【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8月28日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワ・ライフ・バランス７０
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部　【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワ・ライフ・バランス７０

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

(5) 【申込手数料】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

② 申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

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

(7) 【申込期間】

2020年8月29日から2021年2月26日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

①　受益権の取得申込者は、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。

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

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

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

⑤　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。

⑥　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、国内外の株式および債券に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

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

（注1）商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

- 「その他資産」…組入れている資産
- 「資産複合　資産配分固定型」…目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- 「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

＜信託金の限度額＞

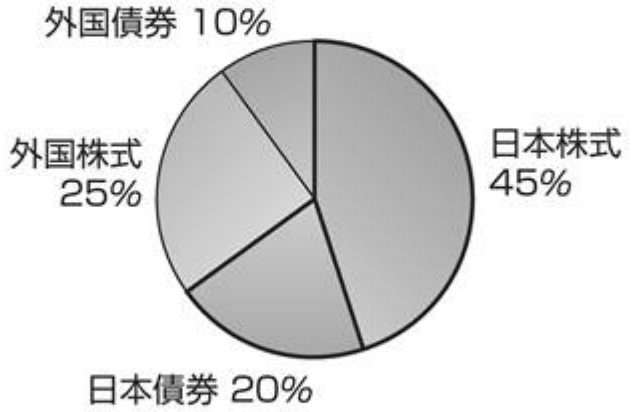
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国 内	海 外	合 計
株 式	45%	25%	70%
債 券	20%	10%	30%
合 計	65%	35%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

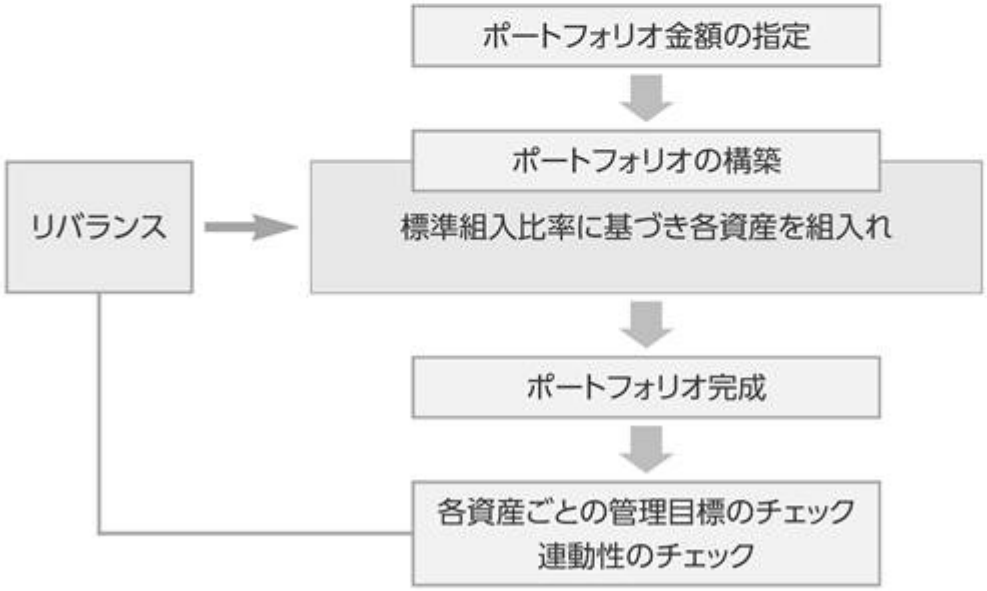
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

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

・安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。
(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
(b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的
(c) 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的

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

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

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

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

各マザーファンドの運用プロセス

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

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

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

NOMURA-BPI総合指数とは
NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。
NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

3．外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

4．外国債券インデックスマザーファンド

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

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2005年6月6日　　信託契約締結、当初設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

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	大和アセットマネジメント株式会社	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：株式会社日本カストディ銀行	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株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

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

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

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

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

＜委託会社の概況（2020年6月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
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）
2020年 4月 1日	大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

・大株主の状況

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

2　【投資方針】

(1)　【投資方針】

①　主要投資対象

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

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

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

3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
（ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース））
4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

② 投資態度

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

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

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の45%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）受益証券：信託財産の純資産総額の20%
外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の25%
外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の10%

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

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

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

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
(b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的
(c) 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的

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

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

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

(2) 【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

3．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

14．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

21．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

24．外国の者に対する権利で前23.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

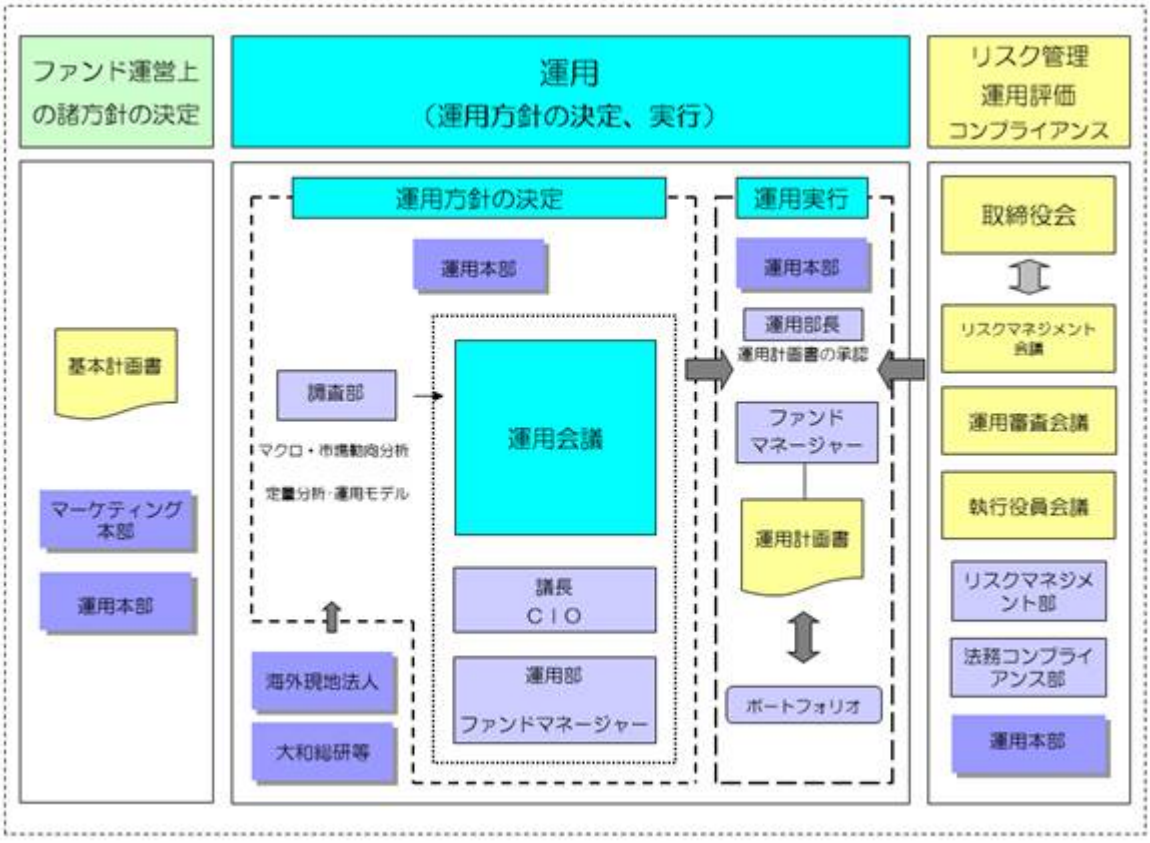
6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3) 【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品担当役員の決裁により決定します。

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）（2名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・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決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．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25～35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2020年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

②　原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

②　新株引受権証券等（信託約款）

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

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

③　投資信託証券（信託約款）

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

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

④　投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤　同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑥　信用取引（信託約款）

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

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

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

⑦　先物取引等（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

⑧　スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑨　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

⑩　デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑪　同一銘柄の転換社債等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総

額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

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

⑫　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

⑬　外貨建資産（信託約款）

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

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

⑭　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑮　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑯　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑰　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

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

(注）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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

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

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

２．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

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

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

⑤ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

(注）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数とは

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

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

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）ＭＳＣＩコクサイ指数とは

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

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

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

(3) 主な投資制限

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

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなく

なることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

③　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

④　その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3) その他の留意点

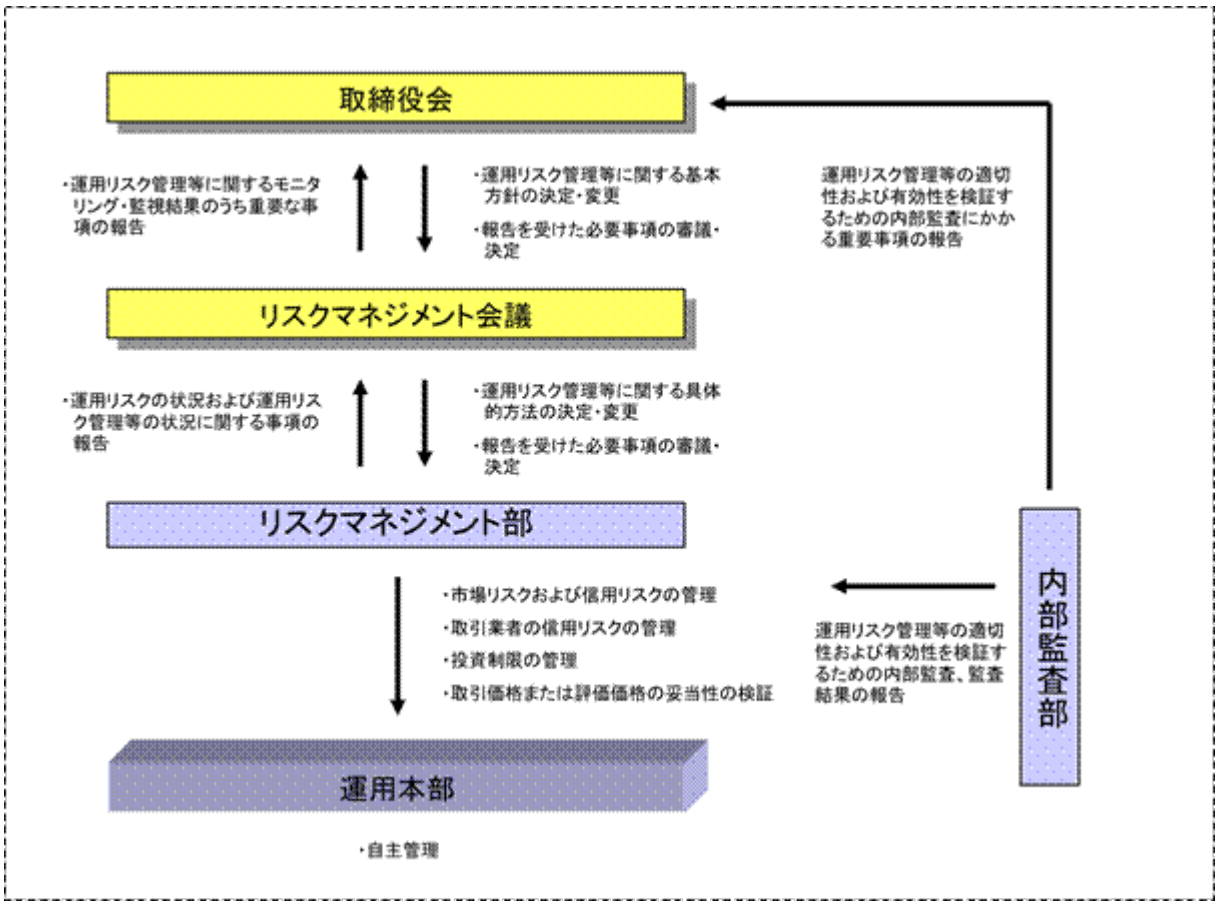
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

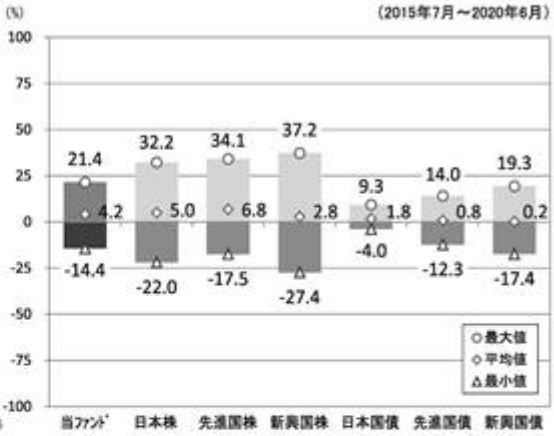
当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

※資産クラスについて
日 本 株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
日本国債：NOMURA-BPI国債
先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について
●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

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

② 申込手数料には、消費税等が課されます。

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

(2) 【換金(解約)手数料】

① 換金手数料
ありません。

② 信託財産留保額
ありません。

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.242%（税抜0.22%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.09% （税抜）	年率0.10% （税抜）	年率0.03% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

※「つみたてＮＩＳＡ」をご利用の場合

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

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

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

② 法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

＜注1＞個別元本について

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

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

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

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

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2020年6月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

す。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】 (2020年6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		7,548,296,131	99.60
	内 日本	7,548,296,131	99.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		30,106,157	0.40
純資産総額		7,578,402,288	100.00

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

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

(2) 【投資資産】 (2020年6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	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,285,764,221	1.0635 3,494,538,815	1.0298 3,383,679,994	44.65
2	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	740,534,025	2.6678 1,975,596,690	2.5896 1,917,686,911	25.30
3	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	1,156,752,032	1.2892 1,491,332,559	1.2895 1,491,631,745	19.68
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	253,073,373	2.9981 758,752,218	2.9845 755,297,481	9.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第6計算期間末 (2011年6月6日)	359,093,189	359,093,189	0.9396	0.9396
第7計算期間末 (2012年6月5日)	1,208,963,087	1,208,963,087	0.8732	0.8732
第8計算期間末 (2013年6月5日)	2,081,871,172	2,081,871,172	1.2586	1.2586
第9計算期間末 (2014年6月5日)	2,725,931,441	2,725,931,441	1.4313	1.4313
第10計算期間末 (2015年6月5日)	3,825,801,208	3,825,801,208	1.7864	1.7864
第11計算期間末 (2016年6月6日)	3,825,740,833	3,825,740,833	1.5681	1.5681
第12計算期間末 (2017年6月5日)	4,710,824,279	4,710,824,279	1.8085	1.8085
第13計算期間末 (2018年6月5日)	6,062,194,684	6,062,194,684	1.9623	1.9623
第14計算期間末 (2019年6月5日)	6,388,879,598	6,388,879,598	1.8661	1.8661
2019年6月末日	6,575,904,374	－	1.9005	－
7月末日	6,741,933,980	－	1.9218	－
8月末日	6,676,923,479	－	1.8754	－
9月末日	6,902,333,130	－	1.9374	－
10月末日	7,191,363,419	－	2.0001	－

11月末日	7,354,352,544	－	2.0347	－
12月末日	7,545,710,852	－	2.0627	－
2020年1月末日	7,570,891,181	－	2.0468	－
2月末日	7,146,569,030	－	1.9182	－
3月末日	6,672,533,139	－	1.8018	－
4月末日	7,019,785,996	－	1.8792	－
5月末日	7,432,573,619	－	1.9577	－
第15計算期間末 (2020年6月5日)	7,673,201,997	7,673,201,997	2.0127	2.0127
6月末日	7,578,402,288	－	1.9671	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第6計算期間	2.4
第7計算期間	△7.1
第8計算期間	44.1
第9計算期間	13.7
第10計算期間	24.8
第11計算期間	△12.2
第12計算期間	15.3
第13計算期間	8.5
第14計算期間	△4.9
第15計算期間	7.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第6計算期間	289,830,509	29,861,276
第7計算期間	1,122,159,350	119,875,964
第8計算期間	507,894,095	238,281,222
第9計算期間	603,882,364	353,516,691
第10計算期間	656,287,666	419,084,684
第11計算期間	794,789,749	496,658,896
第12計算期間	690,779,192	525,696,208
第13計算期間	977,998,408	493,482,793
第14計算期間	1,104,627,595	770,346,836
第15計算期間	1,113,004,887	724,239,121

（参考）マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2020年6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	143,078,737,510	97.81
内 日本	143,078,737,510	97.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,209,998,665	2.19
純資産総額	146,288,736,175	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3,117,000,000	2.13
内 日本	3,117,000,000	2.13

