,012.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	281,462	278,647.380	
	ARA US HOSPITALITY TRUST	87,800	75,508.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 174,591,968.640 (19,124,804,245)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	448,930	346,573.960	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	59,270	15,113.850	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	99,570	94,890.210	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	142,710	129,866.100	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	88,110	84,849.930	
	REGIONAL REIT LTD	81,310	90,091.480	
	NEWRIVER REIT PLC	51,330	100,093.500	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	100,490	89,235.120	
	LXI REIT PLC	94,038	123,189.780	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54,330	49,114.320	
	AEW UK REIT PLC	25,610	25,251.460	
	RDI REIT PLC	41,036	55,726.880	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	138,741	1,339,960.570	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	70,790	74,754.240	
	SEGRO PLC	198,010	1,729,815.360	
	HAMMERSON PLC	144,920	426,354.640	
	UNITE GROUP PLC/THE	66,220	805,235.200	
	BRITISH LAND CO PLC	170,790	1,031,230.020	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	48,391	408,613.600	
	INTU PROPERTIES PLC	145,670	48,799.450	

	DERWENT LONDON PLC	19,690	760,821.600	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	213,440	327,843.840	
	WORKSPACE GROUP PLC	24,160	283,638.400	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	40,490	310,153.400	
	SHAFTESBURY PLC	40,680	378,324.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	27,810	320,371.200	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	154,340	350,969.160	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	69,433.600	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	315,770	454,708.800	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 10,325,023.670 (1,483,809,152)	
イスラエル・シュケル			イスラエル・シュケル	
	REIT 1 LTD	28,840	620,060.000	
イスラエル・シュケル　小計			イスラエル・シュケル 620,060.000 (19,457,483)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	47,520	155,390.400	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	338,284	402,557.960	
	RURAL FUNDS GROUP	50,595	93,600.750	
	VIVA ENERGY REIT	98,830	270,794.200	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	68,595	385,503.900	
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	64,950	191,602.500	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	4,573	12,347.100	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	170,860	463,030.600	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	57,547	246,876.630	
	NATIONAL STORAGE REIT	135,195	264,306.220	
	APN INDUSTRIA REIT	29,760	87,196.800	
	GDI PROPERTY GROUP	83,310	128,713.950	
	SCENTRE GROUP	1,004,270	3,846,354.100	
	ARENA REIT	59,890	179,670.000	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,300	68,373.000	
	BWP TRUST	90,550	372,160.500	
	DEXUS	205,120	2,479,900.800	
	GPT GROUP	365,710	2,128,432.200	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	72,400	321,456.000	
	MIRVAC GROUP	750,040	2,415,128.800	

	STOCKLAND	455,420	2,176,907.600	
	ABACUS PROPERTY GROUP	64,120	236,602.800	
	GOODMAN GROUP	302,050	4,210,577.000	
	VICINITY CENTRES	604,590	1,541,704.500	
	CHARTER HALL GROUP	88,460	1,000,482.600	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	45,220	213,438.400	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 23,893,109.310 (1,792,461,060)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13,100	153,139.000	
	SLATE RETAIL REIT - U	3,100	39,990.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10,200	192,474.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	29,835.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	91,812.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	13,700	164,263.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	14,700	178,164.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	81,536.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,600	305,164.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	9,400	123,704.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,400	160,472.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	27,400	370,448.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	75,054.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,900	185,045.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,600	389,970.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,100	749,979.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16,790	234,556.300	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26,066	543,215.440	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	27,600	738,024.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	163,944.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,700	216,811.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4,900	144,060.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9,500	150,005.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,200	521,118.000	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 6,002,782.740 (499,551,580)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	220,083	433,563.510	

		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	126,200	125,569.000	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	409,000	462,170.000	
		AIMS APAC REIT	89,000	126,380.000	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	121,800	85,869.000	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	315,650	372,467.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86,000	76,970.000	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	547,575	1,073,247.000	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	562,516	1,636,921.560	
		CAPITALAND MALL TRUST	531,500	1,280,915.000	
		SUNTEC REIT	449,400	808,920.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	528,000	881,760.000	
		KEPPEL REIT	380,400	460,284.000	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	129,960	211,834.800	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	213,600	284,088.000	
		ESR-REIT	374,902	196,823.550	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	157,600	252,160.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	130,668	350,190.240	
		STARHILL GLOBAL REIT	243,800	173,098.000	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	145,396	226,817.760	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,300	221,760.000	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467,200	102,784.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	295,580	741,905.800	
		CACHE LOGISTICS TRUST	174,500	123,022.500	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	395,284	909,153.200	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182,100	128,380.500	
		SPH REIT	166,600	179,928.000	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202,100	105,092.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	124,400	56,602.000	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	148,900	166,768.000	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	436,063	235,474.020	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 12,490,918.440 (1,009,516,028)	
	ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
		ARGOSY PROPERTY LTD	158,520	212,416.800	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	273,920	419,097.600	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	56,800	152,508.000	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	216,250	459,531.250	

	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	190,240	341,480.800	
ニュージーランド・ドル　小計			ニュージーランド・ドル 1,585,034.450 (113,963,977)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26,600	444,486.000	
	HAMBORNER REIT AG	11,980	116,757.080	
	WERELDHAVE NV	6,470	128,429.500	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,700	3,304,965.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	6,530	160,638.000	
	NSI NV	3,231	135,702.000	
	VASTNED RETAIL NV	3,750	97,500.000	
	ICADE	4,960	462,768.000	
	ALTAREA	540	106,920.000	
	GECINA SA	9,541	1,488,396.000	
	KLEPIERRE	36,540	1,180,972.800	
	COVIVIO	7,562	751,284.700	
	MERCIALYS	4,030	48,722.700	
	AEDIFICA	4,144	445,065.600	
	COFINIMMO	4,400	563,200.000	
	BEFIMMO	3,720	198,648.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,310	84,901.500	
	RETAIL ESTATES	1,940	159,080.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,170	495,154.000	
	MONTEA	2,150	169,205.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	38,126.400	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	78,975.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	42,753	476,268.420	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	64,870	817,362.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	82,050	128,982.600	
	HIBERNIA REIT PLC	116,240	163,200.960	
ユーロ　小計			ユーロ 12,245,711.260 (1,494,833,973)	
韓国・ウォン			韓国・ウォン	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	46,680,000.000	
韓国・ウォン　小計			韓国・ウォン 46,680,000.000 (4,392,588)	
香港・ドル			香港・ドル	