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

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

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

(2) 投資資産（2020年6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	729,700	7,330.12 5,348,794,957	6,762.00 4,934,231,400	3.37
2	ソ ニ ー	日本	株式	電気機器	409,800	6,380.14 2,614,581,478	7,384.00 3,025,963,200	2.07
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報･通信業	510,100	4,539.51 2,315,607,546	5,450.00 2,780,045,000	1.90
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	59,300	33,481.59 1,985,458,565	45,030.00 2,670,279,000	1.83
5	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	858,100	2,625.25 2,252,731,969	2,515.50 2,158,550,550	1.48
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	544,100	3,750.10 2,040,429,818	3,848.00 2,093,696,800	1.43
7	任 天 堂	日本	株式	その他製品	40,100	41,698.66 1,672,116,355	48,010.00 1,925,201,000	1.32
8	三菱UFJﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	4,409,700	557.70 2,459,304,712	421.60 1,859,129,520	1.27
9	ﾘｸﾙｰﾄﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	日本	株式	サービス業	448,900	3,420.82 1,535,610,079	3,682.00 1,652,849,800	1.13
10	第一三共	日本	株式	医薬品	187,400	7,064.75 1,323,935,920	8,806.00 1,650,244,400	1.13
11	ＫＤＤＩ	日本	株式	情報･通信業	468,300	2,884.55 1,350,835,362	3,234.00 1,514,482,200	1.04
12	ダイキン工業	日本	株式	機械	83,400	14,426.65 1,203,183,223	17,335.00 1,445,739,000	0.99
13	本田技研	日本	株式	輸送用機器	514,500	2,864.95 1,474,020,613	2,755.50 1,417,704,750	0.97
14	信越化学	日本	株式	化学	109,900	11,741.89 1,290,433,885	12,595.00 1,384,190,500	0.95
15	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	446,100	3,734.05 1,665,761,225	3,032.00 1,352,575,200	0.92
16	花 王	日本	株式	化学	156,500	7,988.98 1,250,275,828	8,540.00 1,336,510,000	0.91
17	ＨＯＹＡ	日本	株式	精密機器	130,000	8,917.79 1,159,313,102	10,260.00 1,333,800,000	0.91
18	ＮＴＴﾄﾞｺﾓ	日本	株式	情報･通信業	458,400	2,832.04 1,298,210,069	2,882.00 1,321,108,800	0.90

19	村田製作所	日本	株式	電気機器	192,100	5,108.27 981,299,821	6,316.00 1,213,303,600	0.83
20	ファナック	日本	株式	電気機器	61,600	20,168.18 1,242,360,299	19,260.00 1,186,416,000	0.81
21	中外製薬	日本	株式	医薬品	204,900	2,749.71 563,416,764	5,765.00 1,181,248,500	0.81
22	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,762,900	165.80 1,452,921,091	132.20 1,158,455,380	0.79
23	日本電産	日本	株式	電気機器	157,700	7,583.60 1,195,934,371	7,196.00 1,134,809,200	0.78
24	SMC	日本	株式	機械	20,500	45,540.76 933,585,779	55,180.00 1,131,190,000	0.77
25	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	41,500	20,809.91 863,611,621	26,440.00 1,097,260,000	0.75
26	東京海上HD	日本	株式	保険業	228,200	5,827.20 1,329,768,685	4,698.00 1,072,083,600	0.73
27	日 立	日本	株式	電気機器	314,200	4,027.26 1,265,365,439	3,403.00 1,069,222,600	0.73
28	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	450,300	2,294.79 1,033,345,381	2,321.50 1,045,371,450	0.71
29	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	566,700	1,543.55 874,731,263	1,799.50 1,019,776,650	0.70
30	三菱商事	日本	株式	卸売業	422,700	2,758.62 1,166,071,535	2,270.00 959,529,000	0.66

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.81%
合計	97.81%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.19%
建設業	2.52%
食料品	3.85%
繊維製品	0.50%

パルプ・紙	0.23%
化学	7.15%
医薬品	6.75%
石油・石炭製品	0.41%
ゴム製品	0.61%
ガラス・土石製品	0.76%
鉄鋼	0.56%
非鉄金属	0.67%
金属製品	0.54%
機械	5.17%
電気機器	14.79%
輸送用機器	7.11%
精密機器	2.59%
その他製品	2.44%
電気・ガス業	1.52%
陸運業	3.93%
海運業	0.13%
空運業	0.34%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	9.75%
卸売業	4.37%
小売業	4.87%
銀行業	4.84%
証券、商品先物取引業	0.77%
保険業	1.96%
その他金融業	1.12%
不動産業	1.96%
サービス業	5.16%
合計	97.81%

(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9月	買建	200	3,160,217,800	3,117,000,000	2.13%

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

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資状況（2020年6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		18,182,456,940	84.42
	内 日本	18,182,456,940	84.42
地方債証券		1,560,745,100	7.25
	内 日本	1,560,745,100	7.25
特殊債券		834,558,800	3.87
	内 日本	834,558,800	3.87
社債券		830,681,300	3.86
	内 日本	830,681,300	3.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		129,303,302	0.60
純資産総額		21,537,745,442	100.00

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

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

(2) 投資資産（2020年6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	137 5年国債	日本	国債証券	410,000,000	100.90 413,719,900	100.76 413,116,000	0.100000 2023/09/20	1.92
2	334 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	103.34 330,696,600	102.91 329,321,600	0.600000 2024/06/20	1.53
3	345 10年国債	日本	国債証券	280,000,000	101.85 285,188,400	101.30 283,645,600	0.100000 2026/12/20	1.32

4	138 5年国債	日本	国債証券	280,000,000	100.95 282,674,600	100.80 282,245,600	0.100000 2023/12/20	1.31
5	135 5年国債	日本	国債証券	260,000,000	100.94 262,451,500	100.66 261,736,800	0.100000 2023/03/20	1.22
6	130 5年国債	日本	国債証券	247,000,000	100.55 248,367,880	100.38 247,946,010	0.100000 2021/12/20	1.15
7	139 5年国債	日本	国債証券	240,000,000	101.12 242,694,800	100.85 242,061,600	0.100000 2024/03/20	1.12
8	133 5年国債	日本	国債証券	230,000,000	100.83 231,916,100	100.54 231,255,800	0.100000 2022/09/20	1.07
9	349 10年国債	日本	国債証券	220,000,000	101.89 224,162,000	101.39 223,060,200	0.100000 2027/12/20	1.04
10	335 10年国債	日本	国債証券	210,000,000	103.21 216,751,500	102.65 215,569,200	0.500000 2024/09/20	1.00
11	348 10年国債	日本	国債証券	210,000,000	101.85 213,898,400	101.38 212,900,100	0.100000 2027/09/20	0.99
12	353 10年国債	日本	国債証券	210,000,000	101.47 213,101,050	101.19 212,499,000	0.100000 2028/12/20	0.99
13	352 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.76 203,534,100	101.28 202,560,000	0.100000 2028/09/20	0.94
14	358 10年国債	日本	国債証券	195,000,000	101.07 197,092,650	100.72 196,417,650	0.100000 2030/03/20	0.91
15	337 10年国債	日本	国債証券	190,000,000	102.15 194,102,650	101.86 193,543,500	0.300000 2024/12/20	0.90
16	131 5年国債	日本	国債証券	190,000,000	100.64 191,223,600	100.43 190,817,000	0.100000 2022/03/20	0.89
17	356 10年国債	日本	国債証券	185,000,000	101.44 187,676,100	100.92 186,705,700	0.100000 2029/09/20	0.87
18	129 5年国債	日本	国債証券	182,000,000	100.49 182,900,900	100.32 182,589,680	0.100000 2021/09/20	0.85
19	347 10年国債	日本	国債証券	180,000,000	101.94 183,502,800	101.36 182,462,400	0.100000 2027/06/20	0.85
20	351 10年国債	日本	国債証券	180,000,000	101.84 183,319,600	101.32 182,377,800	0.100000 2028/06/20	0.85
21	406 2年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.52 180,948,600	100.35 180,639,000	0.100000 2021/11/01	0.84
22	141 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.23 172,100,600	100.95 171,621,800	0.100000 2024/09/20	0.80
23	134 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.85 171,455,300	100.60 171,031,900	0.100000 2022/12/20	0.79

24	132 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.71 171,215,500	100.48 170,821,100	0.100000 2022/06/20	0.79
25	350 10年国債	日本	国債証券	165,000,000	101.88 168,113,750	101.35 167,240,700	0.100000 2028/03/20	0.78
26	329 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.49 165,593,600	102.80 164,484,800	0.800000 2023/06/20	0.76
27	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	102.74 164,384,000	102.10 163,369,600	0.800000 2022/09/20	0.76
28	408 2年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.49 160,795,200	100.39 160,627,200	0.100000 2022/01/01	0.75
29	403 2年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.45 160,731,200	100.29 160,476,800	0.100000 2021/08/01	0.75
30	145 20年国債	日本	国債証券	130,000,000	120.98 157,279,740	119.49 155,338,300	1.700000 2033/06/20	0.72

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	84.42%
地方債証券	7.25%
特殊債券	3.87%
社債券	3.86%
合計	99.40%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2020年6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		127,350,238,702	96.33
	内 香港	1,456,992,458	1.10
	内 シンガポール	427,671,980	0.32
	内 イスラエル	288,246,284	0.22
	内 ノルウェー	241,112,922	0.18
	内 スウェーデン	1,396,258,433	1.06
	内 デンマーク	1,073,325,267	0.81
	内 イギリス	6,330,180,902	4.79
	内 アイルランド	284,418,796	0.22
	内 オランダ	1,939,330,875	1.47
	内 ベルギー	406,600,632	0.31
	内 フランス	4,852,834,480	3.67
	内 ドイツ	4,152,984,560	3.14
	内 スイス	4,666,430,221	3.53
	内 ポルトガル	76,230,624	0.06
	内 スペイン	1,088,949,249	0.82
	内 イタリア	1,035,755,987	0.78
	内 フィンランド	445,960,240	0.34
	内 オーストリア	76,539,421	0.06
	内 カナダ	4,436,389,078	3.36
	内 アメリカ	89,906,431,958	68.00
	内 オーストラリア	2,621,834,490	1.98
	内 ニュージーランド	145,759,845	0.11
投資証券		3,390,720,443	2.56
	内 香港	86,920,592	0.07
	内 シンガポール	74,129,468	0.06
	内 イギリス	70,627,511	0.05
	内 フランス	76,104,562	0.06
	内 カナダ	23,178,311	0.02
	内 アメリカ	2,733,504,466	2.07
	内 オーストラリア	326,255,533	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,465,991,389	1.11
純資産総額		132,206,950,534	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

株価指数先物取引(買建)		1,660,419,699	1.26
	内 イギリス	57,532,529	0.04
	内 ドイツ	194,027,190	0.15
	内 カナダ	58,192,224	0.04
	内 アメリカ	1,297,040,111	0.98
	内 オーストラリア	53,627,645	0.04
為替予約取引(買建)		886,688,890	0.67
	内 日本	886,688,890	0.67

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

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

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

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

(2) 投資資産（2020年6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	139,200	28,909.01 4,024,137,214	38,978.17 5,425,762,266	4.10
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	230,000	16,534.53 3,802,960,957	21,379.92 4,917,382,888	3.72
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	13,460	197,797.06 2,662,349,332	288,784.14 3,887,034,541	2.94
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	76,600	21,604.13 1,654,879,612	23,771.75 1,820,916,326	1.38
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	9,787	140,917.99 1,379,165,337	150,294.06 1,470,928,042	1.11

6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	9,560	140,884.27 1,346,854,012	150,531.09 1,439,077,276	1.09
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	84,000	14,869.19 1,249,014,844	14,980.16 1,258,334,246	0.95
8	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	95,900	11,763.55 1,128,134,264	11,879.04 1,139,200,166	0.86
9	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	54,400	19,890.63 1,082,052,644	20,619.28 1,121,688,897	0.85
10	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	78,717	13,118.20 1,032,633,547	12,676.68 997,870,881	0.75
11	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	98,070	14,008.35 1,373,805,259	10,019.82 982,643,747	0.74
12	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	30,226	30,050.94 908,320,129	31,218.74 943,617,708	0.71
13	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	34,800	23,806.44 828,468,023	26,516.96 922,790,514	0.70
14	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	28,550	31,504.14 899,444,388	31,560.27 901,045,943	0.68
15	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	136,400	6,262.60 854,229,896	6,278.00 856,320,537	0.65
16	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	22,630	35,143.48 795,298,726	37,526.76 849,230,782	0.64
17	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	44,150	23,313.21 1,029,280,569	19,090.45 842,843,394	0.64
18	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	131,704	6,448.02 849,241,583	5,892.30 776,039,558	0.59
19	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	19,500	24,900.86 485,568,773	39,648.32 773,142,240	0.58
20	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	228,791	3,991.98 913,335,207	3,222.50 737,279,775	0.56
21	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	15,350	33,805.25 518,911,502	45,703.30 701,545,778	0.53

22	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	57,562	15,910.82 915,862,990	12,015.16 691,616,916	0.52
23	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	13,970	34,778.04 485,850,373	48,185.63 673,153,357	0.51
24	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	135,250	4,862.84 657,704,271	4,972.20 672,490,185	0.51
25	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	80,821	9,328.02 753,902,654	8,201.16 662,826,664	0.50
26	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	69,200	10,328.60 714,741,355	9,439.15 653,189,277	0.49
27	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	135,005	7,101.25 958,711,154	4,775.03 644,653,843	0.49
28	PAYPAL HOLDINGS INC	アメリカ	株式	情報技術	35,450	11,750.77 416,568,360	18,138.02 642,993,128	0.49
29	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	250,101	3,549.38 887,725,510	2,520.03 630,264,174	0.48
30	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	44,300	14,624.19 647,852,310	14,122.55 625,629,373	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	96.33%
投資証券	2.56%
合計	98.89%

(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	3.42%
素材	4.26%
資本財・サービス	9.08%
一般消費財・サービス	10.23%
生活必需品	8.25%
ヘルスケア	14.17%

金融	12.80%
情報技術	21.62%
コミュニケーション・サービス	8.60%
公益事業	3.44%
不動産	0.46%
合計	96.33%

(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9月	買建	79	1,288,215,720	1,297,040,111	0.98%
	イギリス	FT 100 2020年9月	買建	7	56,705,567	57,532,529	0.04%
	オーストラリア	SPI 200 INDEX 2020年9月	買建	5	53,481,547	53,627,645	0.04%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX 2020年9月	買建	4	57,816,506	58,192,224	0.04%
	ドイツ	SMI 2020年9月	買建	3	33,744,740	34,078,088	0.03%
		EURO STOXX 50 2020年9月	買建	41	157,732,248	159,949,102	0.12%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2020年7月	買建	7,080,000	759,626,940	762,728,400	0.58%
		カナダ・ドル買/円売 2020年7月	買建	227,000	17,886,970	17,885,330	0.01%
		ユーロ買/円売 2020年7月	買建	852,000	103,103,958	103,160,160	0.08%
		英ポンド買/円売 2020年7月	買建	22,000	2,915,195	2,915,000	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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2020年6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		194,006,139,067	98.20
	内 ユーロ	77,619,911,314	39.29
	内 シンガポール	849,027,800	0.43
	内 マレーシア	969,897,926	0.49
	内 イスラエル	739,376,948	0.37
	内 ノルウェー	398,315,812	0.20
	内 スウェーデン	539,918,987	0.27
	内 デンマーク	995,782,812	0.50
	内 イギリス	12,713,658,521	6.44
	内 ポーランド	1,144,670,898	0.58
	内 カナダ	3,683,093,197	1.86
	内 アメリカ	88,747,421,341	44.92
	内 メキシコ	1,498,493,034	0.76
	内 オーストラリア	4,106,570,477	2.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,560,744,473	1.80
純資産総額		197,566,883,540	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）		2,921,292,790	1.48
	内 日本	2,921,292,790	1.48

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

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

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

(2) 投資資産（2020年6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	6,700,000	108.99 786,767,471	118.57 855,964,779	2.875000 2028/08/15	0.43
2	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,764,000	182.46 831,597,815	184.10 839,026,765	4.500000 2041/04/25	0.42
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	107.23 762,523,816	117.36 834,577,958	2.625000 2029/02/15	0.42
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	108.81 762,021,317	118.17 827,563,330	2.875000 2028/05/15	0.42
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	98.53 732,544,838	109.28 812,401,510	1.625000 2029/08/15	0.41
6	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,200,000	106.12 796,709,184	106.28 797,892,257	0.250000 2027/02/15	0.40
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	105.45 727,123,829	112.98 779,065,354	2.375000 2027/05/15	0.39
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,450,000	99.94 694,569,273	110.57 768,431,954	1.750000 2029/11/15	0.39
9	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,571,000	172.39 745,395,307	172.62 746,390,243	4.000000 2037/01/04	0.38
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,668,000	100.04 718,712,052	103.45 743,245,764	1.625000 2022/11/15	0.38
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,140,000	103.96 687,761,910	111.81 739,662,767	2.250000 2027/02/15	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	103.32 685,988,268	108.81 722,396,208	2.375000 2024/08/15	0.37
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,520,000	125.03 608,881,965	147.65 719,062,276	3.375000 2048/11/15	0.36
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	103.71 659,300,061	112.44 714,774,633	2.250000 2027/08/15	0.36
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,650,000	107.65 655,335,445	116.79 710,973,458	2.750000 2028/02/15	0.36
16	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,730,000	102.17 708,879,980	102.05 708,073,503	— 2023/04/14	0.36
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	101.11 684,927,506	104.42 707,307,526	2.000000 2022/11/30	0.36
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,700,000	117.11 593,034,877	138.70 702,361,477	3.000000 2049/02/15	0.36

19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	102.85 656,115,882	108.71 693,543,150	2.250000 2024/11/15	0.35
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	103.11 648,813,813	110.21 693,493,419	2.250000 2025/11/15	0.35
21	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,448,000	165.72 691,891,860	164.46 686,598,098	5.500000 2031/01/04	0.35
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,650,000	114.37 573,008,456	135.94 681,072,214	2.875000 2049/05/15	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	102.32 638,116,507	108.92 679,280,285	2.125000 2025/05/15	0.34
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,250,000	105.66 671,676,467	106.73 678,495,087	0.500000 2029/05/25	0.34
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,387,000	126.39 671,390,052	126.88 673,958,595	2.500000 2030/05/25	0.34
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	101.75 629,622,271	108.62 672,118,078	2.000000 2025/08/15	0.34
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	103.78 614,975,071	112.78 668,306,371	2.250000 2027/11/15	0.34
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	101.71 629,380,959	107.99 668,201,385	2.000000 2025/02/15	0.34
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,900,000	111.23 587,233,206	121.06 639,117,774	3.125000 2028/11/15	0.32
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,200,000	119.31 539,896,344	140.78 637,045,287	3.125000 2048/05/15	0.32

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.20%
合計	98.20%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2020年8月	買建	349,000	25,820,276	25,777,140	0.01%
		豪ドル買/円売 2020年7月	買建	305,000	22,458,705	22,530,350	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2020年8月	買建	490,000	38,613,053	38,597,300	0.02%
		デンマーク・クローネ買/円売 2020年7月	買建	748,000	12,081,696	12,155,000	0.01%
		ユーロ買/円売 2020年7月	買建	13,975,000	1,679,913,825	1,692,093,000	0.86%
		英ポンド買/円売 2020年8月	買建	326,000	43,185,356	43,185,220	0.02%
		米ドル買/円売 2020年8月	買建	2,689,000	289,660,881	289,578,410	0.15%
		メキシコ・ペソ買/円売 2020年7月	買建	12,451,000	59,912,376	57,897,150	0.03%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2020年8月	買建	983,000	10,936,759	10,940,790	0.01%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2020年7月	買建	456,000	12,270,595	12,389,520	0.01%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2020年8月	買建	2,137,000	24,668,547	24,682,350	0.01%
		シンガポール・ドル買/円売 2020年7月	買建	268,000	20,422,136	20,716,400	0.01%
		米ドル買/円売 2020年7月	買建	5,642,000	605,854,696	607,812,660	0.31%
		英ポンド買/円売 2020年7月	買建	475,000	62,902,825	62,937,500	0.03%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワ・ライフ・バランス70

2020年6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	19,671円
純資産総額	75億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.5%
3カ月間	9.2%
6カ月間	-4.6%
1年間	3.5%
3年間	8.3%
5年間	12.3%
設定来	96.7%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第4期 09年6月	第5期 10年6月	第6期 11年6月	第7期 12年6月	第8期 13年6月	第9期 14年6月	第10期 15年6月	第11期 16年6月	第12期 17年6月	第13期 18年6月	第14期 19年6月	第15期 20年6月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式・先物	2,117	44.6%
外国株式・先物	1,219	24.7%
国内債券	274	19.6%
外国債券	787	9.8%
外国リート	65	0.6%
外国投資証券	6	0.0%
コール・ローン、その他		2.0%
合計	4,468	-

通貨別構成	比率
日本円	64.7%
米ドル	22.6%
ユーロ	6.8%
英ポンド	1.9%
カナダ・ドル	1.1%
スイス・フラン	0.9%
豪ドル	0.8%
スウェーデン・クローネ	0.3%
香港ドル	0.3%
その他	0.8%
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(%)	0.2
修正デュレーション	9.0
残存年数	10.1

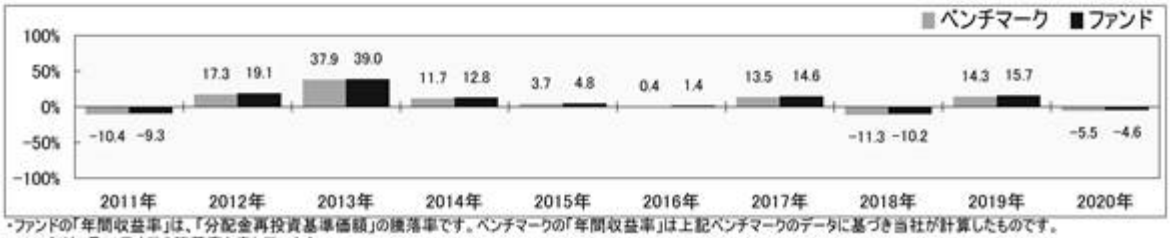
債券格付別構成	比率
AAA	86.0%
AA	5.8%
A	5.4%
BBB	-
BB以下・無格付	2.9%
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
トヨタ自動車	日本	1.5%
APPLE INC	アメリカ	1.0%
TOPIX先物 0209月	日本	1.0%
MICROSOFT CORP	アメリカ	0.9%
ソニー	日本	0.9%
ソフトバンクグループ	日本	0.8%
キーエンス	日本	0.8%
AMAZON.COM INC	アメリカ	0.7%
日本電信電話	日本	0.7%
武田薬品	日本	0.6%
合計		9.1%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.9%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2020年は6月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２ 【管理及び運営】

１ 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

２ 【換金(解約)手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

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

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

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

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

3　【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年6月6日から翌年6月5日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

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

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

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

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

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

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

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

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

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

② 信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

③ 反対者の買取請求権

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

④　運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤　公告

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

https://www.daiwa-am.co.jp/

2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥　関係法人との契約の更改

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

4　【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

①　収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

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

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

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

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

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

② 換金請求権

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

第３ 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（2019年6月6日から2020年6月5日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ・ライフ・バランス７０

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 2019年6月5日現在	第15期 2020年6月5日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,818,977	48,038,612
親投資信託受益証券	6,363,449,041	7,643,669,836
未収入金	－	20,703,000
流動資産合計	6,405,268,018	7,712,411,448
資産合計	6,405,268,018	7,712,411,448
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,228,345	30,227,579
未払受託者報酬	1,076,015	1,184,375
未払委託者報酬	6,815,033	7,501,290
その他未払費用	269,027	296,207
流動負債合計	16,388,420	39,209,451
負債合計	16,388,420	39,209,451
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,423,663,859	※1 3,812,429,625
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,965,215,739	3,860,772,372
（分配準備積立金）	955,333,579	1,050,377,246
元本等合計	6,388,879,598	7,673,201,997
純資産合計	6,388,879,598	7,673,201,997
負債純資産合計	6,405,268,018	7,712,411,448

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期 自　2018年6月6日 至　2019年6月5日	第15期 自　2019年6月6日 至　2020年6月5日
営業収益		
受取利息	7	127
有価証券売買等損益	△ 303,655,019	540,511,795
営業収益合計	△ 303,655,012	540,511,922
営業費用		
支払利息	24,636	18,007
受託者報酬	2,108,561	2,297,499
委託者報酬	13,354,672	14,551,299
その他費用	530,326	577,724
営業費用合計	16,018,195	17,444,529
営業利益又は営業損失（△）	△ 319,673,207	523,067,393
経常利益又は経常損失（△）	△ 319,673,207	523,067,393
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 319,673,207	523,067,393
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（△）	△ 40,072,077	26,339,032
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,972,811,584	2,965,215,739
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,006,850,489	1,034,622,297
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,006,850,489	1,034,622,297
剰余金減少額又は欠損金増加額	734,845,204	635,794,025
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	734,845,204	635,794,025
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,965,215,739	3,860,772,372

(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15期 自　2019年6月6日 至　2020年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第14期 2019年6月5日現在	第15期 2020年6月5日現在
1.　※1　期首元本額	3,089,383,100円	3,423,663,859円
期中追加設定元本額	1,104,627,595円	1,113,004,887円
期中一部解約元本額	770,346,836円	724,239,121円
2.　計算期間末日における受益権の総数	3,423,663,859口	3,812,429,625口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第14期 自　2018年6月6日 至　2019年6月5日	第15期 自　2019年6月6日 至　2020年6月5日

※1　分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,029,428,398円）及び分配準備積立金（955,333,579円）より分配可能額は4,984,761,977円（1万口当たり14,559.73円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（267,650,242円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,768,064,222円）及び分配準備積立金（782,727,004円）より分配可能額は5,818,441,468円（1万口当たり15,261.77円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第15期 自　2019年6月6日 至　2020年6月5日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第15期 2020年6月5日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第14期 2019年6月5日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第15期 2020年6月5日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△292,805,067	517,454,009
合計	△292,805,067	517,454,009

（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14期 2019年6月5日現在	第15期 2020年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自　2019年6月6日 至　2020年6月5日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第14期 2019年6月5日現在	第15期 2020年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8661円 (18,661円)	2.0127円 (20,127円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	3,285,045,086	3,493,973,953	
	外国株式インデックスマザーファンド	747,726,631	1,994,785,106	
	外国債券インデックスマザーファンド	244,898,386	734,548,218	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	1,101,824,963	1,420,362,559	
親投資信託受益証券　合計			7,643,669,836	
合計			7,643,669,836	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
		金　額（円）	金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		13,816,984,423	24,328,710,118
株式	※3※4	132,659,243,740	149,144,512,780
派生商品評価勘定		2,235,680	278,504,000
未収入金		―	15,790,100
未収配当金		1,177,332,110	1,337,070,499
未収利息		2,494,689	2,344,037
前払金		123,503,300	―
その他未収収益	※5	49,747,628	41,074,510
差入委託証拠金		―	50,430,000
流動資産合計		147,831,541,570	175,198,436,044
資産合計		147,831,541,570	175,198,436,044
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		76,274,840	―
前受金		―	281,953,600
未払解約金		88,964,000	360,378,460
受入担保金		12,706,116,012	22,490,327,285
その他未払費用		69,069	94,194
流動負債合計		12,871,423,921	23,132,753,539
負債合計		12,871,423,921	23,132,753,539
純資産の部			
元本等			
元本	※1	137,233,315,554	142,967,103,545
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△2,273,197,905	9,098,578,960
元本等合計		134,960,117,649	152,065,682,505
純資産合計		134,960,117,649	152,065,682,505
負債純資産合計		147,831,541,570	175,198,436,044

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年6月6日 至　2020年6月5日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在

1. ※1 期首	2018年6月6日	2019年6月6日
期首元本額	130,544,614,080円	137,233,315,554円
期中追加設定元本額	19,206,602,114円	40,152,364,293円
期中一部解約元本額	12,517,900,640円	34,418,576,302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	4,078,415,082円	3,459,619,359円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	7,837,093,397円	7,067,562,385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	28,823,749円	2,679,347円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	60,746,661円	55,902,878円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	976,873,994円	780,865,658円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	49,591,649円	40,741,510円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,345,790,812円	1,092,230,752円
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	16,262,184円	93,179,177円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	40,212,628円	55,564,362円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	19,956,909円	14,731,618円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	1,615,386円	23,839,256円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	1,079,173,827円	1,785,224,710円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,684,446,800円	2,416,435,560円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	41,227,884円	92,819,882円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	65,423,316,922円	65,943,708,454円

ダイワ・ライフ・バランス３０	2,828,018,505円	3,207,496,333円
ダイワ・ライフ・バランス５０	3,166,199,673円	3,747,158,396円
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,906,547,954円	3,285,045,086円
年金ダイワ日本株式インデックス	4,922,116,815円	5,135,540,799円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	15,526,759円	14,196,344円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	51,737,113円	54,321,811円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	18,075,776円	32,719,659円
ダイワつみたてインデックス日本株式	110,064,150円	606,007,503円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	11,880,333円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	7,017,784円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	－円	10,576,222円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	358,303円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	367,695円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	726,124円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	4,245,918円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	4,248,105円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	8,201,794円	－円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	168,271,660円	154,206,269円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	165,937,499円	158,516,417円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	9,582,707,612円	8,947,553,507円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	534,691円	－円

	ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	2,894,230円	－円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	825,721,462円	829,736,353円
	ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	127,351,633円	121,831,903円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	223,926,223円	223,747,786円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	163,870,546円	175,248,838円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	8,790,239,350円	11,103,093,364円
	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	1,952,601,712円	5,164,042,624円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	2,511,606,129円	2,053,074,608円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,424,632,811円	1,343,456,889円
	ダイワライフスタイル２５	193,069,689円	202,546,742円
	ダイワライフスタイル５０	678,512,244円	714,641,249円
	ダイワライフスタイル７５	558,569,318円	552,989,820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）	13,142,886,177円	12,185,351,998円
計		137,233,315,554円	142,967,103,545円
2.	期末日における受益権の総数	137,233,315,554口	142,967,103,545口
3. ※2	元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,273,197,905円であります。	－－－－－－－
4. ※3	貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。

	株式　12,389,784,010円	株式　21,577,014,350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　466,760,000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　520,800,000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45,630,413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38,235,875円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年6月6日 至　2020年6月5日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2020年6月5日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△20,777,613,092	636,961,961
新株予約権証券	－	0
合計	△20,777,613,092	636,961,961

（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2019年6月5日まで、及び2019年9月20日から2020年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種　類	2019年6月5日 現在				2020年6月5日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								

買 建	2,501,088,300	－	2,427,135,000	△73,953,300	2,499,201,400	－	2,777,800,000	278,598,600
合計	2,501,088,300	－	2,427,135,000	△73,953,300	2,499,201,400	－	2,777,800,000	278,598,600

（注） 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
1口当たり純資産額	0.9834円	1.0636円
（1万口当たり純資産額）	(9,834円)	(10,636円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備考	
		単 価	金 額		
極 洋	3,300	2,787.00	9,197,100		
日本水産	90,200	512.00	46,182,400		
マルハニチロ	13,100	2,368.00	31,020,800		
ホウスイ	500	935.00	467,500	貸付株式数	200株
カネコ種苗	2,700	1,430.00	3,861,000		
サカタのタネ	10,700	3,590.00	38,413,000	貸付株式数	4,300株
ホクト	6,800	1,984.00	13,491,200	貸付株式数	1,400株
ホクリヨウ	1,600	654.00	1,046,400	貸付株式数	500株
ヒノキヤグループ	2,200	1,823.00	4,010,600	貸付株式数	800株
ショーボンドＨＤ	14,000	4,915.00	68,810,000		
ミライト・ホールディングス	26,700	1,521.00	40,610,700		
タマホーム	5,000	1,268.00	6,340,000	貸付株式数	1,900株
サンヨーホームズ	1,200	643.00	771,600	貸付株式数	300株
日本アクア	3,800	609.00	2,314,200	貸付株式数	1,400株
ファーストコーポレーション	3,000	564.00	1,692,000	貸付株式数	1,000株

ベステラ	1,600	1,109.00	1,774,400		
スペースバリューＨＤ	11,100	377.00	4,184,700		
住石ホールディングス	18,400	118.00	2,171,200		
日鉄鉱業	2,100	4,485.00	9,418,500		
三井松島ＨＬＤＧＳ	3,400	909.00	3,090,600		
国際石油開発帝石	360,400	766.00	276,066,400	貸付株式数	70,300株
石油資源開発	11,900	2,108.00	25,085,200		
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,300	1,566.00	6,733,800		
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,009.00	1,816,200		
第一カッター興業	1,100	1,994.00	2,193,400		
安藤・間	52,300	694.00	36,296,200		
東急建設	26,000	587.00	15,262,000		
コムシスホールディングス	31,900	2,938.00	93,722,200		
ビーアールホールディングス	9,800	550.00	5,390,000		
高松コンストラクショングループ	5,600	2,373.00	13,288,800	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,700	7,330.00	19,791,000	貸付株式数	1,100株 (100株)
ソネック	900	824.00	741,600	貸付株式数	300株
ヤマウラ	4,000	831.00	3,324,000	貸付株式数	100株
大成建設	69,100	4,015.00	277,436,500		
大　林　組	204,800	1,078.00	220,774,400		
清水建設	208,100	934.00	194,365,400		
飛島建設	5,900	1,139.00	6,720,100		
長谷工コーポレーシヨン	79,900	1,345.00	107,465,500		
松井建設	8,200	654.00	5,362,800		
錢　高　組	900	3,825.00	3,442,500		
鹿島建設	161,200	1,266.00	204,079,200		
不動テトラ	5,400	1,442.00	7,786,800		
大末建設	2,300	795.00	1,828,500		
鉄建建設	4,600	2,190.00	10,074,000		
西松建設	15,900	2,112.00	33,580,800		
三井住友建設	49,600	477.00	23,659,200		
大豊建設	4,800	2,480.00	11,904,000		
前田建設	52,100	868.00	45,222,800		
佐田建設	4,500	413.00	1,858,500		
ナカノフドー建設	5,400	393.00	2,122,200		
奥　村　組	11,100	2,630.00	29,193,000		