		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	287,000	1,509,620.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193,000	961,140.000	
		FORTUNE REIT	278,000	2,485,320.000	
		PROSPERITY REIT	195,000	588,900.000	
		LINK REIT	391,500	30,967,650.000	
		CHAMPION REIT	375,000	1,867,500.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 38,380,130.000 (540,008,429)	
投資証券　合計				26,082,798,515 [26,082,798,515]	
合計				26,082,798,515 [26,082,798,515]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	156銘柄	100%	73.3%
イギリス・ポンド	投資証券	29銘柄	100%	5.7%
イスラエル・シュケル	投資証券	1銘柄	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券	26銘柄	100%	6.9%
カナダ・ドル	投資証券	24銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券	31銘柄	100%	3.9%
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	100%	0.4%
ユーロ	投資証券	26銘柄	100%	5.7%
韓国・ウォン	投資証券	1銘柄	100%	0.0%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	100%	2.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年12月18日現在	2019年12月18日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	16,117,091	―
コール・ローン	67,509,097	146,370,537
国債証券	14,078,326,560	17,241,097,460
地方債証券	1,039,704,300	1,451,961,400
特殊債券	919,529,500	728,040,400
社債券	1,045,422,100	932,981,800
未収利息	51,890,376	53,080,992
前払費用	1,086,624	2,255,924
流動資産合計	17,219,585,648	20,555,788,513
資産合計	17,219,585,648	20,555,788,513
負債の部		
流動負債		
未払金	―	73,985,700
未払解約金	356,000	2,007,188
その他未払費用	519	―
流動負債合計	356,519	75,992,888
負債合計	356,519	75,992,888
純資産の部		
元本等		
元本　※1	13,470,544,219	15,760,287,085
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,748,684,910	4,719,508,540
元本等合計	17,219,229,129	20,479,795,625
純資産合計	17,219,229,129	20,479,795,625
負債純資産合計	17,219,585,648	20,555,788,513

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19日 至　2019年12月18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12月18日現在	2019年12月18日現在
1.　※1　期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	12,102,682,064円	13,470,544,219円
期中追加設定元本額	2,604,701,757円	3,333,782,725円
期中一部解約元本額	1,236,839,602円	1,044,039,859円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	12,700,496円	135,845,810円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	59,366円	747,557円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	115,879,263円	128,400,956円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,073,449,867円	1,767,217,281円
ダイワ・ライフ・バランス３０	5,864,740,765円	6,314,635,022円
ダイワ・ライフ・バランス５０	3,186,852,570円	3,606,266,384円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,030,403,541円	1,135,898,805円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	712,638,846円	924,064,741円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	571,642,583円	715,468,649円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	179,007,932円	235,660,379円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	56,559,291円	51,940,084円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	51,345,213円	65,163,259円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	5,092,545円	8,870,941円
ダイワつみたてインデックス日本債券	5,135,055円	153,980,501円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	4,084,360円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	506,442円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	－円	876,781円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	382,555,859円	312,252,348円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	201,393,773円	198,406,785円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	9,240,428円	－円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	11,846,826円	－円
計	13,470,544,219円	15,760,287,085円
2. 期末日における受益権の総数	13,470,544,219口	15,760,287,085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19日 至 2019年12月18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18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12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	68,012,350	△32,212,830
地方債証券	3,303,800	△4,415,500
特殊債券	1,652,700	△1,725,200
社債券	3,572,800	△2,607,800
合計	76,541,650	△40,961,330

（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12月1日から2018年12月18日まで、及び2019年12月3日から2019年12月18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12月18日現在	2019年12月18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12月18日現在	2019年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.2783円	1.2995円
（1万口当たり純資産額）	(12,783円)	(12,995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	100,000,000	100,287,000	
	４０１ ２年国債	70,000,000	70,238,700	
	４０３ ２年国債	160,000,000	160,595,200	
	４０６ ２年国債	180,000,000	180,774,000	
	１２７ ５年国債	140,000,000	140,428,400	
	１２８ ５年国債	227,000,000	227,783,150	
	１２９ ５年国債	182,000,000	182,735,280	
	１３０ ５年国債	217,000,000	217,978,670	
	１３１ ５年国債	190,000,000	190,984,200	
	１３２ ５年国債	170,000,000	171,001,300	
	１３３ ５年国債	200,000,000	201,382,000	
	１３４ ５年国債	170,000,000	171,254,600	
	１３５ ５年国債	230,000,000	231,876,800	
	１３６ ５年国債	100,000,000	100,879,000	
	１３７ ５年国債	170,000,000	171,506,200	
	１３８ ５年国債	190,000,000	191,719,500	
	１３９ ５年国債	200,000,000	201,878,000	
	１４０ ５年国債	200,000,000	201,898,000	
	１４１ ５年国債	150,000,000	151,504,500	
	１ ４０年国債	30,000,000	46,106,400	
	２ ４０年国債	23,000,000	34,426,630	

３　４０年国債	19,000,000	28,653,710	
４　４０年国債	30,000,000	45,697,800	
５　４０年国債	35,000,000	51,734,900	
６　４０年国債	28,000,000	40,864,880	
７　４０年国債	31,000,000	43,599,020	
８　４０年国債	23,000,000	30,339,760	
９　４０年国債	40,000,000	39,623,600	
１０　４０年国債	91,000,000	105,750,190	
１１　４０年国債	85,000,000	95,960,750	
１２　４０年国債	60,000,000	61,410,000	
３１３　１０年国債	34,000,000	34,614,720	
３１４　１０年国債	77,000,000	78,199,660	
３１５　１０年国債	90,000,000	91,807,200	
３１６　１０年国債	56,000,000	57,039,920	
３１７　１０年国債	40,000,000	40,864,400	
３１８　１０年国債	33,000,000	33,655,050	
３１９　１０年国債	140,000,000	143,428,600	
３２０　１０年国債	35,000,000	35,786,800	
３２１　１０年国債	65,000,000	66,649,050	
３２２　１０年国債	140,000,000	143,236,800	
３２３　１０年国債	70,000,000	71,799,700	
３２４　１０年国債	80,000,000	81,856,800	
３２５　１０年国債	160,000,000	164,088,000	
３２６　１０年国債	20,000,000	20,500,400	
３２７　１０年国債	90,000,000	92,522,700	
３２８　１０年国債	60,000,000	61,438,800	
３２９　１０年国債	160,000,000	165,262,400	
３３０　１０年国債	81,000,000	83,825,280	
３３１　１０年国債	130,000,000	133,554,200	
３３２　１０年国債	65,000,000	66,895,400	
３３３　１０年国債	83,000,000	85,570,510	
３３４　１０年国債	220,000,000	227,117,000	
３３５　１０年国債	210,000,000	216,171,900	
３３７　１０年国債	50,000,000	51,056,500	
３３８　１０年国債	92,000,000	94,526,320	
３３９　１０年国債	25,000,000	25,719,750	
３４０　１０年国債	160,000,000	164,771,200	
３４１　１０年国債	15,000,000	15,376,200	
３４３　１０年国債	92,000,000	93,265,000	