東鉄工業	9,000	2,800.00	25,200,000		
イチケン	1,400	1,553.00	2,174,200		
富士ピー・エス	3,000	574.00	1,722,000		
淺沼組	2,400	4,300.00	10,320,000		
戸田建設	85,000	724.00	61,540,000		
熊　谷　組	9,600	2,642.00	25,363,200		
北野建設	1,300	2,678.00	3,481,400		
植　木　組	900	2,478.00	2,230,200		
矢作建設	9,100	776.00	7,061,600		
ピーエス三菱	6,400	558.00	3,571,200	貸付株式数	2,300株
日本ハウスＨＬＤＧＳ	14,200	307.00	4,359,400		
大東建託	22,400	11,690.00	261,856,000	貸付株式数	8,900株
新日本建設	8,700	857.00	7,455,900		
ＮＩＰＰＯ	17,000	2,582.00	43,894,000		
東亜道路	1,300	3,195.00	4,153,500		
前田道路	18,600	2,129.00	39,599,400		
日本道路	2,000	7,710.00	15,420,000		
東亜建設	6,500	1,578.00	10,257,000	貸付株式数	2,500株
日本国土開発	15,200	551.00	8,375,200	貸付株式数	6,100株
若築建設	3,500	1,190.00	4,165,000		
東洋建設	23,600	416.00	9,817,600		
五洋建設	82,500	562.00	46,365,000		
世紀東急	10,100	765.00	7,726,500		
福　田　組	2,400	4,890.00	11,736,000	貸付株式数	900株
日本ドライケミカル	1,700	1,600.00	2,720,000	貸付株式数	200株
住友林業	52,900	1,358.00	71,838,200		
日本基礎技術	7,300	423.00	3,087,900		
巴コーポレーション	9,200	387.00	3,560,400		
大和ハウス	204,500	2,938.00	600,821,000		
ライト工業	11,900	1,567.00	18,647,300		
積水ハウス	224,000	2,132.50	477,680,000		
日特建設	5,400	733.00	3,958,200		
北陸電気工事	3,500	928.00	3,248,000		
ユアテック	11,300	627.00	7,085,100		
四電工	1,000	2,406.00	2,406,000		
中電工	7,800	2,308.00	18,002,400		
関　電　工	29,800	969.00	28,876,200		
きんでん	49,200	1,807.00	88,904,400		
東京エネシス	6,800	806.00	5,480,800		
トーエネック	2,000	3,700.00	7,400,000		

住友電設	5,800	2,513.00	14,575,400	貸付株式数	2,200株
日本電設工業	11,500	2,448.00	28,152,000		
協和エクシオ	31,600	2,406.00	76,029,600		
新日本空調	5,500	2,479.00	13,634,500		
日本工営	4,300	3,165.00	13,609,500		
九電工	14,500	2,995.00	43,427,500		
三機工業	15,000	1,335.00	20,025,000		
日揮ホールディングス	64,000	1,239.00	79,296,000		
中外炉工業	2,200	1,638.00	3,603,600		
ヤマト	6,600	650.00	4,290,000		
太平電業	5,000	2,369.00	11,845,000		
高砂熱学	18,000	1,831.00	32,958,000		
三晃金属	800	2,173.00	1,738,400		
ＮＥＣネッツエスアイ	18,600	1,960.00	36,456,000		
朝日工業社	1,400	3,095.00	4,333,000	貸付株式数	500株
明星工業	13,400	790.00	10,586,000		
大　氣　社	10,200	3,240.00	33,048,000		
ダイダン	4,900	2,832.00	13,876,800		
日比谷総合設備	6,800	1,853.00	12,600,400	貸付株式数	900株
日本製粉	19,300	1,619.00	31,246,700		
日清製粉Ｇ本社	74,800	1,725.00	129,030,000		
日東富士製粉	400	6,120.00	2,448,000		
昭和産業	5,800	3,245.00	18,821,000	貸付株式数	2,400株
鳥越製粉	5,500	909.00	4,999,500	貸付株式数	2,200株
中部飼料	8,200	1,654.00	13,562,800		
フィード・ワン	45,000	191.00	8,595,000		
東洋精糖	1,200	1,251.00	1,501,200	貸付株式数	100株
日本甜菜糖	3,100	1,710.00	5,301,000		
三井製糖	5,400	2,090.00	11,286,000	貸付株式数	2,200株
塩水港精糖	6,400	213.00	1,363,200	貸付株式数	2,400株
日新製糖	2,900	1,980.00	5,742,000		
ＬＩＦＵＬＬ	22,200	428.00	9,501,600		
ジェイエイシーリクルートメント	4,300	1,319.00	5,671,700	貸付株式数	1,700株
日本M&Aセンター	47,900	4,560.00	218,424,000	貸付株式数	19,000株
メンバーズ	1,900	1,684.00	3,199,600		
中広	600	548.00	328,800	貸付株式数	200株
アイティメディア	2,000	1,279.00	2,558,000	貸付株式数	800株 (200株)
タケエイ	6,200	990.00	6,138,000		

Ｅ・Ｊホールディングス	1,200	1,500.00	1,800,000		
ビーネックスグループ	8,000	874.00	6,992,000		
コシダカホールディングス	15,300	527.00	8,063,100	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,800	870.00	1,566,000		
パソナグループ	7,000	1,279.00	8,953,000	貸付株式数	2,700株
ＣＤＳ	1,600	1,292.00	2,067,200	貸付株式数	400株
リンクアンドモチベーション	14,600	452.00	6,599,200	貸付株式数	4,500株
ＧＣＡ	7,800	680.00	5,304,000		
エス・エム・エス	19,900	2,671.00	53,152,900		
サニーサイドアップＧ	1,900	835.00	1,586,500	貸付株式数	700株
パーソルホールディングス	63,400	1,540.00	97,636,000	貸付株式数	24,500株
リニカル	3,200	935.00	2,992,000	貸付株式数	1,200株
クックパッド	22,600	305.00	6,893,000	貸付株式数	8,700株
エスクリ	2,000	454.00	908,000	貸付株式数	700株
アイ・ケイ・ケイ	3,100	604.00	1,872,400	貸付株式数	700株 (200株)
森永製菓	15,600	4,415.00	68,874,000		
中　村　屋	1,700	4,105.00	6,978,500		
江崎グリコ	19,700	5,190.00	102,243,000		
名糖産業	3,300	1,301.00	4,293,300		
井村屋グループ	2,800	2,070.00	5,796,000	貸付株式数	600株
不　二　家	3,600	2,164.00	7,790,400	貸付株式数	1,400株
山崎製パン	49,900	1,868.00	93,213,200	貸付株式数	19,800株
第一屋製パン	1,300	979.00	1,272,700	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	5,600.00	6,160,000	貸付株式数	400株
亀田製菓	3,700	5,360.00	19,832,000		
寿スピリッツ	6,400	5,220.00	33,408,000		
カルビー	30,300	3,110.00	94,233,000		
森永乳業	12,300	4,355.00	53,566,500		
六甲バター	4,200	1,561.00	6,556,200		
ヤクルト	45,700	6,720.00	307,104,000		
明治ホールディングス	43,700	8,270.00	361,399,000		
雪印メグミルク	16,100	2,590.00	41,699,000		
プリマハム	10,300	2,652.00	27,315,600	貸付株式数	2,700株
日本ハム	25,100	4,245.00	106,549,500		
林兼産業	2,300	584.00	1,343,200	貸付株式数	800株
丸大食品	7,000	1,957.00	13,699,000	貸付株式数	2,500株
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5,100	2,667.00	13,601,700	貸付株式数	2,000株

伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	40,600	659.00	26,755,400		
学情	2,400	1,374.00	3,297,600		
スタジオアリス	3,200	1,686.00	5,395,200	貸付株式数	1,200株
クロスキャット	1,800	1,172.00	2,109,600	貸付株式数	600株
シミックホールディングス	3,600	1,522.00	5,479,200		
システナ	23,500	1,513.00	35,555,500		
ＮＪＳ	1,400	1,813.00	2,538,200	貸付株式数	400株
デジタルアーツ	3,300	8,860.00	29,238,000	貸付株式数	1,200株
日鉄ソリューションズ	10,000	3,000.00	30,000,000		
綜合警備保障	25,200	5,380.00	135,576,000		
キューブシステム	3,500	772.00	2,702,000	貸付株式数	1,300株
いちご	83,300	307.00	25,573,100		
エイジア	1,400	1,321.00	1,849,400		
日本駐車場開発	75,200	147.00	11,054,400		
コア	2,800	1,196.00	3,348,800		
カカクコム	46,700	2,733.00	127,631,100	貸付株式数	11,200株
アイロムグループ	2,400	2,962.00	7,108,800	貸付株式数	900株
セントケア・ホールディング	3,900	410.00	1,599,000	貸付株式数	300株
サイネックス	1,100	671.00	738,100		
ルネサンス	3,500	1,241.00	4,343,500		
ディップ	9,000	2,563.00	23,067,000	貸付株式数	3,600株
ＳＢＳホールディングス	5,700	2,400.00	13,680,000		
オプトホールディング	3,400	1,522.00	5,174,800	貸付株式数	1,300株
新日本科学	7,100	659.00	4,678,900	貸付株式数	2,600株
ツクイ	15,000	548.00	8,220,000		
キャリアデザインセンター	1,700	1,008.00	1,713,600		
ベネフィット・ワン	17,300	2,338.00	40,447,400		
エムスリー	139,600	4,470.00	624,012,000	貸付株式数	54,100株
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	3,700	360.00	1,332,000	貸付株式数	1,500株
ブラス	700	543.00	380,100		
アウトソーシング	36,800	720.00	26,496,000		
ウェルネット	6,600	746.00	4,923,600	貸付株式数	2,600株
ワールドホールディングス	2,300	1,842.00	4,236,600	貸付株式数	800株 (100株)
ディー・エヌ・エー	31,100	1,497.00	46,556,700		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	87,800	1,362.00	119,583,600		
ぐるなび	11,100	765.00	8,491,500		

タカミヤ	6,700	507.00	3,396,900	貸付株式数	2,600株
ジャパンベストレスキューＳ	4,500	914.00	4,113,000	貸付株式数	100株
ファンコミュニケーションズ	18,000	468.00	8,424,000		
ライク	2,300	1,555.00	3,576,500	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	3,200	386.00	1,235,200	貸付株式数	1,000株
エスプール	12,400	817.00	10,130,800		
ＷＤＢホールディングス	3,000	2,715.00	8,145,000		
ティア	3,600	533.00	1,918,800		
ＣＤＧ	700	1,544.00	1,080,800	貸付株式数	200株 (200株)
バリューコマース	3,600	2,704.00	9,734,400	貸付株式数	1,400株 (1,300株)
インフォマート	69,900	903.00	63,119,700	貸付株式数	26,900株
サッポロホールディングス	22,400	2,233.00	50,019,200		
アサヒグループホールディン	138,600	4,337.00	601,108,200		
キリンＨＤ	280,600	2,329.50	653,657,700	貸付株式数	5,400株
宝ホールディングス	49,200	959.00	47,182,800		
オエノンホールディングス	18,000	403.00	7,254,000		
養　命　酒	1,900	1,896.00	3,602,400		
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	46,600	2,233.00	104,057,800		
サントリー食品インター	43,900	4,365.00	191,623,500		
ダイドーグループＨＤ	3,400	4,780.00	16,252,000	貸付株式数	1,300株
伊　藤　園	20,200	6,320.00	127,664,000	貸付株式数	8,200株
キーコーヒー	6,500	2,304.00	14,976,000		
ユニカフェ	1,600	962.00	1,539,200	貸付株式数	100株
ジャパンフーズ	900	1,180.00	1,062,000	貸付株式数	100株
日清オイリオグループ	8,600	3,445.00	29,627,000		
不二製油グループ	16,200	2,899.00	46,963,800		
かどや製油	700	3,670.00	2,569,000	貸付株式数	100株
Ｊ－オイルミルズ	3,400	4,200.00	14,280,000		
ローソン	16,600	6,080.00	100,928,000	貸付株式数	6,400株
サンエー	5,200	4,465.00	23,218,000	貸付株式数	800株
カワチ薬品	5,100	2,641.00	13,469,100	貸付株式数	2,000株
エービーシー・マート	10,200	6,540.00	66,708,000		

ハードオフコーポレーション	2,400	791.00	1,898,400		
高千穂交易	2,400	982.00	2,356,800		
アスクル	6,800	3,635.00	24,718,000	貸付株式数	2,500株
ゲオホールディングス	11,900	1,400.00	16,660,000		
アダストリア	9,100	1,734.00	15,779,400		
ジーフット	4,400	469.00	2,063,600	貸付株式数	1,600株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,000	502.00	502,000	貸付株式数	400株
伊藤忠食品	1,600	5,000.00	8,000,000	貸付株式数	600株
くら寿司	3,400	5,030.00	17,102,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
キャンドゥ	3,200	1,900.00	6,080,000	貸付株式数	1,200株 (600株)
エレマテック	6,100	916.00	5,587,600		
パルグループＨＬＤＧＳ	6,700	1,379.00	9,239,300		
ＪＡＬＵＸ	1,800	1,857.00	3,342,600	貸付株式数	700株
エディオン	29,800	1,008.00	30,038,400	貸付株式数	11,800株
あらた	5,200	4,490.00	23,348,000		
サーラコーポレーション	13,500	597.00	8,059,500	貸付株式数	5,200株
ワッツ	2,800	801.00	2,242,800	貸付株式数	1,100株 (400株)
トーメンデバイス	1,000	3,570.00	3,570,000	貸付株式数	300株
ハローズ	2,400	3,280.00	7,872,000	貸付株式数	900株
ＪＰホールディングス	20,200	283.00	5,716,600	貸付株式数	7,800株
フジオフードシステム	5,600	1,625.00	9,100,000	貸付株式数	2,100株
あみやき亭	1,400	3,250.00	4,550,000	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,300	2,825.00	6,497,500		
ひらまつ	11,800	197.00	2,324,600		
フィールズ	4,600	333.00	1,531,800	貸付株式数	1,800株
双日	360,700	260.00	93,782,000		
アルフレッサホールディングス	72,600	2,238.00	162,478,800		
大黒天物産	1,500	4,360.00	6,540,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,800	1,204.00	6,983,200	貸付株式数	2,100株
ファーマライズＨＤ	1,500	667.00	1,000,500		
キッコーマン	47,800	5,360.00	256,208,000	貸付株式数	18,500株
味　の　素	145,400	1,819.50	264,555,300		
キユーピー	36,900	2,166.00	79,925,400	貸付株式数	14,700株

ハウス食品Ｇ本社	24,900	3,665.00	91,258,500		
カ　ゴ　メ	25,300	3,045.00	77,038,500	貸付株式数	10,000株
焼津水産化工	3,000	950.00	2,850,000		
アリアケジャパン	6,100	7,250.00	44,225,000		
ピエトロ	700	1,628.00	1,139,600		
エバラ食品工業	1,500	2,192.00	3,288,000	貸付株式数	500株
やまみ	500	2,153.00	1,076,500		
ニチレイ	31,800	3,040.00	96,672,000		
横浜冷凍	17,400	914.00	15,903,600		
東洋水産	34,300	5,480.00	187,964,000		
イートアンド	2,300	1,810.00	4,163,000	貸付株式数	800株
大冷	800	1,977.00	1,581,600	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	3,800	1,091.00	4,145,800	貸付株式数	1,400株
日清食品ＨＤ	28,200	8,700.00	245,340,000		
永谷園ホールディングス	3,400	2,221.00	7,551,400		
一正蒲鉾	2,600	999.00	2,597,400	貸付株式数	1,000株 (800株)
フジッコ	7,100	1,995.00	14,164,500		
ロックフィールド	7,300	1,355.00	9,891,500	貸付株式数	400株 (100株)
日本たばこ産業	377,900	2,178.00	823,066,200	貸付株式数	150,400株
ケンコーマヨネーズ	3,700	2,174.00	8,043,800		
わらべや日洋ＨＤ	4,400	1,760.00	7,744,000	貸付株式数	1,600株
なとり	3,900	1,730.00	6,747,000	貸付株式数	100株
イフジ産業	1,000	811.00	811,000	貸付株式数	400株
ピックルスコーポレーション	1,500	2,356.00	3,534,000	貸付株式数	500株 (400株)
北の達人コーポ	23,500	619.00	14,546,500	貸付株式数	9,300株
ユーグレナ	28,700	812.00	23,304,400	貸付株式数	11,400株
ＡＤワークスグループ	15,900	189.00	3,005,100		
片倉工業	9,600	1,273.00	12,220,800		
グ　ン　ゼ	4,800	3,925.00	18,840,000	貸付株式数	1,200株
ヒューリック	139,000	1,104.00	153,456,000	貸付株式数	55,500株
神　栄	1,000	505.00	505,000	貸付株式数	100株
ラサ商事	3,300	913.00	3,012,900		
アルペン	5,200	1,802.00	9,370,400	貸付株式数	2,000株
ハブ	1,900	749.00	1,423,100	貸付株式数	700株
ラクーンホールディングス	3,200	800.00	2,560,000		

クオールホールディングス	9,700	1,177.00	11,416,900	貸付株式数	3,700株
アルコニックス	7,000	1,260.00	8,820,000	貸付株式数	2,700株
神戸物産	22,600	6,200.00	140,120,000	貸付株式数	8,900株
ソリトンシステムズ	3,100	1,441.00	4,467,100	貸付株式数	1,100株
ジンズホールディングス	3,500	6,770.00	23,695,000	貸付株式数	1,300株
ビックカメラ	38,200	1,162.00	44,388,400		
ＤＣＭホールディングス	36,500	1,114.00	40,661,000	貸付株式数	14,800株 (4,700株)
ペッパーフードサービス	5,700	579.00	3,300,300	貸付株式数	2,200株 (300株)
ＭｏｎｏｔａＲＯ	46,500	4,130.00	192,045,000	貸付株式数	18,400株
東京一番フーズ	1,500	510.00	765,000	貸付株式数	600株 (600株)
ＤＤホールディングス	2,700	1,013.00	2,735,100		
あい　ホールディングス	9,500	1,475.00	14,012,500		
ディーブイエックス	2,200	897.00	1,973,400		
きちりホールディングス	1,700	648.00	1,101,600	貸付株式数	400株
アークランドサービスＨＤ	4,900	1,968.00	9,643,200	貸付株式数	1,900株
Ｊ．　フロント　リテイリング	76,600	943.00	72,233,800		
ドトール・日レスＨＤ	10,400	1,832.00	19,052,800	貸付株式数	4,000株
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	27,000	3,880.00	104,760,000	貸付株式数	10,400株
ブロンコビリー	3,400	2,606.00	8,860,400	貸付株式数	1,300株
ＺＯＺＯ	44,900	2,208.00	99,139,200		
トレジャー・ファクトリー	2,000	745.00	1,490,000		
物語コーポレーション	1,800	8,530.00	15,354,000	貸付株式数	700株 (100株)
ココカラファイン	6,800	5,660.00	38,488,000		
三越伊勢丹ＨＤ	114,200	739.00	84,393,800		
東洋紡	25,800	1,497.00	38,622,600		
ユニチカ	19,800	383.00	7,583,400	貸付株式数	7,400株
富士紡ホールディングス	3,200	3,255.00	10,416,000		
日清紡ホールディングス	43,800	883.00	38,675,400		
倉敷紡績	6,500	2,386.00	15,509,000	貸付株式数	100株
ダイワボウＨＤ	5,500	7,980.00	43,890,000		
シキボウ	4,000	1,039.00	4,156,000		
日東紡績	9,900	5,560.00	55,044,000	貸付株式数	4,000株
トヨタ紡織	19,000	1,584.00	30,096,000		

マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	15,400	1,691.00	26,041,400		
Ｈａｍｅｅ	2,400	1,498.00	3,595,200	貸付株式数	600株
ラクト・ジャパン	2,500	4,010.00	10,025,000	貸付株式数	500株 (500株)
ウエルシアＨＤ	19,400	8,850.00	171,690,000		
クリエイトＳＤＨ	10,900	3,455.00	37,659,500	貸付株式数	3,600株
バイタルＫＳＫＨＤ	12,000	1,076.00	12,912,000		
八洲電機	4,900	897.00	4,395,300	貸付株式数	1,800株
メディアスホールディングス	3,600	962.00	3,463,200	貸付株式数	1,300株
レスターホールディングス	6,400	2,184.00	13,977,600		
ジューテックＨＤ	1,700	980.00	1,666,000	貸付株式数	600株
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	8,000	388.00	3,104,000	貸付株式数	3,100株
大光	2,800	679.00	1,901,200	貸付株式数	1,100株 (1,000株)
ＯＣＨＩホールディングス	1,900	1,493.00	2,836,700		
ＴＯＫＡＩホールディングス	35,200	981.00	34,531,200		
黒谷	1,600	476.00	761,600	貸付株式数	500株
ミサワ	1,600	571.00	913,600		
ティーライフ	900	1,140.00	1,026,000	貸付株式数	300株 (300株)
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,000	722.00	722,000	貸付株式数	400株
エー・ピーカンパニー	1,500	485.00	727,500		
三洋貿易	6,500	1,018.00	6,617,000		
チムニー	2,000	1,867.00	3,734,000	貸付株式数	700株
シュッピン	4,600	839.00	3,859,400		
ビューティガレージ	1,100	1,633.00	1,796,300		
ウイン・パートナーズ	4,700	984.00	4,624,800	貸付株式数	1,700株
ネクステージ	9,500	904.00	8,588,000	貸付株式数	3,800株
ジョイフル本田	19,000	1,378.00	26,182,000	貸付株式数	7,500株
鳥貴族	2,300	1,806.00	4,153,800	貸付株式数	700株
キリン堂ホールディングス	2,600	2,258.00	5,870,800	貸付株式数	900株
ホットランド	4,500	1,263.00	5,683,500	貸付株式数	1,700株
すかいらーくＨＤ	73,500	1,789.00	131,491,500	貸付株式数	29,100株 (2,800株)
ＳＦＰホールディングス	2,800	1,726.00	4,832,800	貸付株式数	1,100株
綿半ホールディングス	2,400	1,869.00	4,485,600	貸付株式数	900株
日本毛織	21,200	1,035.00	21,942,000	貸付株式数	8,100株

ダイトウボウ	12,100	134.00	1,621,400	貸付株式数	4,100株
トーア紡コーポレーション	2,600	510.00	1,326,000	貸付株式数	1,000株
ダイドーリミテツド	9,700	225.00	2,182,500	貸付株式数	2,900株
ヨシックス	1,100	2,481.00	2,729,100	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパーマーケ	18,700	1,129.00	21,112,300	貸付株式数	7,400株
三栄建築設計	3,000	1,260.00	3,780,000		
野村不動産ＨＬＤＧＳ	39,700	2,196.00	87,181,200		
三重交通グループＨＤ	13,300	505.00	6,716,500	貸付株式数	3,500株
サムティ	9,500	1,446.00	13,737,000		
日本商業開発	4,700	1,549.00	7,280,300		
プレサンスコーポレーション	11,200	1,311.00	14,683,200	貸付株式数	4,200株
日本管理センター	4,700	1,232.00	5,790,400	貸付株式数	1,600株
サンセイランディック	2,500	886.00	2,215,000	貸付株式数	700株
エストラスト	1,400	690.00	966,000	貸付株式数	300株
フージャースＨＤ	13,900	594.00	8,256,600	貸付株式数	5,300株
オープンハウス	19,100	3,060.00	58,446,000		
東急不動産ＨＤ	177,000	600.00	106,200,000		
飯田ＧＨＤ	53,000	1,662.00	88,086,000	貸付株式数	21,100株
イーグランド	1,900	679.00	1,290,100		
帝国繊維	7,300	2,311.00	16,870,300		
日本コークス工業	56,000	65.00	3,640,000		
ゴルフダイジェスト・オン	2,900	576.00	1,670,400	貸付株式数	1,100株
ミタチ産業	1,700	609.00	1,035,300	貸付株式数	600株
ＢＥＥＮＯＳ	2,500	1,090.00	2,725,000	貸付株式数	1,000株
あさひ	4,800	1,580.00	7,584,000		
日本調剤	4,000	1,692.00	6,768,000		
コスモス薬品	5,800	15,620.00	90,596,000	貸付株式数	1,100株 (900株)
シップヘルスケアＨＤ	10,500	4,430.00	46,515,000		
トーエル	3,000	728.00	2,184,000	貸付株式数	1,200株
ソフトクリエイトＨＤ	2,900	2,231.00	6,469,900		
オンリー	1,100	618.00	679,800		
セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ	253,600	3,844.00	974,838,400		
クリエイト・レストランツ・ホール	35,600	831.00	29,583,600	貸付株式数	13,900株
明治電機工業	1,800	1,429.00	2,572,200	貸付株式数	600株
ツルハホールディングス	14,200	15,710.00	223,082,000	貸付株式数	5,600株

デリカフーズＨＬＤＧＳ	2,200	637.00	1,401,400	貸付株式数	200株
スターティアホールディングス	1,700	700.00	1,190,000	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,100	1,877.00	9,572,700		
フェリシモ	1,400	1,062.00	1,486,800	貸付株式数	400株
トリドールホールディングス	16,400	1,239.00	20,319,600	貸付株式数	6,400株 (1,600株)
帝　人	52,000	1,852.00	96,304,000	貸付株式数	4,900株
東　レ	466,900	544.20	254,086,980		
ク　ラ　レ	102,200	1,223.00	124,990,600	貸付株式数	40,800株
旭　化　成	427,300	937.60	400,636,480		
サカイオーベックス	1,700	2,226.00	3,784,200		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	6,000	346.00	2,076,000	貸付株式数	100株
稲葉製作所	3,600	1,385.00	4,986,000	貸付株式数	1,500株
宮地エンジニアリングＧ	1,900	1,678.00	3,188,200	貸付株式数	700株
トーカロ	18,200	1,042.00	18,964,400		
アルファＣＯ	2,200	964.00	2,120,800		
ＳＵＭＣＯ	78,100	1,685.00	131,598,500	貸付株式数	30,700株
川田テクノロジーズ	1,300	5,300.00	6,890,000		
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	1,900	3,565.00	6,773,500		
信和	2,800	701.00	1,962,800		
ビーロット	3,400	797.00	2,709,800	貸付株式数	1,200株
ファーストブラザーズ	1,500	755.00	1,132,500	貸付株式数	100株
ハウスドゥ	3,500	1,057.00	3,699,500	貸付株式数	1,200株
シーアールイー	2,100	1,298.00	2,725,800	貸付株式数	600株
プロパティエージェント	1,300	1,019.00	1,324,700	貸付株式数	400株
ケイアイスター不動産	2,400	1,639.00	3,933,600		
アグレ都市デザイン	2,200	488.00	1,073,600	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,600	2,310.00	3,696,000		
テンポイノベーション	1,700	700.00	1,190,000	貸付株式数	600株
グロバルリンクマネジメント	1,400	655.00	917,000	貸付株式数	400株
住江織物	1,400	2,043.00	2,860,200	貸付株式数	400株
日本フエルト	3,300	498.00	1,643,400	貸付株式数	1,000株
イチカワ	900	1,365.00	1,228,500	貸付株式数	100株
エコナックホールディングス	13,500	102.00	1,377,000		
日東製網	800	1,374.00	1,099,200		

芦森工業	1,300	920.00	1,196,000	貸付株式数	500株
アツギ	5,200	625.00	3,250,000		
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	1,100	705.00	775,500	貸付株式数	200株
ＪＭホールディングス	3,300	2,774.00	9,154,200	貸付株式数	1,300株
コメダホールディングス	14,500	1,936.00	28,072,000	貸付株式数	5,100株
サツドラホールディングス	900	2,043.00	1,838,700	貸付株式数	100株 (100株)
アレンザホールディングス	3,200	866.00	2,771,200	貸付株式数	900株 (300株)
串カツ田中ＨＬＤＧＳ	1,100	1,753.00	1,928,300	貸付株式数	100株
バロックジャパン	4,600	667.00	3,068,200	貸付株式数	1,700株
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	5,900	8,800.00	51,920,000	貸付株式数	1,900株
ダイニック	2,300	764.00	1,757,200		
共和レザー	3,400	703.00	2,390,200		
力の源ＨＤ	3,000	775.00	2,325,000	貸付株式数	1,100株
スシローグローバルＨＬＤＧＳ	28,800	2,467.00	71,049,600		
ＬＩＸＩＬビバ	6,600	2,545.00	16,797,000		
セーレン	15,900	1,355.00	21,544,500		
ソトー	2,300	959.00	2,205,700		
東海染工	900	1,134.00	1,020,600	貸付株式数	300株
小松マテーレ	10,700	772.00	8,260,400	貸付株式数	1,700株
ワコールホールディングス	16,700	2,222.00	37,107,400		
ホギメディカル	7,400	3,620.00	26,788,000		
クラウディアＨＬＤＧＳ	1,700	447.00	759,900	貸付株式数	600株
ＴＳＩホールディングス	21,000	490.00	10,290,000	貸付株式数	8,500株
マツオカコーポレーション	1,900	2,221.00	4,219,900	貸付株式数	700株
ワールド	9,200	1,638.00	15,069,600		
ＴＩＳ	65,400	2,275.00	148,785,000		
ネオス	2,800	739.00	2,069,200		
電算システム	2,500	3,375.00	8,437,500	貸付株式数	900株
グリー	40,300	442.00	17,812,600		
コーエーテクモＨＤ	13,300	3,120.00	41,496,000		
三菱総合研究所	2,900	4,205.00	12,194,500		
ボルテージ	1,900	486.00	923,400	貸付株式数	600株
電算	700	2,270.00	1,589,000		
ＡＧＳ	3,700	811.00	3,000,700		
ファインデックス	5,700	947.00	5,397,900	貸付株式数	2,100株
ブレインパッド	1,700	5,110.00	8,687,000	貸付株式数	600株

ＫＬａｂ	12,800	767.00	9,817,600	貸付株式数	5,000株
ポールトゥウィン・ピットクル	8,000	1,098.00	8,784,000	貸付株式数	900株
イーブックイニシアティブ	900	2,541.00	2,286,900	貸付株式数	300株
ネクソン	180,900	2,265.00	409,738,500		
アイスタイル	18,400	309.00	5,685,600	貸付株式数	3,200株
エムアップホールディングス	1,900	2,347.00	4,459,300	貸付株式数	700株
エイチーム	4,200	793.00	3,330,600		
エニグモ	4,600	1,027.00	4,724,200		
テクノスジャパン	5,300	590.00	3,127,000		
ｅｎｉｓｈ	3,200	629.00	2,012,800	貸付株式数	500株
コロプラ	21,500	1,040.00	22,360,000	貸付株式数	8,500株 (4,500株)
オルトプラス	4,900	506.00	2,479,400	貸付株式数	1,600株
ブロードリーフ	32,900	557.00	18,325,300	貸付株式数	12,800株
クロス・マーケティングＧ	3,200	339.00	1,084,800	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	3,700	879.00	3,252,300	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
システム情報	3,600	1,252.00	4,507,200	貸付株式数	1,200株
メディアドゥ	2,000	4,390.00	8,780,000	貸付株式数	800株
じげん	16,500	389.00	6,418,500	貸付株式数	6,400株
ブイキューブ	4,200	1,242.00	5,216,400	貸付株式数	1,600株
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	865.00	1,124,500	貸付株式数	100株
サイバーリンクス	1,200	1,668.00	2,001,600		
ディー・エル・イー	4,300	475.00	2,042,500		
フィックスターズ	7,100	1,319.00	9,364,900	貸付株式数	2,700株
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,100	1,133.00	3,512,300	貸付株式数	1,200株
オプティム	3,400	2,818.00	9,581,200	貸付株式数	1,300株
セレス	2,300	1,246.00	2,865,800	貸付株式数	800株
特種東海製紙	4,200	4,340.00	18,228,000		
ティーガイア	5,700	2,232.00	12,722,400		
セック	1,000	3,385.00	3,385,000		
日本アジアグループ	7,300	330.00	2,409,000		
テクマトリックス	4,700	3,540.00	16,638,000		
プロシップ	1,900	1,302.00	2,473,800	貸付株式数	700株
ガンホー・オンライン・エンター	15,700	1,838.00	28,856,600		