３４４　１０年国債	85,000,000	86,213,800	
３４５　１０年国債	280,000,000	284,146,800	
３４６　１０年国債	100,000,000	101,571,000	
３４７　１０年国債	180,000,000	182,858,400	
３４８　１０年国債	170,000,000	172,723,400	
３４９　１０年国債	170,000,000	172,742,100	
３５０　１０年国債	185,000,000	187,921,150	
３５１　１０年国債	160,000,000	162,395,200	
３５２　１０年国債	180,000,000	182,613,600	
３５３　１０年国債	161,000,000	163,257,220	
３５４　１０年国債	110,000,000	111,428,900	
３５５　１０年国債	30,000,000	30,371,400	
３５６　１０年国債	198,000,000	200,320,560	
２　３０年国債	9,000,000	11,202,930	
３　３０年国債	4,000,000	4,955,720	
４　３０年国債	8,000,000	10,504,880	
５　３０年国債	8,000,000	9,958,080	
６　３０年国債	9,000,000	11,492,550	
７　３０年国債	12,000,000	15,294,000	
１０　３０年国債	15,000,000	16,961,400	
１１　３０年国債	9,000,000	10,910,970	
１２　３０年国債	11,000,000	13,956,250	
１３　３０年国債	11,000,000	13,847,900	
１４　３０年国債	22,000,000	29,006,780	
１５　３０年国債	21,000,000	28,083,720	
１６　３０年国債	26,000,000	34,894,600	
１７　３０年国債	17,000,000	22,628,700	
１８　３０年国債	20,000,000	26,410,400	
１９　３０年国債	15,000,000	19,870,500	
２０　３０年国債	16,000,000	21,752,960	
２１　３０年国債	16,000,000	21,325,760	
２２　３０年国債	17,000,000	23,263,310	
２３　３０年国債	16,000,000	21,966,080	
２４　３０年国債	15,000,000	20,659,500	
２５　３０年国債	17,000,000	22,908,010	
２６　３０年国債	32,000,000	43,775,040	
２７　３０年国債	32,000,000	44,580,160	
２８　３０年国債	34,000,000	47,600,680	
２９　３０年国債	43,000,000	59,775,160	

３０　３０年国債	56,000,000	77,225,120	
３１　３０年国債	76,000,000	103,896,560	
３２　３０年国債	59,000,000	82,310,900	
３３　３０年国債	65,000,000	87,270,300	
３４　３０年国債	70,000,000	97,247,500	
３５　３０年国債	68,000,000	92,170,600	
３６　３０年国債	64,000,000	87,146,880	
３７　３０年国債	87,000,000	117,147,240	
３８　３０年国債	45,000,000	59,799,600	
３９　３０年国債	50,000,000	67,711,000	
４０　３０年国債	44,000,000	58,699,080	
４１　３０年国債	34,000,000	44,657,640	
４２　３０年国債	53,000,000	69,772,380	
４３　３０年国債	37,000,000	48,766,740	
４４　３０年国債	42,000,000	55,484,940	
４５　３０年国債	43,000,000	54,809,950	
４６　３０年国債	55,000,000	70,243,800	
４７　３０年国債	44,000,000	57,346,080	
４８　３０年国債	50,000,000	62,773,000	
４９　３０年国債	68,000,000	85,526,320	
５０　３０年国債	49,000,000	54,300,820	
５１　３０年国債	55,000,000	54,005,600	
５２　３０年国債	57,000,000	58,803,480	
５３　３０年国債	55,000,000	58,176,800	
５４　３０年国債	55,000,000	61,004,900	
５５　３０年国債	56,000,000	62,165,600	
５６　３０年国債	50,000,000	55,481,000	
５７　３０年国債	50,000,000	55,455,000	
５８　３０年国債	55,000,000	60,970,250	
５９　３０年国債	55,000,000	59,525,950	
６０　３０年国債	122,000,000	138,623,720	
６１　３０年国債	50,000,000	54,109,000	
６２　３０年国債	46,000,000	47,266,380	
６３　３０年国債	50,000,000	49,934,000	
６４　３０年国債	37,000,000	36,901,580	
４９　２０年国債	4,000,000	4,112,880	
５０　２０年国債	30,000,000	30,771,000	
５１　２０年国債	25,000,000	25,802,500	
５２　２０年国債	19,000,000	19,745,750	

５３　２０年国債	13,000,000	13,580,710	
５４　２０年国債	14,000,000	14,653,520	
５５　２０年国債	41,000,000	42,972,100	
５６　２０年国債	12,000,000	12,641,400	
５７　２０年国債	24,000,000	25,222,560	
５８　２０年国債	35,000,000	36,963,150	
５９　２０年国債	3,000,000	3,165,480	
６１　２０年国債	40,000,000	41,481,600	
６２　２０年国債	16,000,000	16,526,240	
６３　２０年国債	30,000,000	32,036,400	
６４　２０年国債	35,000,000	37,665,600	
６５　２０年国債	42,000,000	45,412,080	
６６　２０年国債	30,000,000	32,316,600	
６７　２０年国債	19,000,000	20,639,130	
６８　２０年国債	25,000,000	27,477,000	
６９　２０年国債	12,000,000	13,137,720	
７０　２０年国債	18,000,000	20,043,720	
７１　２０年国債	17,000,000	18,776,330	
７２　２０年国債	53,000,000	58,596,800	
７５　２０年国債	14,000,000	15,637,580	
７６　２０年国債	25,000,000	27,660,250	
７８　２０年国債	17,000,000	18,896,350	
７９　２０年国債	14,000,000	15,639,260	
８１　２０年国債	65,000,000	72,941,050	
８２　２０年国債	28,000,000	31,582,880	
８５　２０年国債	31,000,000	35,310,860	
８６　２０年国債	6,000,000	6,909,900	
８８　２０年国債	33,000,000	38,195,190	
８９　２０年国債	15,000,000	17,263,200	
９２　２０年国債	45,000,000	51,999,750	
９３　２０年国債	18,000,000	20,775,420	
９４　２０年国債	45,000,000	52,267,050	
９５　２０年国債	30,000,000	35,455,200	
９６　２０年国債	23,000,000	26,834,330	
９７　２０年国債	25,000,000	29,493,000	
９８　２０年国債	34,000,000	39,844,600	
９９　２０年国債	53,000,000	62,381,000	
１００　２０年国債	35,000,000	41,643,700	
１０１　２０年国債	18,000,000	21,715,920	

１０２　２０年国債	10,000,000	12,112,400	
１０３　２０年国債	21,000,000	25,256,280	
１０４　２０年国債	64,000,000	75,877,120	
１０５　２０年国債	38,000,000	45,222,660	
１０６　２０年国債	16,000,000	19,181,920	
１０７　２０年国債	20,000,000	23,888,600	
１０８　２０年国債	68,000,000	79,991,120	
１０９　２０年国債	60,000,000	70,806,000	
１１０　２０年国債	27,000,000	32,364,090	
１１１　２０年国債	35,000,000	42,436,800	
１１２　２０年国債	40,000,000	48,118,000	
１１３　２０年国債	70,000,000	84,543,200	
１１４　２０年国債	45,000,000	54,506,700	
１１５　２０年国債	42,000,000	51,293,760	
１１６　２０年国債	27,000,000	33,087,960	
１１７　２０年国債	77,000,000	93,572,710	
１１８　２０年国債	13,000,000	15,713,750	
１１９　２０年国債	23,000,000	27,318,710	
１２０　２０年国債	75,000,000	87,509,250	
１２３　２０年国債	42,000,000	51,534,000	
１２４　２０年国債	45,000,000	54,721,800	
１２５　２０年国債	25,000,000	31,047,250	
１２６　２０年国債	21,000,000	25,609,290	
１２７　２０年国債	53,000,000	64,039,370	
１２８　２０年国債	32,000,000	38,769,600	
１２９　２０年国債	45,000,000	54,005,400	
１３０　２０年国債	28,000,000	33,705,560	
１３１　２０年国債	70,000,000	83,447,000	
１３２　２０年国債	25,000,000	29,868,000	
１３３　２０年国債	57,000,000	68,777,910	
１３４　２０年国債	15,000,000	18,151,650	
１３５　２０年国債	20,000,000	23,959,200	
１３６　２０年国債	65,000,000	77,078,300	
１３７　２０年国債	18,000,000	21,622,680	
１３９　２０年国債	92,000,000	109,376,040	
１４１　２０年国債	48,000,000	57,932,160	
１４２　２０年国債	60,000,000	73,186,200	
１４３　２０年国債	48,000,000	57,414,720	
１４４　２０年国債	60,000,000	70,983,600	