GMOペイメントゲートウェイ	13,700	11,450.00	156,865,000	貸付株式数	5,400株
ザッパラス	2,900	390.00	1,131,000	貸付株式数	1,300株
システムリサーチ	1,800	1,944.00	3,499,200		
インターネットイニシアティブ	9,700	3,995.00	38,751,500		
さくらインターネット	6,900	645.00	4,450,500	貸付株式数	2,700株
ヴィンクス	1,900	1,081.00	2,053,900	貸付株式数	100株 (100株)
GMOクラウド	1,200	6,720.00	8,064,000	貸付株式数	400株 (400株)
ＳＲＡホールディングス	3,600	2,464.00	8,870,400		
システムインテグレータ	2,300	874.00	2,010,200		
朝日ネット	4,500	1,201.00	5,404,500		
ｅＢＡＳＥ	8,000	1,222.00	9,776,000		
アバント	4,800	1,150.00	5,520,000	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
アドソル日進	2,400	2,562.00	6,148,800		
フリービット	3,700	875.00	3,237,500		
コムチュア	7,400	2,886.00	21,356,400		
サイバーコム	1,200	1,844.00	2,212,800	貸付株式数	400株 (400株)
アステリア	4,400	530.00	2,332,000	貸付株式数	1,500株
アイル	2,400	1,990.00	4,776,000	貸付株式数	900株
王子ホールディングス	270,500	526.00	142,283,000		
日本製紙	28,400	1,641.00	46,604,400	貸付株式数	11,800株
三菱製紙	6,200	391.00	2,424,200		
北越コーポレーション	40,700	413.00	16,809,100		
中越パルプ	2,700	1,496.00	4,039,200		
巴川製紙	2,100	947.00	1,988,700		
大王製紙	28,000	1,447.00	40,516,000	貸付株式数	11,700株
阿波製紙	2,000	529.00	1,058,000		
マークラインズ	3,300	2,040.00	6,732,000	貸付株式数	1,300株
メディカル・データ・ビジ	5,000	1,129.00	5,645,000	貸付株式数	2,000株
ｇｕｍｉ	8,600	883.00	7,593,800		
ショーケース	1,600	618.00	988,800	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,600	1,179.00	1,886,400	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,400	2,975.00	7,140,000	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメーション	2,900	1,551.00	4,497,900	貸付株式数	1,000株

ＰＣＩホールディングス	2,800	976.00	2,732,800	貸付株式数	1,000株
パイプドＨＤ	900	1,550.00	1,395,000	貸付株式数	300株 (200株)
アイビーシー	1,400	1,063.00	1,488,200	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,200	1,358.00	1,629,600	貸付株式数	400株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	600	2,535.00	1,521,000	貸付株式数	200株
ランドコンピュータ	1,000	1,128.00	1,128,000	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	900	4,625.00	4,162,500	貸付株式数	200株
オープンドア	3,400	1,373.00	4,668,200	貸付株式数	1,300株
マイネット	2,100	1,203.00	2,526,300		
アカツキ	2,300	4,295.00	9,878,500		
ベネフィットジャパン	500	1,505.00	752,500	貸付株式数	100株
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	1,600	1,694.00	2,710,400	貸付株式数	500株
ＬＩＮＥ	15,000	5,350.00	80,250,000	貸付株式数	100株
カナミックネットワーク	4,100	910.00	3,731,000		
ノムラシステムコーポレーション	1,800	573.00	1,031,400	貸付株式数	500株
レンゴー	61,500	885.00	54,427,500		
トーモク	3,900	1,715.00	6,688,500	貸付株式数	1,400株
ザ・パック	4,900	3,235.00	15,851,500	貸付株式数	1,900株
チェンジ	1,400	5,690.00	7,966,000		
シンクロ・フード	2,700	357.00	963,900	貸付株式数	1,000株
オークネット	4,000	1,141.00	4,564,000	貸付株式数	1,600株
セグエグループ	1,300	889.00	1,155,700	貸付株式数	500株
エイトレッド	900	1,886.00	1,697,400	貸付株式数	300株
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,700	486.00	3,256,200	貸付株式数	2,600株
マクロミル	13,400	793.00	10,626,200	貸付株式数	4,500株
ビーグリー	1,300	1,485.00	1,930,500	貸付株式数	400株 (400株)
オロ	1,700	2,887.00	4,907,900	貸付株式数	600株
テモナ	900	851.00	765,900	貸付株式数	300株
ニーズウェル	1,000	736.00	736,000		
サインポスト	1,100	1,952.00	2,147,200	貸付株式数	400株
昭和電工	46,200	2,627.00	121,367,400		
住友化学	464,000	363.00	168,432,000		
住友精化	2,900	3,235.00	9,381,500		
日産化学	36,000	5,250.00	189,000,000		
ラサ工業	2,300	1,563.00	3,594,900		

クレハ	5,500	5,190.00	28,545,000		
多木化学	1,900	8,400.00	15,960,000	貸付株式数	700株
テイカ	4,700	1,554.00	7,303,800		
石原産業	11,600	780.00	9,048,000		
片倉コープアグリ	1,700	1,226.00	2,084,200		
日本曹達	9,600	3,020.00	28,992,000		
東ソー	99,300	1,576.00	156,496,800		
トクヤマ	18,700	2,646.00	49,480,200		
セントラル硝子	13,100	2,056.00	26,933,600		
東亞合成	40,600	1,067.00	43,320,200		
大阪ソーダ	6,600	2,640.00	17,424,000		
関東電化	15,500	925.00	14,337,500		
デンカ	23,900	2,829.00	67,613,100	貸付株式数	9,600株
イビデン	40,600	2,957.00	120,054,200		
信越化学	110,700	12,535.00	1,387,624,500	貸付株式数	43,200株
日本カーバイド	2,100	1,392.00	2,923,200	貸付株式数	800株
堺　化　学	4,100	2,014.00	8,257,400		
第一稀元素化学工	7,000	793.00	5,551,000		
エア・ウォーター	60,500	1,598.00	96,679,000		
大陽日酸	62,600	2,043.00	127,891,800		
日本化学工業	2,100	2,371.00	4,979,100		
東邦アセチレン	900	1,296.00	1,166,400		
日本パーカライジング	32,700	1,182.00	38,651,400		
高圧ガス	10,000	763.00	7,630,000		
チタン工業	900	1,860.00	1,674,000	貸付株式数	300株
四国化成	9,800	1,104.00	10,819,200		
戸田工業	1,500	1,762.00	2,643,000	貸付株式数	600株
ステラ　ケミファ	3,600	2,763.00	9,946,800	貸付株式数	1,400株 (100株)
保土谷化学	2,500	4,045.00	10,112,500		
日本触媒	9,900	6,040.00	59,796,000		
大日精化	5,800	2,547.00	14,772,600		
カネカ	16,600	2,985.00	49,551,000		
協和キリン	66,300	2,910.00	192,933,000		
三菱瓦斯化学	60,200	1,678.00	101,015,600		
三井化学	58,700	2,434.00	142,875,800		
ＪＳＲ	60,600	2,037.00	123,442,200		
東京応化工業	11,100	4,905.00	54,445,500		
大阪有機化学	6,100	1,979.00	12,071,900	貸付株式数	1,600株
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	427,200	667.00	284,942,400		

ＫＨネオケム	11,400	2,227.00	25,387,800	貸付株式数	4,600株
ダイセル	83,600	937.00	78,333,200		
住友ベークライト	10,200	3,305.00	33,711,000		
積水化学	137,000	1,563.00	214,131,000		
日本ゼオン	58,400	1,078.00	62,955,200		
アイカ工業	19,500	3,305.00	64,447,500		
宇部興産	32,300	2,007.00	64,826,100		
積水樹脂	11,600	2,351.00	27,271,600		
タキロンシーアイ	14,400	701.00	10,094,400		
旭有機材	3,700	1,513.00	5,598,100		
ニチバン	3,400	1,500.00	5,100,000		
リケンテクノス	16,000	439.00	7,024,000		
大倉工業	2,900	1,658.00	4,808,200	貸付株式数	1,100株
積水化成品	8,700	611.00	5,315,700		
群栄化学	1,400	2,697.00	3,775,800		
タイガース　ポリマー	3,400	488.00	1,659,200		
ミライアル	2,200	1,248.00	2,745,600	貸付株式数	800株
ダイキアクシス	2,400	805.00	1,932,000	貸付株式数	200株
ダイキョーニシカワ	12,900	643.00	8,294,700		
竹本容器	2,100	769.00	1,614,900	貸付株式数	900株
森六ホールディングス	2,800	1,630.00	4,564,000		
日本化薬	40,200	1,148.00	46,149,600		
カーリットホールディングス	6,400	546.00	3,494,400	貸付株式数	2,600株
ＥＰＳホールディングス	9,400	1,123.00	10,556,200		
ソルクシーズ	3,000	740.00	2,220,000	貸付株式数	1,100株
レッグス	1,700	1,033.00	1,756,100	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	23,900	920.00	21,988,000		
フェイス	2,300	686.00	1,577,800		
プロトコーポレーション	6,000	1,039.00	6,234,000		
ハイマックス	800	2,000.00	1,600,000		
アミューズ	3,500	2,379.00	8,326,500		
野村総合研究所	92,300	2,690.00	248,287,000		
ドリームインキュベータ	1,900	1,519.00	2,886,100	貸付株式数	700株
サイバネットシステム	5,100	706.00	3,600,600		
クイック	3,900	1,278.00	4,984,200		
ＴＡＣ	4,400	191.00	840,400	貸付株式数	1,600株
ＣＥホールディングス	4,100	499.00	2,045,900		
ケネディクス	59,400	568.00	33,739,200		
日本システム技術	1,200	1,398.00	1,677,600		

電通グループ	65,300	3,060.00	199,818,000	貸付株式数	25,200株
インテージホールディングス	8,400	872.00	7,324,800		
テイクアンドギヴニーズ	2,400	688.00	1,651,200	貸付株式数	900株
東邦システムサイエンス	1,700	930.00	1,581,000	貸付株式数	200株
ぴあ	1,800	3,830.00	6,894,000	貸付株式数	700株
イオンファンタジー	2,400	1,818.00	4,363,200	貸付株式数	900株 (200株)
ソースネクスト	31,600	319.00	10,080,400	貸付株式数	12,200株
シーティーエス	7,300	814.00	5,942,200		
ネクシィーズグループ	2,400	1,185.00	2,844,000	貸付株式数	900株
インフォコム	7,200	2,872.00	20,678,400	貸付株式数	100株
メディカルシステムネットワーク	6,300	481.00	3,030,300		
日本精化	5,400	1,502.00	8,110,800		
扶桑化学工業	6,600	3,740.00	24,684,000		
トリケミカル	1,500	11,540.00	17,310,000		
ラクスル	3,500	2,607.00	9,124,500	貸付株式数	1,400株
ＦＩＧ	7,700	295.00	2,271,500	貸付株式数	2,800株
ＡＤＥＫＡ	29,500	1,531.00	45,164,500		
日油	24,400	3,830.00	93,452,000		
ミヨシ油脂	2,300	1,165.00	2,679,500		
新日本理化	10,700	174.00	1,861,800		
ハリマ化成グループ	5,400	1,024.00	5,529,600		
アルテリア・ネットワークス	7,300	1,957.00	14,286,100		
ヒト・コミュニケーションズＨＤ	1,600	1,096.00	1,753,600		
花　王	157,500	9,076.00	1,429,470,000		
第一工業製薬	2,500	4,895.00	12,237,500		
石原ケミカル	1,700	1,988.00	3,379,600		
日華化学	2,100	933.00	1,959,300	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,100	4,300.00	4,730,000		
三洋化成	3,800	4,980.00	18,924,000		
武田薬品	548,000	4,041.00	2,214,468,000	貸付株式数	213,800株
アステラス製薬	569,900	1,856.00	1,057,734,400	貸付株式数	222,900株
大日本住友製薬	49,100	1,565.00	76,841,500		
塩野義製薬	84,300	6,285.00	529,825,500		
わかもと製薬	8,500	311.00	2,643,500		
あすか製薬	7,600	1,180.00	8,968,000	貸付株式数	2,800株

日本新薬	17,400	8,950.00	155,730,000		
ビオフエルミン製薬	1,200	2,316.00	2,779,200		
中外製薬	68,900	16,355.00	1,126,859,500		
科研製薬	11,300	5,840.00	65,992,000		
エーザイ	78,900	8,749.00	690,296,100		
理研ビタミン	6,300	2,234.00	14,074,200		
ロート製薬	34,100	3,340.00	113,894,000		
小野薬品	151,400	3,026.00	458,136,400		
久光製薬	17,300	5,420.00	93,766,000		
有機合成薬品	5,900	373.00	2,200,700	貸付株式数	2,000株
持田製薬	9,100	4,120.00	37,492,000		
参天製薬	123,200	2,051.00	252,683,200		
扶桑薬品	2,300	2,572.00	5,915,600		
日本ケミファ	900	2,688.00	2,419,200		
ツムラ	20,500	2,996.00	61,418,000		
日医工	19,200	1,290.00	24,768,000		
テ　ル　モ	187,400	4,194.00	785,955,600	貸付株式数	72,600株
みらかホールディングス	17,400	2,661.00	46,301,400		
キッセイ薬品工業	11,600	2,703.00	31,354,800		
生化学工業	12,500	1,129.00	14,112,500		
栄研化学	11,800	1,899.00	22,408,200		
日水製薬	2,800	1,245.00	3,486,000		
鳥居薬品	4,200	3,150.00	13,230,000		
ＪＣＲファーマ	4,700	12,150.00	57,105,000		
東和薬品	8,400	2,269.00	19,059,600		
富士製薬工業	4,600	1,285.00	5,911,000		
沢井製薬	13,600	5,870.00	79,832,000		
ゼリア新薬工業	12,100	2,065.00	24,986,500		
第一三共	188,600	9,100.00	1,716,260,000	貸付株式数	73,500株
キョーリン製薬ＨＤ	14,900	2,225.00	33,152,500	貸付株式数	5,600株
大幸薬品	8,300	2,314.00	19,206,200	貸付株式数	3,000株
ダイト	4,000	4,490.00	17,960,000		
大塚ホールディングス	125,200	4,891.00	612,353,200		
大正製薬ＨＤ	13,900	6,750.00	93,825,000		
ペプチドリーム	33,700	4,675.00	157,547,500	貸付株式数	13,800株
大日本塗料	7,300	941.00	6,869,300		
日本ペイントＨＯＬＤ	53,500	7,780.00	416,230,000		
関西ペイント	72,700	2,372.00	172,444,400		
神東塗料	6,800	194.00	1,319,200		
中国塗料	18,400	836.00	15,382,400		

日本特殊塗料	4,800	941.00	4,516,800		
藤倉化成	8,600	513.00	4,411,800		
太陽ホールディングス	4,700	5,040.00	23,688,000		
ＤＩＣ	27,000	2,883.00	77,841,000	貸付株式数	10,800株
サカタインクス	14,100	1,069.00	15,072,900		
東洋インキＳＣホールディン	13,300	2,159.00	28,714,700	貸付株式数	5,300株
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	4,100	826.00	3,386,600	貸付株式数	1,900株
アルプス技研	5,700	1,967.00	11,211,900		
サニックス	11,400	322.00	3,670,800	貸付株式数	4,300株
ダイオーズ	1,200	1,130.00	1,356,000		
日本空調サービス	6,800	720.00	4,896,000		
オリエンタルランド	67,100	15,320.00	1,027,972,000		
フォーカスシステムズ	4,200	893.00	3,750,600	貸付株式数	1,600株
ダスキン	16,200	2,820.00	45,684,000		
パーク２４	35,300	2,166.00	76,459,800	貸付株式数	13,900株
明光ネットワークジャパン	7,600	886.00	6,733,600	貸付株式数	3,000株
ファルコホールディングス	3,500	1,629.00	5,701,500		
クレスコ	4,000	1,549.00	6,196,000		
フジ・メディア・ＨＤ	62,200	1,119.00	69,601,800		
秀英予備校	1,400	421.00	589,400		
田谷	1,200	539.00	646,800	貸付株式数	400株
ラウンドワン	17,700	927.00	16,407,900	貸付株式数	7,200株
リゾートトラスト	29,300	1,474.00	43,188,200		
オービック	22,600	18,400.00	415,840,000		
ジャストシステム	10,700	7,270.00	77,789,000		
ＴＤＣソフト	5,900	928.00	5,475,200		
Ｚホールディングス	893,100	444.00	396,536,400		
ビー・エム・エル	8,300	3,035.00	25,190,500		
ワタベウェディング	1,000	377.00	377,000	貸付株式数	200株
トレンドマイクロ	29,100	6,180.00	179,838,000		
りらいあコミュニケーショ	11,600	1,223.00	14,186,800		
ＩＤホールディングス	2,500	1,469.00	3,672,500		
リソー教育	29,200	336.00	9,811,200		
日本オラクル	13,200	11,970.00	158,004,000	貸付株式数	5,200株
早稲田アカデミー	2,000	948.00	1,896,000	貸付株式数	800株
アルファシステムズ	2,100	4,175.00	8,767,500	貸付株式数	700株
フューチャー	8,000	1,790.00	14,320,000		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,400	1,347.00	5,926,800		

ＳＢテクノロジー	2,400	2,762.00	6,628,800		
トーセ	1,800	826.00	1,486,800	貸付株式数	700株
ユー・エス・エス	70,700	1,914.00	135,319,800		
オービックビジネスＣ	6,700	5,810.00	38,927,000		
伊藤忠テクノソリュー	29,900	3,680.00	110,032,000		
アイティフォー	8,100	736.00	5,961,600	貸付株式数	3,000株
東京個別指導学院	2,300	620.00	1,426,000	貸付株式数	900株
東計電算	1,000	4,140.00	4,140,000	貸付株式数	400株
サイバーエージェント	36,500	5,210.00	190,165,000	貸付株式数	14,900株
楽天	295,200	977.00	288,410,400	貸付株式数	120,200株
エックスネット	1,100	969.00	1,065,900		
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,111.00	3,777,400		
テー・オー・ダブリュー	10,400	361.00	3,754,400	貸付株式数	4,000株
大塚商会	35,300	5,480.00	193,444,000	貸付株式数	11,300株
サイボウズ	7,700	2,913.00	22,430,100		
ソフトブレーン	4,100	517.00	2,119,700	貸付株式数	1,500株
山田コンサルティングＧＰ	3,000	1,383.00	4,149,000		
セントラルスポーツ	2,300	2,641.00	6,074,300	貸付株式数	900株
パラカ	1,600	1,818.00	2,908,800	貸付株式数	600株
電通国際情報Ｓ	4,100	4,950.00	20,295,000		
デジタルガレージ	11,700	3,795.00	44,401,500	貸付株式数	4,800株
イーエムシステムズ	9,300	844.00	7,849,200		
ウェザーニューズ	2,300	3,785.00	8,705,500	貸付株式数	800株
ＣＩＪ	4,900	923.00	4,522,700		
ビジネスエンジニアリング	800	2,675.00	2,140,000	貸付株式数	300株
日本エンタープライズ	7,300	279.00	2,036,700	貸付株式数	100株
WOWOW	3,200	2,493.00	7,977,600		
スカラ	4,600	773.00	3,555,800	貸付株式数	1,700株 (100株)
インテリジェント　ウェイブ	3,100	777.00	2,408,700	貸付株式数	1,200株
フルキャストホールディングス	6,400	1,618.00	10,355,200	貸付株式数	2,400株
エン・ジャパン	11,300	3,060.00	34,578,000		
富士フイルムＨＬＤＧＳ	126,900	4,998.00	634,246,200		
コニカミノルタ	145,100	436.00	63,263,600		
資　生　堂	131,300	6,917.00	908,202,100		
ライオン	86,300	2,349.00	202,718,700		

高砂香料	4,200	2,476.00	10,399,200	貸付株式数	800株
マンダム	15,000	2,210.00	33,150,000	貸付株式数	5,600株
ミルボン	8,900	5,220.00	46,458,000		
ファンケル	26,800	3,150.00	84,420,000	貸付株式数	10,600株
コーセー	12,400	14,400.00	178,560,000		
コタ	3,800	1,204.00	4,575,200		
シーボン	800	2,146.00	1,716,800		
ポーラ・オルビスＨＤ	28,100	2,208.00	62,044,800		
ノエビアホールディングス	5,700	4,705.00	26,818,500		
アジュバンコスメジャパン	1,400	948.00	1,327,200		
エステー	4,100	1,660.00	6,806,000		
アグロカネショウ	2,100	1,412.00	2,965,200		
コ　ニ　シ	10,900	1,541.00	16,796,900		
長谷川香料	8,900	2,357.00	20,977,300		
星光ＰＭＣ	3,500	738.00	2,583,000	貸付株式数	1,400株
小林製薬	18,600	9,630.00	179,118,000	貸付株式数	400株
荒川化学工業	5,900	1,295.00	7,640,500		
メック	4,600	1,992.00	9,163,200	貸付株式数	1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,630.00	4,734,000	貸付株式数	700株
タカラバイオ	17,400	2,925.00	50,895,000	貸付株式数	6,900株
ＪＣＵ	8,100	3,220.00	26,082,000		
新田ゼラチン	3,900	714.00	2,784,600	貸付株式数	500株
ＯＡＴアグリオ	1,200	1,132.00	1,358,400	貸付株式数	200株
デクセリアルズ	17,300	884.00	15,293,200		
アース製薬	5,000	7,180.00	35,900,000	貸付株式数	1,900株
北興化学	6,600	613.00	4,045,800	貸付株式数	2,600株
大成ラミック	2,200	2,768.00	6,089,600	貸付株式数	800株
クミアイ化学	27,400	876.00	24,002,400	貸付株式数	10,900株
日本農薬	11,900	509.00	6,057,100	貸付株式数	4,700株
富士興産	2,200	499.00	1,097,800	貸付株式数	300株 (300株)
ニチレキ	8,000	1,686.00	13,488,000		
ユシロ化学	3,700	1,288.00	4,765,600		
ビーピー・カストロール	2,300	1,275.00	2,932,500		
富士石油	17,700	188.00	3,327,600		
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,300	1,096.00	2,520,800	貸付株式数	900株
出光興産	72,900	2,398.00	174,814,200		
ＪＸＴＧホールディングス	981,900	416.60	409,059,540	貸付株式数	392,700株

コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	19,200	1,729.00	33,196,800	貸付株式数	2,300株
横浜ゴム	38,200	1,719.00	65,665,800	貸付株式数	15,000株
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	38,300	1,595.00	61,088,500		
ブリヂストン	188,500	3,680.00	693,680,000		
住友ゴム	58,100	1,178.00	68,441,800		
藤倉コンポジット	6,200	380.00	2,356,000		
オカモト	4,000	4,015.00	16,060,000		
アキレス	4,700	1,760.00	8,272,000		
フ　コ　ク	3,000	705.00	2,115,000	貸付株式数	1,100株
ニッタ	7,100	2,344.00	16,642,400		
クリエートメディック	2,000	1,003.00	2,006,000		
住友理工	13,300	689.00	9,163,700		
三ツ星ベルト	8,600	1,769.00	15,213,400		
バンドー化学	10,800	680.00	7,344,000		
ＡＧＣ	65,300	3,455.00	225,611,500	貸付株式数	26,000株
日本板硝子	32,100	465.00	14,926,500	貸付株式数	12,600株
石塚硝子	1,200	2,127.00	2,552,400		
有沢製作所	10,500	820.00	8,610,000	貸付株式数	1,300株
日本山村硝子	2,300	859.00	1,975,700		
日本電気硝子	26,600	1,848.00	49,156,800		
オハラ	2,700	1,099.00	2,967,300	貸付株式数	1,000株
住友大阪セメント	12,500	3,960.00	49,500,000		
太平洋セメント	41,800	2,704.00	113,027,200		
リソルホールディングス	700	3,520.00	2,464,000		
日本ヒユーム	6,400	719.00	4,601,600	貸付株式数	2,400株
日本コンクリート	14,600	276.00	4,029,600		
三谷セキサン	3,200	5,260.00	16,832,000	貸付株式数	1,200株
アジアパイルＨＤ	8,900	476.00	4,236,400		
東海カーボン	69,700	1,048.00	73,045,600	貸付株式数	28,400株
日本カーボン	3,500	3,590.00	12,565,000	貸付株式数	1,100株
東洋炭素	3,900	1,762.00	6,871,800		
ノリタケ	3,500	3,765.00	13,177,500		
ＴＯＴＯ	46,900	4,505.00	211,284,500		
日本碍子	77,900	1,680.00	130,872,000		
日本特殊陶業	50,900	1,788.00	91,009,200		
ダントーホールディングス	8,100	90.00	729,000		
ＭＡＲＵＷＡ	2,600	8,210.00	21,346,000		
品川リフラクトリーズ	1,600	2,494.00	3,990,400		
黒崎播磨	1,300	4,115.00	5,349,500		

ヨータイ	5,300	729.00	3,863,700	貸付株式数	2,000株
イソライト	3,400	527.00	1,791,800		
東京窯業	8,200	308.00	2,525,600	貸付株式数	2,200株
ニッカトー	3,000	712.00	2,136,000	貸付株式数	900株
フジミインコーポレーテッド	5,900	3,085.00	18,201,500		
クニミネ工業	2,800	986.00	2,760,800		
エーアンドエーマテリアル	1,000	1,205.00	1,205,000		
ニチアス	18,200	2,459.00	44,753,800		
日本製鉄	292,200	1,113.00	325,218,600	貸付株式数	120,200株
神戸製鋼所	119,900	433.00	51,916,700	貸付株式数	47,900株
中山製鋼所	7,300	365.00	2,664,500		
合同製鐵	3,600	2,134.00	7,682,400		
ＪＦＥホールディングス	175,900	882.00	155,143,800	貸付株式数	68,500株
東京製鐵	32,400	700.00	22,680,000		
共英製鋼	7,500	1,433.00	10,747,500		
大和工業	13,900	2,324.00	32,303,600		
東京鐵鋼	2,600	1,356.00	3,525,600		
大阪製鐵	3,300	1,297.00	4,280,100		
淀川製鋼所	8,200	1,826.00	14,973,200		
丸一鋼管	21,400	2,855.00	61,097,000	貸付株式数	500株
モリ工業	2,000	2,439.00	4,878,000		
大同特殊鋼	10,600	3,860.00	40,916,000		
日本高周波	2,400	387.00	928,800		
日本冶金工	5,400	1,826.00	9,860,400		
山陽特殊製鋼	4,300	1,040.00	4,472,000		
愛知製鋼	3,400	3,055.00	10,387,000	貸付株式数	900株
日立金属	70,300	1,344.00	94,483,200		
日本金属	1,600	707.00	1,131,200		
大平洋金属	4,400	1,854.00	8,157,600	貸付株式数	1,600株
新日本電工	43,600	171.00	7,455,600	貸付株式数	14,700株
栗本鉄工所	3,200	1,833.00	5,865,600		
虹　技	1,000	1,227.00	1,227,000	貸付株式数	300株
日本鋳鉄管	800	1,414.00	1,131,200		
日本製鋼所	20,100	1,658.00	33,325,800		
三菱製鋼	4,600	740.00	3,404,000		
日亜鋼業	9,500	282.00	2,679,000		
日本精線	1,100	3,235.00	3,558,500	貸付株式数	400株
エンビプロＨＤ	3,000	692.00	2,076,000	貸付株式数	1,100株 (100株)

大紀アルミニウム	10,200	622.00	6,344,400		
日本軽金属ＨＤ	165,500	190.00	31,445,000		
三井金属	17,700	2,426.00	42,940,200	貸付株式数	6,900株
東邦亜鉛	3,300	1,685.00	5,560,500		
三菱マテリアル	42,300	2,520.00	106,596,000		
住友鉱山	83,600	3,125.00	261,250,000		
ＤＯＷＡホールディングス	16,600	3,695.00	61,337,000		
古河機金	11,500	1,136.00	13,064,000		
エス・サイエンス	37,600	44.00	1,654,400	貸付株式数	5,800株
大阪チタニウム	6,800	1,134.00	7,711,200	貸付株式数	2,600株
東邦チタニウム	11,800	738.00	8,708,400	貸付株式数	2,800株
ＵＡＣＪ	9,900	2,052.00	20,314,800		
ＣＫサンエツ	1,400	3,305.00	4,627,000	貸付株式数	500株
古河電工	20,400	2,635.00	53,754,000		
住友電工	239,300	1,348.00	322,576,400		
フジクラ	80,300	338.00	27,141,400		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	7,700	1,066.00	8,208,200		
東京特殊電線	1,000	2,307.00	2,307,000	貸付株式数	400株
タツタ電線	12,900	602.00	7,765,800		
カナレ電気	1,000	1,829.00	1,829,000	貸付株式数	300株
平河ヒューテック	2,400	1,126.00	2,702,400		
リョービ	7,900	1,432.00	11,312,800		
アーレステイ	8,600	408.00	3,508,800		
アサヒＨＤ	11,600	2,728.00	31,644,800		
東洋製罐グループＨＤ	41,600	1,365.00	56,784,000		
ホッカンホールディングス	3,500	1,700.00	5,950,000		
コロナ	3,600	980.00	3,528,000		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	12,200	2,173.00	26,510,600		
ＯＳＪＢ　ＨＤ	33,200	241.00	8,001,200		
駒井ハルテック	1,200	1,493.00	1,791,600		
高田機工	500	2,400.00	1,200,000		
三和ホールディングス	61,700	992.00	61,206,400		
文化シヤッター	19,600	805.00	15,778,000		
三協立山	8,700	1,027.00	8,934,900		
アルインコ	4,900	961.00	4,708,900		
東洋シヤッター	1,700	720.00	1,224,000		
ＬＩＸＩＬグループ	95,600	1,635.00	156,306,000		
日本フイルコン	4,900	541.00	2,650,900	貸付株式数	1,700株
ノーリツ	13,700	1,328.00	18,193,600		

長府製作所	6,700	2,305.00	15,443,500		
リンナイ	12,800	9,600.00	122,880,000		
ユニプレス	12,400	1,092.00	13,540,800		
ダイニチ工業	3,500	692.00	2,422,000		
日東精工	9,000	490.00	4,410,000		
三洋工業	800	1,838.00	1,470,400		
岡　部	13,600	839.00	11,410,400	貸付株式数	5,500株
ジーテクト	7,800	1,178.00	9,188,400	貸付株式数	3,100株
東　プ　レ	11,900	1,405.00	16,719,500		
高周波熱錬	12,700	585.00	7,429,500		
東京製綱	4,700	591.00	2,777,700		
サンコール	3,600	483.00	1,738,800		
モリテックスチル	5,400	307.00	1,657,800	貸付株式数	2,100株
パイオラックス	9,600	1,738.00	16,684,800	貸付株式数	3,700株
エイチワン	6,400	615.00	3,936,000		
日本発条	70,200	790.00	55,458,000		
中央発條	800	2,777.00	2,221,600		
アドバネクス	900	1,309.00	1,178,100	貸付株式数	300株
三浦工業	28,400	4,565.00	129,646,000		
タ　ク　マ	22,300	1,415.00	31,554,500		
テクノプロ・ホールディング	12,700	6,500.00	82,550,000		
アトラ	1,700	266.00	452,200	貸付株式数	400株
インターワークス	1,600	388.00	620,800		
アイ・アールジャパンＨＤ	2,600	9,630.00	25,038,000		
ＫｅｅＰｅｒ技研	2,400	1,729.00	4,149,600	貸付株式数	900株
ファーストロジック	1,400	603.00	844,200	貸付株式数	500株
三機サービス	1,300	1,053.00	1,368,900	貸付株式数	400株
Ｇｕｎｏｓｙ	3,900	984.00	3,837,600	貸付株式数	1,600株
デザインワン・ジャパン	1,300	268.00	348,400		
イー・ガーディアン	3,200	2,452.00	7,846,400		
リブセンス	4,500	284.00	1,278,000	貸付株式数	1,600株
ジャパンマテリアル	19,400	1,691.00	32,805,400	貸付株式数	7,500株
ベクトル	8,200	921.00	7,552,200	貸付株式数	2,100株 (200株)
ウチヤマホールディングス	3,200	367.00	1,174,400		
チャームケアコーポレーション	5,500	852.00	4,686,000	貸付株式数	2,100株 (200株)
ライクキッズ	1,200	742.00	890,400	貸付株式数	400株