	１４５　２０年国債	100,000,000	121,233,000	
	１４６　２０年国債	86,000,000	104,454,740	
	１４７　２０年国債	89,000,000	107,065,220	
	１４８　２０年国債	74,000,000	88,182,840	
	１４９　２０年国債	100,000,000	119,329,000	
	１５０　２０年国債	95,000,000	112,220,650	
	１５１　２０年国債	104,000,000	119,933,840	
	１５２　２０年国債	100,000,000	115,481,000	
	１５３　２０年国債	100,000,000	117,155,000	
	１５４　２０年国債	87,000,000	100,747,740	
	１５５　２０年国債	93,000,000	104,861,220	
	１５６　２０年国債	76,000,000	78,453,280	
	１５７　２０年国債	93,000,000	92,925,600	
	１５８　２０年国債	95,000,000	99,539,100	
	１５９　２０年国債	82,000,000	87,249,640	
	１６０　２０年国債	80,000,000	86,452,800	
	１６１　２０年国債	80,000,000	85,051,200	
	１６２　２０年国債	110,000,000	116,842,000	
	１６３　２０年国債	72,000,000	76,472,640	
	１６４　２０年国債	90,000,000	93,926,700	
	１６５　２０年国債	95,000,000	99,111,600	
	１６６　２０年国債	80,000,000	86,293,600	
	１６７　２０年国債	70,000,000	72,909,900	
	１６８　２０年国債	55,000,000	56,256,750	
	１６９　２０年国債	80,000,000	80,295,200	
	１７０　２０年国債	30,000,000	30,084,000	
国債証券　合計			17,241,097,460	
地方債証券	７５１　東京都公債	100,000,000	101,502,000	
	２７－１５　北海道公債	100,000,000	100,513,900	
	２２２　神奈川県公債	100,000,000	99,484,500	
	４０１　大阪府公債	100,000,000	102,019,000	
	３　兵庫県公債１２年	100,000,000	102,366,400	
	１１兵庫県公債２０年	100,000,000	117,313,800	
	２８－１　静岡県公債	100,000,000	99,701,700	
	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	102,067,000	
	２９－６　千葉県公債	100,000,000	100,712,200	
	１１６　共同発行地方	100,000,000	102,045,900	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	101,870,600	
	１６８　共同発行地方	100,000,000	100,467,300	

	２５－６　大阪市公債	100,000,000	102,328,500	
	１１　名古屋市２０年	100,000,000	119,568,600	
地方債証券　合計			1,451,961,400	
特殊債券	８１　政保道路機構	100,000,000	118,599,600	
	１９０　政保道路機構	100,000,000	101,893,500	
	２４１　政保道路機構	100,000,000	101,897,900	
	２６１　政保道路機構	100,000,000	101,732,800	
	３６　地方公共団体	100,000,000	101,926,400	
	６５　地方公共団体	100,000,000	102,064,000	
	い７８９　利付商工債	100,000,000	99,926,200	
特殊債券　合計			728,040,400	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	99,525,000	
	３３　中日本高速道	100,000,000	101,738,400	
	２５　西日本高速道	100,000,000	101,873,200	
	１７　パナソニツク	100,000,000	100,618,800	
	５　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	101,675,100	
	４４　野村ホールデイング	100,000,000	100,694,400	
	８０　三菱地所	100,000,000	114,217,300	
	３２東日本旅客鉄道	100,000,000	109,001,300	
	４９７　関西電力	100,000,000	103,638,300	
社債券　合計			932,981,800	
合計			20,354,081,060	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ短期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12月18日現在	2019年12月18日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	14,785	－

コール・ローン	61,931	186,597
国債証券	41,200,440	4,020,720
未収利息	13,382	890
前払費用	3,851	―
流動資産合計	41,294,389	4,208,207
資産合計	41,294,389	4,208,207
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	―	―
負債合計	―	―
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	39,249,494	4,013,246
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,044,895	194,961
元本等合計	41,294,389	4,208,207
純資産合計	41,294,389	4,208,207
負債純資産合計	41,294,389	4,208,207

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19日 至　2019年12月18日
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）、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12月18日現在	2019年12月18日現在
1．※1　期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	82,870,944円	39,249,494円
期中追加設定元本額	22,763,668円	2,483,233円
期中一部解約元本額	66,385,118円	37,719,481円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	2,734,170円	4,013,246円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	1,393,127円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	1,425,925円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	1,414,000円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	9,610,140円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	11,375,356円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	11,296,776円	－円
計	39,249,494円	4,013,246円
2．　期末日における受益権の総数	39,249,494口	4,013,246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19日 至　2019年12月18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18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12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△25,800	△12,380
合計	△25,800	△12,380

（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19日から2018年12月18日まで、及び2018年12月19日から2019年12月18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12月18日現在	2019年12月18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12月18日現在	2019年12月18日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0521円 (10,521円)	1.0486円 (10,486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	１３１ ５年国債	4,000,000	4,020,720	
国債証券 合計			4,020,720	
合計			4,020,720	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年12月18日現在	2019年12月18日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	147,401,950	469,405,131
金銭信託	164,535,577	－
コール・ローン	689,184,423	1,682,232,878
国債証券	167,455,873,047	188,425,986,916
派生商品評価勘定	26,908	16,456,090
未収入金	12,417	180,792
未収利息	1,232,206,917	1,234,550,264

前払費用	35,796,651	51,176,059
流動資産合計	169,725,037,890	191,879,988,130
資産合計	169,725,037,890	191,879,988,130
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,343,318	－
未払金	175,727	382,302
未払解約金	33,250,979	76,475,415
その他未払費用	5,620	－
流動負債合計	39,775,644	76,857,717
負債合計	39,775,644	76,857,717
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	61,406,010,061	66,497,252,620
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	108,279,252,185	125,305,877,793
元本等合計	169,685,262,246	191,803,130,413
純資産合計	169,685,262,246	191,803,130,413
負債純資産合計	169,725,037,890	191,879,988,130

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19日 至　2019年12月18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12月18日現在	2019年12月18日現在
1．※1　期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	59,323,594,737円	61,406,010,061円
期中追加設定元本額	6,439,352,239円	9,182,640,549円
期中一部解約元本額	4,356,936,915円	4,091,397,990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	690,377,947円	652,317,354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)	171,491,829円	125,838,485円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	52,710,212円	41,489,203円

ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	542,916,644円	436,984,397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）	2,206,505円	35,285,132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）	358,202,378円	428,909,606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）	1,129,646,948円	1,503,129,836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）	707,663,901円	791,622,418円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	731,384円	2,461,899円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	27,109円	339,166円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	503,496,973円	608,510,044円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	492,941,040円	797,051,079円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	4,389,691円	15,358,920円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	42,429,483,894円	45,573,295,737円
ダイワ・ライフ・バランス３０	739,788,743円	787,764,479円
ダイワ・ライフ・バランス５０	368,136,096円	410,049,356円
ダイワ・ライフ・バランス７０	237,768,692円	257,466,417円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	329,260,143円	419,282,302円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	263,486,369円	324,748,380円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	82,547,093円	106,991,375円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	10,485,123円	9,435,326円

	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	18,657,551円	21,613,243円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	1,851,074円	3,215,568円
	ダイワつみたてインデックス外国債券	1,402,439円	72,111,722円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	501,780円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	57,519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	246,851,720円	198,296,934円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	154,707,266円	149,999,782円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	5,641,456,746円	4,917,923,875円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	17,076,090円	－円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	8,179,618円	－円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	325,032,492円	281,187,508円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	142,904,084円	144,819,210円
	ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	28,395,905円	33,661,572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）	27,703,290円	1,465,206,572円
	ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,533,310,797円	5,744,278,287円
	ダイワライフスタイル２５	35,190,841円	34,675,687円
	ダイワライフスタイル５０	62,125,559円	61,883,870円
	ダイワライフスタイル７５	17,342,246円	17,195,256円
計		61,406,010,061円	66,497,252,620円
2.	期末日における受益権の総数	61,406,010,061口	66,497,252,620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19日 至　2019年12月18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18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12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2019年12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,551,789,987	△924,948,753
合計	1,551,789,987	△924,948,753

（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12月1日から2018年12月18日まで、及び2019年12月3日から2019年12月18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12月18日 現在				2019年12月18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	786,889,450	－	780,573,040	△6,316,410	1,578,997,990	－	1,595,454,080	16,456,090
アメリカ・ドル	228,409,947	－	227,443,340	△966,607	588,772,159	－	590,380,650	1,608,491
イギリス・ポンド	42,976,998	－	42,212,610	△764,388	43,044,284	－	43,791,900	747,616
オーストラリア・ドル	14,552,556	－	14,227,840	△324,716	6,661,404	－	6,743,700	82,296
カナダ・ドル	48,774,121	－	48,421,840	△352,281	23,091,495	－	23,351,100	259,605
シンガポール・ドル	12,623,052	－	12,550,590	△72,462	－	－	－	－
デンマーク・クローネ	28,784,040	－	28,487,190	△296,850	－	－	－	－
ノルウェー・クローネ	7,193,659	－	7,108,920	△84,739	33,540,812	－	34,129,920	589,108

ポーランド・ズロチ	10,785,429	―	10,701,790	△83,639	27,444,600	―	28,238,070	793,470
メキシコ・ペソ	―	―	―	―	42,179,712	―	43,596,500	1,416,788
ユーロ	392,789,648	―	389,418,920	△3,370,728	775,178,992	―	785,154,240	9,975,248
南アフリカ・ランド	―	―	―	―	39,084,532	―	40,068,000	983,468
合計	786,889,450	―	780,573,040	△6,316,410	1,578,997,990	―	1,595,454,080	16,456,090

（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12月18日現在	2019年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.7633円	2.8844円
（1万口当たり純資産額）	(27,633円)	(28,844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	4,166,731.760	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,602,912.850	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,552,700.920	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,167,295.920	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,247,148.320	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,465,147.500	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,541,296.190	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	8,168,000.000	8,159,341.920	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,394,500.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,694,510.550	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,698,233.680	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,218,676.770	
		2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,509,378.350	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,020,724.040	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,445,898.920	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,655,613.810	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,740,693.240	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,841,818.980	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,073,899.520	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	7,907,000.000	7,969,069.950	

		2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,744,676.480	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,509,220.750	
		8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,355,013.440	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	759,176.280	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,065,073.500	
		6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	822,490.200	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	933,632.470	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	903,322.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	942,448.140	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	773,000.000	992,694.330	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,360,589.600	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,091,000.000	1,470,286.150	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,326,000.000	1,772,477.460	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	747,000.000	1,066,805.640	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	735,728.360	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	707,376.240	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,510,990.240	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,490,660.960	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,453,355.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,637,372.000	

		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	2,010,000.000	2,807,246.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	2,005,793.800	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	2,026,536.250	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,964,669.980	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,499,572.780	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,858,952.550	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,867,000.000	2,343,365.050	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,663,527.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,862,132.820	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,522,747.380	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,412,268.750	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,840,794.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,826,000.000	3,243,711.060	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,898,000.000	4,300,858.300	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,802,209.520	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,531,075.110	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,117,000.000	5,120,806.940	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,383,536.190	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,860,327.860	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,339,588.840	

		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,929,000.000	4,527,858.180	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,308,103.460	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,653,601.250	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,176,345.710	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,063,932.940	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	4,343,557.020	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,898,496.380	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,198,693.530	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,419,961.700	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,815,189.510	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	4,063,000.000	4,200,735.700	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,813,233.060	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,897,764.940	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,897,856.240	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	4,338,612.200	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,618,321.040	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,841,882.120	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,854,485.270	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,198,218.780	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,816,108.390	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	4,073,000.000	4,511,458.450	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,459,132.100	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,478,180.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,993,708.800	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	4,204,782.030	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,572,964.300	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,096,092.880	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,346,915.110	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,046,195.150	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,060,240.640	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,116,215.620	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,313,574.180	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,567,402.500	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,547,157.280	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,287,789.310	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,239,326.160	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,986,269.520	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,111,705.640	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,029,000.000	6,954,844.050	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,440,420.500	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,066,584.500	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,542,531.160	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,689,011.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,495,100.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,479,675.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,967,630.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,292,810.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,429,157.200	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,666,145.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,667,884.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,737,410.400	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,372,616.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,475,441.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	3,012,979.320	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	6,500,000.000	6,575,660.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,977,020.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,493,350.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,724,764.500	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,529,466.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	3,400,000.000	3,406,358.000	

		2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	2,013,420.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,552,925.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,493,525.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,023,635.300	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,532,501.600	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,038,251.300	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,023,846.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,338,088.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	7,550,000.000	7,677,368.500	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,914,036.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,916,372.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	3,985,065.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,015,450.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,035,610.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,007,500.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,800,000.000	5,871,108.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,007,950.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,429,040.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,073,755.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,916,066.000	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,053,430.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	4,133,070.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,197,472.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,013,280.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,515,225.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,545,300.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,523,625.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,662,415.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	3,808,140.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,585,015.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	2,004,600.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,259,232.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,869,104.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,308,533.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,574,620.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,730,164.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,516,400.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,397,680.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,697,292.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,835,405.000	

		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	4,107,060.000	
		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	2,976,328.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,028,441.000	
		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	4,905,138.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,012,850.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	3,039,960.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,587,100.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,008,490.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,755,509.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,588,650.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	5,070,850.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,580,250.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,155,370.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,348,840.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	4,550,000.000	4,718,122.500	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,238,613.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,200,000.000	4,801,440.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,544,025.000	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,647,650.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,735,828.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,789,828.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,564,365.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,667,575.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,128,880.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,064,800.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,669,325.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,175,000.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,090,440.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	7,300,000.000	8,047,082.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,800,000.000	5,875,872.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,500,000.000	2,525,975.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,184,440.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	5,000,000.000	5,222,650.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,853,256.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20201231	4,000,000.000	4,034,520.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,666,495.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,589,250.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,050,970.000	

		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,012,962.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,053,310.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,000,000.000	3,027,510.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,125,000.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,619,900.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,600,000.000	5,265,896.000	
		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	2,602,725.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,388,143.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,556,175.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,566,775.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,750,135.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,437,298.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,850,000.000	5,428,556.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	6,900,000.000	7,189,731.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,577,910.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,895,788.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,000,000.000	2,013,200.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,509,135.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,058,590.000	

		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,504,620.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20210630	4,700,000.000	4,696,851.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,000,000.000	4,015,920.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,009,200.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20210731	4,700,000.000	4,705,687.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,500,000.000	3,504,620.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,000,000.000	2,007,800.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	6,738,540.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,486,175.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,850,000.000	4,781,760.500	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,100,000.000	3,091,382.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,722,776.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,916,240.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	2,988,150.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20210930	5,100,000.000	5,085,414.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,469,325.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,969,280.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,877,003.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	4,000,000.000	3,959,040.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,550,000.000	2,542,911.000	

	1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	4,500,000.000	4,443,030.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	3,000,000.000	2,962,710.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	2,000,000.000	2,025,620.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 826,118,493.330 (90,493,019,759)	
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	1,971,906.270	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,501,423.220	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,477,586.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,552,856.050	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,318,793.600	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,390,000.000	1,461,029.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,650,000.000	1,801,470.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,430,000.000	1,676,961.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,510,000.000	1,580,486.800	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,013,760.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,500,000.000	2,702,750.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	930,000.000	1,109,583.000	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,900,000.000	1,934,941.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	520,000.000	578,968.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	947,418.500	

		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,300,000.000	1,313,858.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	100,000.000	100,141.000	
		8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,222,051.880	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,388,994.360	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,866,218.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,806,953.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,985,008.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,349,995.300	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	3,231,877.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,500,725.200	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,580,150.880	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,946,000.000	3,207,981.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,330,000.000	1,883,413.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,654,741.300	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,223,225.000	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,488,040.860	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,510,000.000	2,226,797.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,374,000.000	2,618,569.200	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,457,754.500	
		3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	847,189.090	

	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,602,548.800	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,315,896.320	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,066,000.000	2,909,961.000	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,063,608.040	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,641,000.000	3,061,613.700	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,533,413.280	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,135,024.000	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 85,205,682.350 (12,244,908,610)	
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	2,588,770.800	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,439,665.660	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,392,986.200	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,271,253.280	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,680,855.650	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,731,438.080	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,698,000.000	3,035,897.520	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,756,935.380	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	3,148,000.000	3,789,814.240	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,499,500.380	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	807,000.000	959,111.430	

		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	842,000.000	1,078,854.600	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,013,267.840	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,278,000.000	2,488,099.940	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,586,121.240	
		2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,844,874.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,184,020.000	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,550,000.000	1,619,052.500	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,400,000.000	2,757,600.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,770,000.000	3,130,681.700	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	390,000.000	466,666.200	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,140,000.000	1,177,027.200	
オーストラリア・ドル　小計				**オーストラリア・ドル** 49,492,493.840 (3,712,926,888)	
カナダ・ドル			**カナダ・ドル**	**カナダ・ドル**	
		2.75% Canada Government International Bond 20641201	475,000.000	629,802.500	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	586,000.000	843,482.540	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,330,942.680	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,673,189.280	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,657,002.320	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,910,803.330	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	976,563.560	

		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,795,440.380	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	2,133,543.580	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,246,033.320	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,456,001.500	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,297,000.000	1,598,941.600	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,192,171.240	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,369,000.000	1,356,391.510	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,837,000.000	1,815,158.070	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,480,000.000	2,440,146.400	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,182,885.600	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,402,920.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,718,255.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,232,016.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,603,376.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,000,000.000	1,011,820.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	890,000.000	952,193.200	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,284,721.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,229,148.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210201	300,000.000	301,638.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210501	1,050,000.000	1,050,126.000	

		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,390,480.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210801	400,000.000	398,588.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	550,000.000	528,610.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20211101	800,000.000	793,320.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	600,000.000	588,348.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	2,200,000.000	2,190,826.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 42,914,885.110 (3,571,376,739)	
	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	867,728.000	
		3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	456,220.800	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	662,716.250	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	398,418.200	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	499,836.150	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	453,400.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	697,705.800	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	718,000.000	849,508.880	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	325,000.000	357,363.500	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	545,117.200	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	779,627.840	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	257,450.000	

	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	457,594.200	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	502,300.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	300,000.000	314,850.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	452,610.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	589,600.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	498,330.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	150,000.000	160,821.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 9,801,197.820 (792,132,808)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,095,000.000	9,557,571.700	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	6,525,012.000	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,268,328.500	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,591,565.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,595,000.000	6,432,012.000	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	6,134,570.400	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,864,359.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	4,700,000.000	5,031,632.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 56,405,051.100 (657,682,896)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	

	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	12,162,000.000	23,143,921.140	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	8,089,825.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,249,526.420	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,513,000.000	7,389,649.800	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,460,900.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	4,399,081.300	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	800,000.000	821,496.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 57,554,399.660 (940,438,891)	
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	7,243,349.880	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,321,194.080	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,385,745.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,472,406.000	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,375,738.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,536,836.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,660,580.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,250,000.000	3,333,070.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 34,328,919.460 (416,753,083)	
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	2,568,762.500	
		2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,499,585.100	
		2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,146,908.720	
		1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,067,200.810	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	2,870,000.000	2,980,581.100	
		2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,360,020.000	
		2.5% Poland Government Bond 20230125	2,850,000.000	2,924,869.500	
		2.5% Poland Government Bond 20240425	2,570,000.000	2,649,592.900	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	2,040,000.000	2,173,926.000	
		Poland Government Bond 20210525	800,000.000	784,800.000	
		2.25% Poland Government Bond 20241025	1,900,000.000	1,941,686.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,103,672.850	
		5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,168,801.320	
		4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,851,826.250	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	2,750,000.000	2,908,125.000	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,786,231.850	
	ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 37,916,589.900 (1,086,689,467)	
	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	575,549.850	
		5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	834,751.800	

		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,270,579.020	
		4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,949,568.320	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,601,145.840	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,361,308.000	
		3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	882,463.750	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	752,732.630	
		4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	640,760.940	
		3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,011,370.360	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,436,061.450	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,208,213.780	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	679,356.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,098,022.170	
		4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	871,834.670	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	760,569.260	
		3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,182,582.990	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	866,248.000	
		3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,330,071.120	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,014,555.600	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	669,487.000	
		3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	355,794.560	

		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	900,000.000	916,074.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	776,295.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	917,153.900	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,183,476.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,232,892.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	800,000.000	815,504.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	764,750.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	688,254.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	669,220.500	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	910,000.000	942,250.400	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,100,000.000	1,243,077.000	
		3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	403,612.000	
	マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 32,905,585.910 (870,352,747)	
	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	14,566,324.300	
		8% Mexican Bonos 20471107	13,300,000.000	14,670,565.000	
		7.25% Mexican Bonos 20211209	13,000,000.000	13,148,460.000	
		8% Mexican Bonos 20240905	13,300,000.000	14,027,776.000	
		6.75% Mexican Bonos 20230309	5,000,000.000	5,015,250.000	
		8% Mexican Bonos 20231207	22,033,000.000	23,055,771.860	
		10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	27,318,846.660	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	26,468,000.000	27,609,564.840	
		10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,503,632.420	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	19,544,000.000	21,863,677.360	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	12,194,000.000	13,964,446.860	
		6.5% Mexican Bonos 20210610	26,326,000.000	26,268,872.580	

	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,957,676.450	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	24,522,989.090	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	19,904,377.620	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	9,944,000.000	10,717,344.880	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 282,115,575.920 (1,630,628,029)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	447,579.540	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	298,716.930	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	431,866.470	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	203,986.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	400,000.000	497,372.000	
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	780,910.900	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	316,038.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	419,576.300	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	527,365.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	527,475.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	204,084.000	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	952,617.600	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,205,844.660	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	634,000.000	794,953.580	
	1.5% Austria Government Bond 20861102	200,000.000	265,144.000	
	Austria Government Bond 20230715	900,000.000	917,514.000	

		0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	611,105.400	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	916,137.000	
		Austria Government Bond 20220920	400,000.000	406,572.000	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,074,250.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,200,000.000	1,263,480.000	
		Austria Government Bond 20240715	300,000.000	306,303.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,487,934.430	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,274,000.000	1,403,119.900	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	947,143.740	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,389,642.960	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	944,000.000	1,151,274.080	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	440,000.000	629,076.800	
		0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	503,215.300	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,502,928.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,096,074.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	654,087.800	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	349,992.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,640,000.000	1,765,410.800	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	624,706.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,200,000.000	1,305,180.000	

		1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	744,258.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,247,908.280	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,094,708.780	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,034,691.800	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,806,212.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,588,911.780	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,385,464.160	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	3,052,911.250	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,509,454.470	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,243,697.750	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,599,000.000	3,153,547.800	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	2,351,862.060	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,413,115.220	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,775,327.220	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,485,622.650	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	2,962,816.570	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,358,630.780	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,438,000.000	3,842,483.040	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,740,930.240	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,506,500.400	

		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,950,458.650	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,754,406.810	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,715,023.870	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,609,000.000	4,203,699.070	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,742,481.100	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,656,817.320	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,314,472.540	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,321,258.500	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,304,323.840	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,942,539.500	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,681,984.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,466,589.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,750,000.000	2,267,300.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,500,000.000	1,612,185.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,900,000.000	2,003,778.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,400,000.000	2,530,152.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	1,900,000.000	1,954,435.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	373,892.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20201211	700,000.000	704,655.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210312	400,000.000	403,460.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210611	100,000.000	100,995.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210910	500,000.000	505,665.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211210	800,000.000	810,208.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,591,775.940	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,416,478.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,177,620.400	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,138,451.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	730,000.000	745,512.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,945,201.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	2,250,000.000	2,306,655.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,200,000.000	1,232,352.000	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,597,511.450	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,158,618.750	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,608,654.190	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,817,710.240	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,443,667.620	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,664,000.000	3,276,532.480	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,422,508.000	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	4,322,252.800	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,863,671.610	

		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	5,564,985.480	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	2,402,701.290	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,914,473.420	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,451,871.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,942,942.300	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,699,000.000	4,561,495.830	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,916,174.180	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,438,000.000	3,921,791.180	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,617,437.600	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,465,022.520	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	4,087,000.000	5,142,426.880	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,768,709.230	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,452,089.960	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	3,101,000.000	3,348,459.800	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,420,000.000	5,126,934.800	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,737,000.000	3,927,549.630	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,969,000.000	3,381,186.270	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,037,000.000	1,351,968.010	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,794,791.500	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,300,000.000	3,414,147.000	

		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,061,240.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,870,000.000	2,312,946.900	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,725,225.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,250,000.000	2,982,397.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,446,416.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,404,589.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	2,400,000.000	2,417,736.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	2,150,000.000	2,448,979.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,950,000.000	3,169,775.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,400,000.000	2,451,288.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,418,228.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,500,000.000	2,981,575.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	2,500,000.000	2,626,850.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	2,700,000.000	2,753,892.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	1,800,000.000	1,799,046.000	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	686,791.960	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,821,751.260	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,590,054.650	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	898,694.650	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,549,000.000	2,759,249.190	

		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,553,267.100	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,546,065.700	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,555,086.880	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,502,448.000	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,549,000.000	2,576,343.270	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,689,321.200	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,339,993.450	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,415,443.440	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,215,504.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,295,928.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,430,604.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,248,762.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,100,000.000	1,143,945.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	400,000.000	424,724.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,476,012.300	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,583,181.900	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,388,794.240	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,986,493.260	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,629,000.000	1,974,592.350	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,679,499.000	

		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,763,286.140	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,812,849.150	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,033,184.290	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,560,655.680	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,593,892.800	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,418,210.900	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,879,997.180	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,689,785.820	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	1,124,000.000	1,201,837.000	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	2,068,000.000	2,127,330.920	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,573,606.500	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,369,814.600	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,042,216.560	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,700,000.000	1,880,846.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,647,168.400	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,381,237.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,284,675.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,812,891.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,700,000.000	1,835,983.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,737,774.000	

		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,900,000.000	1,986,488.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,502,345.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,000,000.000	2,159,620.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	922,131.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,355,835.000	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	1,500,000.000	1,505,220.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,776,269.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	1,400,000.000	1,511,958.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,800,000.000	1,984,194.000	
		2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	1,200,000.000	1,252,368.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,000,000.000	1,215,190.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,660,687.500	
		1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,050,000.000	1,076,019.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,217,300.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	1,200,000.000	1,268,328.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,000,000.000	1,081,160.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	700,000.000	818,944.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,400,000.000	1,411,816.000	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	737,572.800	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	700,000.000	691,019.000	

		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	300,000.000	299,118.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,787,383.420	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,239,198.040	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	2,055,000.000	3,074,834.850	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,566,619.420	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,654,230.400	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,906,242.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	3,018,211.920	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,615,009.210	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,596,604.460	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	3,033,773.280	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,541,960.000	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,248,241.280	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,470,345.810	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,235,714.280	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,900,429.870	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	2,710,000.000	3,128,559.500	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,147,267.200	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,165,163.980	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,613,000.000	2,390,191.790	

		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,567,725.960	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,823,126.760	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,531,964.370	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,355,251.400	
		2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,663,776.990	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,510,293.700	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,890,989.360	
		4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	970,268.950	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,904,289.560	
		4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,572,843.120	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,304,733.430	
		4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,495,423.440	
		4% Belgium Government Bond 20320328	980,000.000	1,441,776.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,471,291.560	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	953,000.000	1,642,838.580	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,713,758.550	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,037,396.250	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,471,306.590	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	1,004,000.000	1,147,913.360	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	706,068.470	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	943,640.000	
		0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	531,129.120	
		2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	1,022,422.720	

		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,156,275.530	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	662,172.500	
		IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	354,847.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	540,775.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	791,581.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	226,614.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	700,000.000	771,568.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	400,000.000	472,884.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,232,541.750	
		3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,433,477.920	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	2,110,812.220	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,160,670.000	
		3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	877,114.440	
		3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	974,590.800	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	388,000.000	838,468.000	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,020,997.320	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,043,727.650	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,014,743.940	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,026,952.160	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	831,909.080	
		3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	484,290.900	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	485,647.050	
		1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	331,144.320	
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	476,854.280	

		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	611,643.670	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	586,364.760	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,552,413.760	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,445,000.000	2,659,646.550	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,367,720.720	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	2,015,516.160	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,939,972.190	
		0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,780,420.110	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,552,000.000	2,150,140.800	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,150,000.000	1,856,732.500	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,030,000.000	2,194,287.900	
		0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,117,648.000	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,500,000.000	2,742,400.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,850,000.000	2,256,149.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,247,087.000	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	1,300,000.000	1,307,111.000	
		0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,635,792.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,600,000.000	1,750,240.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,752,400.000	
		0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	1,400,000.000	1,429,120.000	

		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,079,398.000	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,200,000.000	1,209,852.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,900,000.000	2,090,494.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,100,000.000	1,269,510.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	900,000.000	914,949.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,200,000.000	2,243,714.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,233,032.930	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,546,944.980	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,708,000.000	2,959,776.120	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,026,742.720	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	3,206,557.270	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,759,781.750	
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,719,041.950	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,715,099.450	
		5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,240,342.140	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,072,041.440	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,239,986.320	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,518,940.100	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,428,337.610	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,309,293.100	

		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,388,524.940	
	ユーロ　小計			ユーロ 581,080,435.690 (70,932,488,785)	
	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	24,506,858.200	
		6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,612,000.000	8,259,731.720	
		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	6,138,417.600	
		7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	9,999,000.000	8,401,659.750	
		7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	8,439,000.000	8,574,024.000	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	22,552,000.000	19,568,370.400	
		8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,696,386.010	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	14,862,000.000	13,802,042.160	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	12,644,000.000	11,006,349.120	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	10,743,000.000	9,810,185.310	
		8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	10,166,000.000	9,418,087.380	
		9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	8,679,000.000	7,848,072.540	
	南アフリカ・ランド　小計			南アフリカ・ランド 141,656,343.990 (1,076,588,214)	
国債証券　合計				188,425,986,916 [188,425,986,916]	
合計				188,425,986,916 [188,425,986,916]	

（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%	48.0%
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%	0.9%
ユーロ	国債証券	304銘柄	100%	37.6%
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12月30日

Ⅰ	資産総額	137,004,152円
Ⅱ	負債総額	15,721円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	136,988,431円
Ⅳ	発行済数量	98,730,211口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3875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12月30日

Ⅰ	資産総額	169,845,085,798円
Ⅱ	負債総額	11,544,804,005円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	158,300,281,793円
Ⅳ	発行済数量	141,195,423,688口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1211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12月30日

Ⅰ	資産総額	135,752,817,795円
Ⅱ	負債総額	119,590,641円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	135,633,227,154円
Ⅳ	発行済数量	47,903,542,741口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8314円

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

純資産額計算書

2019年12月30日

Ⅰ	資産総額	383,557,030,855円
Ⅱ	負債総額	3,159,305,203円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	380,397,725,652円
Ⅳ	発行済数量	115,257,453,523口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3004円

(参考) ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2019年12月30日

Ⅰ	資産総額	27,627,260,932円
Ⅱ	負債総額	2,600,638円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	27,624,660,294円
Ⅳ	発行済数量	10,767,989,139口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5654円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

純資産額計算書

2019年12月30日

Ⅰ	資産総額	20,791,800,822円
Ⅱ	負債総額	67,988,367円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	20,723,812,455円
Ⅳ	発行済数量	15,926,587,272口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3012円

(参考) ダイワ短期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12月30日

Ⅰ	資産総額	4,208,767円
Ⅱ	負債総額	0円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,208,767円

Ⅳ　発行済数量	4,013,246口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0487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12月30日

Ⅰ　資産総額	193,500,607,866円
Ⅱ　負債総額	721,436,161円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	192,779,171,705円
Ⅳ　発行済数量	66,705,505,834口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8900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12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12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	63	112,878
追加型株式投資信託	699	16,658,358
株式投資信託　　合計	762	16,771,237
単位型公社債投資信託	29	93,384
追加型公社債投資信託	14	1,514,905
公社債投資信託　合計	43	1,608,290
総合計	805	18,379,526

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

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

当事業年度（自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	**10～18年**
器具備品	**４～20年**

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（会計方針の変更）

（税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用）

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

（未適用の会計基準等）

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

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

（損益計算書）

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

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

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

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

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

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

※２　関係会社項目

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

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

３　保証債務

前事業年度（2018年３月31日）

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

当事業年度（2019年３月31日）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

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

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

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

① 剰余金の配当の総額	12,669百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ １株当たり配当額	4,857円
④ 基準日	2018年３月31日
⑤ 効力発生日	2018年６月26日

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	―	―	2,608
合　　計	2,608	―	―	2,608

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年６月25日定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年３月31日	2018年６月26日

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

2019年６月21日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額	11,868百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ １株当たり配当額	4,550円
④ 基準日	2019年３月31日
⑤ 効力発生日	2019年６月24日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

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

（ii）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2018年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表　　計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	28,709	28,709	－
（２）未収委託者報酬	12,368	12,368	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	7,631	7,631	－
資産計	48,709	48,709	－
（１）未払手数料	(5,202)	(5,202)	－
（２）その他未払金	(4,476)	(4,476)	－
（３）未払費用（*2）	(3,286)	(3,286)	－
負債計	(12,965)	(12,965)	－

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

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

当事業年度（2019年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表　　計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	28,489	28,489	－
（２）未収委託者報酬	11,468	11,468	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	8,380	8,380	－
資産計	48,338	48,338	－
（１）未払手数料	(4,610)	(4,610)	－
（２）その他未払金	(3,882)	(3,882)	－
（３）未払費用（*2）	(2,805)	(2,805)	－
負債計	(11,298)	(11,298)	－

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

資　産

（１）現金・預金、並びに（２）未収委託者報酬

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

（３）有価証券及び投資有価証券

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

負　債

（１）未払手数料、（２）その他未払金、並びに（３）未払費用

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

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

（注３）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年３月31日）

（単位：百万円）

	１年以内	１年超５年以内	５年超10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

当事業年度（2019年３月31日）

（単位：百万円）

	１年以内	１年超５年以内	５年超10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2018年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（2019年３月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2018年３月31日）

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

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

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

当事業年度（2019年３月31日）

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

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

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

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

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

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

３．確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

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

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

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

前事業年度（2018年３月31日）

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

当事業年度（2019年３月31日）

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

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	－	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,063	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

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

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

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

(注３)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

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　大和証券株式会社

②　資本金の額　100,000百万円（2019年3月末日現在）

③　事業の内容　金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２　【関係業務の概要】

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

2020年1月31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ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020の2018年12月19日から2019年12月18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、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020の2019年12月18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。