キャリアリンク	2,400	574.00	1,377,600	貸付株式数	800株
ＩＢＪ	4,500	816.00	3,672,000	貸付株式数	1,700株
アサンテ	2,700	1,540.00	4,158,000	貸付株式数	900株
Ｎ・フィールド	4,300	577.00	2,481,100	貸付株式数	1,600株
バリューＨＲ	2,600	1,525.00	3,965,000	貸付株式数	900株
M&Aキャピタルパートナー	4,500	4,025.00	18,112,500	貸付株式数	1,800株
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,400	1,847.00	4,432,800	貸付株式数	900株 (900株)
ＥＲＩホールディングス	1,800	665.00	1,197,000	貸付株式数	700株
アビスト	900	2,573.00	2,315,700	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	4,400	1,818.00	7,999,200		
ウィルグループ	4,300	714.00	3,070,200	貸付株式数	1,600株
エスクローＡＪ	9,000	226.00	2,034,000	貸付株式数	3,500株
リクルートホールディングス	453,400	3,818.00	1,731,081,200		
エラン	3,800	1,852.00	7,037,600	貸付株式数	1,400株
ツ　ガ　ミ	13,700	996.00	13,645,200	貸付株式数	5,200株
オークマ	7,600	5,040.00	38,304,000	貸付株式数	2,900株
芝浦機械	7,500	2,440.00	18,300,000		
アマダ	81,400	986.00	80,260,400		
アイダエンジニア	17,100	786.00	13,440,600		
滝澤鉄工所	2,000	1,058.00	2,116,000		
ＦＵＪＩ	28,200	1,862.00	52,508,400	貸付株式数	11,200株
牧野フライス	7,800	3,715.00	28,977,000		
オーエスジー	30,500	1,726.00	52,643,000	貸付株式数	12,200株
ダイジェット	700	1,343.00	940,100	貸付株式数	200株
旭ダイヤモンド	16,800	525.00	8,820,000		
DMG森精機	41,800	1,403.00	58,645,400	貸付株式数	16,600株
ソディツク	15,600	899.00	14,024,400		
ディスコ	8,800	25,800.00	227,040,000		
日東工器	3,700	2,088.00	7,725,600		
日進工具	1,900	2,679.00	5,090,100	貸付株式数	700株
パンチ工業	5,900	439.00	2,590,100	貸付株式数	2,300株
冨士ダイス	2,700	640.00	1,728,000	貸付株式数	1,100株
土木管理総合試験	2,900	362.00	1,049,800		
ネットマーケティング	2,200	631.00	1,388,200	貸付株式数	800株
日本郵政	510,700	808.60	412,952,020	貸付株式数	213,200株

ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	10,900	1,357.00	14,791,300	貸付株式数	200株
鎌倉新書	4,900	1,173.00	5,747,700	貸付株式数	1,900株
ＳＭＮ	1,000	1,129.00	1,129,000		
一蔵	700	398.00	278,600	貸付株式数	200株
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,200	2,700.00	5,940,000	貸付株式数	300株
グローバルキッズＣＯＭＰ	900	598.00	538,200	貸付株式数	300株
エアトリ	2,800	1,329.00	3,721,200	貸付株式数	1,100株
アトラエ	1,700	3,305.00	5,618,500	貸付株式数	600株
ストライク	2,400	4,840.00	11,616,000	貸付株式数	900株
ソラスト	17,500	1,291.00	22,592,500		
セラク	2,200	1,025.00	2,255,000	貸付株式数	700株
インソース	3,200	3,045.00	9,744,000	貸付株式数	1,200株 (900株)
豊田自動織機	52,900	5,860.00	309,994,000		
豊和工業	3,900	816.00	3,182,400	貸付株式数	300株
ＯＫＫ	2,700	426.00	1,150,200		
石川製作所	1,700	1,642.00	2,791,400	貸付株式数	600株 (600株)
東洋機械金属	4,300	439.00	1,887,700	貸付株式数	1,600株
津田駒工業	1,200	980.00	1,176,000	貸付株式数	400株
エンシュウ	1,500	1,029.00	1,543,500	貸付株式数	600株
島精機製作所	10,400	1,661.00	17,274,400		
オプトラン	7,400	2,650.00	19,610,000	貸付株式数	2,800株
ＮＣホールディングス	2,000	570.00	1,140,000	貸付株式数	700株
イワキポンプ	3,100	1,018.00	3,155,800	貸付株式数	200株
フリュー	6,400	917.00	5,868,800	貸付株式数	2,400株
ヤマシンフィルタ	14,400	1,048.00	15,091,200	貸付株式数	4,000株
日阪製作所	7,600	790.00	6,004,000		
やまびこ	12,900	998.00	12,874,200		
平田機工	3,100	6,180.00	19,158,000	貸付株式数	1,200株
ペガサスミシン製造	6,300	364.00	2,293,200	貸付株式数	2,500株
マルマエ	2,700	915.00	2,470,500	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
タツモ	3,100	1,668.00	5,170,800	貸付株式数	1,200株
ナブテスコ	38,600	3,485.00	134,521,000		
三井海洋開発	7,000	1,716.00	12,012,000		
レオン自動機	6,400	1,343.00	8,595,200	貸付株式数	2,600株
ＳＭＣ	20,700	57,980.00	1,200,186,000	貸付株式数	3,400株
ホソカワミクロン	2,300	6,130.00	14,099,000		

ユニオンツール	2,400	2,874.00	6,897,600	貸付株式数	1,000株
オイレス工業	8,500	1,454.00	12,359,000		
日精エーエスビー	2,200	3,515.00	7,733,000		
サト－ホールディングス	9,400	2,635.00	24,769,000		
技研製作所	5,800	4,900.00	28,420,000	貸付株式数	2,200株
日本エアーテック	2,300	1,049.00	2,412,700	貸付株式数	900株
カ　ワ　タ	1,900	791.00	1,502,900	貸付株式数	700株
日精樹脂工業	5,400	892.00	4,816,800		
オカダアイヨン	2,000	1,022.00	2,044,000	貸付株式数	800株
ワイエイシイホールディングス	2,800	508.00	1,422,400		
小松製作所	298,700	2,298.50	686,561,950	貸付株式数	119,400株
住友重機械	37,800	2,607.00	98,544,600		
日立建機	26,700	3,030.00	80,901,000		
日　工	9,200	659.00	6,062,800		
巴工業	2,800	1,817.00	5,087,600	貸付株式数	1,100株
井関農機	6,700	1,268.00	8,495,600		
ＴＯＷＡ	6,700	1,311.00	8,783,700		
丸山製作所	1,800	1,276.00	2,296,800	貸付株式数	400株
北川鉄工所	2,800	1,748.00	4,894,400		
シンニッタン	10,400	272.00	2,828,800		
ローツェ	2,900	5,220.00	15,138,000	貸付株式数	1,100株
タカキタ	2,500	600.00	1,500,000	貸付株式数	800株
クボタ	348,000	1,585.50	551,754,000	貸付株式数	139,200株
荏原実業	1,700	2,537.00	4,312,900		
東洋エンジニア	8,700	427.00	3,714,900	貸付株式数	200株
三菱化工機	2,200	1,757.00	3,865,400		
月島機械	12,200	1,272.00	15,518,400		
帝国電機製作所	5,500	1,278.00	7,029,000		
東京機械	3,100	284.00	880,400	貸付株式数	1,200株
新東工業	15,800	806.00	12,734,800	貸付株式数	300株
渋谷工業	5,800	3,090.00	17,922,000		
アイチ　コーポレーション	11,500	755.00	8,682,500	貸付株式数	4,100株
小森コーポレーション	15,500	750.00	11,625,000	貸付株式数	6,200株
鶴見製作所	5,100	1,797.00	9,164,700		
住友精密	1,000	2,473.00	2,473,000		
日本ギア工業	2,000	284.00	568,000	貸付株式数	700株
酒井重工業	1,200	2,450.00	2,940,000		
荏原製作所	27,400	2,667.00	73,075,800		
石井鉄工所	900	2,530.00	2,277,000		

酉島製作所	6,700	847.00	5,674,900		
北越工業	7,000	1,090.00	7,630,000		
ダイキン工業	84,100	16,920.00	1,422,972,000	貸付株式数	32,700株
オルガノ	2,400	5,760.00	13,824,000		
トーヨーカネツ	3,000	2,112.00	6,336,000		
栗田工業	35,900	3,040.00	109,136,000		
椿本チエイン	9,300	3,015.00	28,039,500		
大同工業	3,100	652.00	2,021,200		
日　機　装	20,000	1,101.00	22,020,000		
木村化工機	5,700	468.00	2,667,600	貸付株式数	300株
レイズネクスト	11,100	1,249.00	13,863,900		
アネスト岩田	10,500	873.00	9,166,500		
ダイフク	33,900	8,800.00	298,320,000	貸付株式数	13,400株
サムコ	1,900	2,044.00	3,883,600	貸付株式数	700株
加藤製作所	3,700	1,279.00	4,732,300		
油研工業	1,000	1,507.00	1,507,000		
タダノ	32,300	909.00	29,360,700		
フジテック	24,200	1,707.00	41,309,400		
ＣＫＤ	18,600	2,028.00	37,720,800		
キトー	5,100	1,215.00	6,196,500		
平和	17,000	1,846.00	31,382,000		
理想科学工業	5,900	1,407.00	8,301,300		
ＳＡＮＫＹＯ	14,500	2,880.00	41,760,000		
日本金銭機械	7,300	628.00	4,584,400		
マースグループＨＬＤＧＳ	3,900	1,601.00	6,243,900		
フクシマガリレイ	4,100	3,405.00	13,960,500		
オーイズミ	2,800	421.00	1,178,800	貸付株式数	1,100株
ダイコク電機	2,900	1,252.00	3,630,800		
竹内製作所	11,200	1,859.00	20,820,800		
ア　マ　ノ	17,400	2,428.00	42,247,200		
ＪＵＫＩ	8,900	658.00	5,856,200		
サンデンホールディングス	9,000	437.00	3,933,000	貸付株式数	3,200株
蛇の目ミシン	5,900	479.00	2,826,100	貸付株式数	2,200株
ブラザー工業	80,800	2,095.00	169,276,000		
マックス	10,200	1,691.00	17,248,200		
モリタホールディングス	11,600	1,796.00	20,833,600		
グローリー	17,000	2,585.00	43,945,000		
新晃工業	6,200	1,523.00	9,442,600	貸付株式数	2,200株
大和冷機工業	9,700	1,014.00	9,835,800		

セガサミーホールディングス	64,600	1,397.00	90,246,200		
日本ピストンリング	2,300	1,231.00	2,831,300		
リ　ケ　ン	3,000	2,823.00	8,469,000		
ＴＰＲ	8,600	1,522.00	13,089,200	貸付株式数	3,400株
ツバキ・ナカシマ	13,600	995.00	13,532,000		
ホシザキ	19,400	9,300.00	180,420,000	貸付株式数	800株
大豊工業	5,200	581.00	3,021,200		
日本精工	123,000	881.00	108,363,000		
Ｎ　Ｔ　Ｎ	156,100	252.00	39,337,200		
ジェイテクト	62,500	953.00	59,562,500		
不　二　越	6,200	3,780.00	23,436,000		
ミネベアミツミ	122,800	2,108.00	258,862,400		
日本トムソン	19,600	409.00	8,016,400		
Ｔ　Ｈ　Ｋ	38,500	3,015.00	116,077,500		
ユーシン精機	5,100	724.00	3,692,400		
前澤給装工業	2,400	2,010.00	4,824,000		
イーグル工業	7,900	789.00	6,233,100		
前澤工業	4,000	351.00	1,404,000	貸付株式数	200株
日本ピラー工業	6,800	1,491.00	10,138,800	貸付株式数	2,600株
キッツ	26,800	752.00	20,153,600		
日　立	316,000	3,761.00	1,188,476,000		
三菱電機	655,300	1,450.00	950,185,000		
富士電機	39,800	3,045.00	121,191,000		
東洋電機製造	2,300	1,275.00	2,932,500	貸付株式数	500株
安川電機	71,300	4,040.00	288,052,000	貸付株式数	29,200株
シンフォニア　テクノロジー	8,600	1,111.00	9,554,600		
明　電　舎	12,300	1,820.00	22,386,000		
オリジン	1,700	1,519.00	2,582,300		
山洋電気	3,200	4,895.00	15,664,000		
デンヨー	5,800	1,977.00	11,466,600		
ベイカレントコンサルティング	3,900	8,270.00	32,253,000		
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	1,600	1,291.00	2,065,600	貸付株式数	500株
アイモバイル	1,800	755.00	1,359,000	貸付株式数	700株
キャリアインデックス	2,800	339.00	949,200	貸付株式数	1,000株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2,200	911.00	2,004,200		
船場	1,100	1,019.00	1,120,900		

グレイステクノロジー	2,900	4,310.00	12,499,000	貸付株式数	1,100株
ジャパンエレベーターＳＨＤ	6,800	3,275.00	22,270,000	貸付株式数	2,600株
フルテック	900	1,295.00	1,165,500		
グリーンズ	1,800	579.00	1,042,200		
ツナググループＨＬＤＧＳ	900	453.00	407,700	貸付株式数	300株
ソウルドアウト	1,000	2,494.00	2,494,000		
ＭＳ＆ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	1,000	620.00	620,000	貸付株式数	300株
日総工産	4,500	715.00	3,217,500		
キュービーネットＨＬＤＧＳ	2,900	2,183.00	6,330,700	貸付株式数	1,000株
ＲＰＡホールディングス	3,800	889.00	3,378,200	貸付株式数	1,500株
三桜工業	8,600	793.00	6,819,800		
マキタ	86,100	3,895.00	335,359,500	貸付株式数	33,500株
東芝テック	8,500	3,810.00	32,385,000		
芝浦メカトロニクス	1,100	2,961.00	3,257,100		
マブチモーター	18,200	3,780.00	68,796,000		
日本電産	158,900	6,956.00	1,105,308,400		
ユーエムシーエレクトロニクス	4,200	416.00	1,747,200	貸付株式数	1,500株
トレックス・セミコンダクター	3,800	1,235.00	4,693,000		
東光高岳	3,600	1,054.00	3,794,400		
ダブル・スコープ	10,600	670.00	7,102,000	貸付株式数	4,100株
宮越ホールディングス	2,900	645.00	1,870,500	貸付株式数	900株
ダイヘン	7,300	3,600.00	26,280,000		
ヤーマン	11,000	755.00	8,305,000	貸付株式数	4,400株
ＪＶＣケンウッド	55,100	187.00	10,303,700		
ミマキエンジニアリング	5,500	409.00	2,249,500		
第一精工	2,800	2,519.00	7,053,200	貸付株式数	900株 (500株)
日新電機	15,600	1,156.00	18,033,600		
大崎電気	13,200	535.00	7,062,000		
オムロン	59,200	7,450.00	441,040,000		
日東工業	9,600	1,950.00	18,720,000		
ＩＤＥＣ	9,700	1,782.00	17,285,400	貸付株式数	2,400株
正興電機製作所	1,800	1,067.00	1,920,600	貸付株式数	500株
不二電機工業	700	1,336.00	935,200	貸付株式数	200株 (200株)

ジーエス・ユアサ　コーポ	22,300	2,007.00	44,756,100		
サクサホールディングス	1,500	1,798.00	2,697,000		
メルコホールディングス	2,300	2,751.00	6,327,300		
テクノメディカ	1,500	1,822.00	2,733,000	貸付株式数	300株
日本電気	80,300	5,030.00	403,909,000	貸付株式数	13,200株
富　士　通	63,700	11,550.00	735,735,000		
沖　電　気	26,700	1,102.00	29,423,400		
岩崎通信機	2,900	852.00	2,470,800		
電気興業	3,200	2,730.00	8,736,000		
サンケン電気	7,100	2,572.00	18,261,200		
ナカヨ	1,200	1,430.00	1,716,000		
アイホン	3,700	1,591.00	5,886,700		
ルネサスエレクトロニクス	315,000	638.00	200,970,000		
セイコーエプソン	81,000	1,392.00	112,752,000		
ワコム	45,100	526.00	23,722,600		
アルバック	12,200	3,365.00	41,053,000		
アクセル	2,700	794.00	2,143,800	貸付株式数	900株
ＥＩＺＯ	5,100	3,990.00	20,349,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	48.00	2,961,600	貸付株式数	17,200株
日本信号	16,900	1,219.00	20,601,100		
京三製作所	15,800	550.00	8,690,000	貸付株式数	6,200株
能美防災	8,700	2,045.00	17,791,500		
ホーチキ	4,900	1,379.00	6,757,100		
星和電機	3,500	676.00	2,366,000		
エレコム	7,400	4,940.00	36,556,000		
パナソニック	749,900	983.40	737,451,660		
シャープ	76,300	1,221.00	93,162,300	貸付株式数	30,500株
アンリツ	42,700	2,344.00	100,088,800	貸付株式数	16,900株
富士通ゼネラル	17,700	2,225.00	39,382,500		
ソ　ニ　ー※	412,600	7,280.00	3,003,728,000	貸付株式数	162,400株
Ｔ　Ｄ　Ｋ	32,000	10,850.00	347,200,000	貸付株式数	12,300株
帝国通信工業	2,800	1,209.00	3,385,200		
タムラ製作所	22,100	489.00	10,806,900		
アルプスアルパイン	58,800	1,467.00	86,259,600		
池上通信機	2,000	909.00	1,818,000		
日本電波工業	6,300	409.00	2,576,700	貸付株式数	2,300株
鈴木	3,200	784.00	2,508,800	貸付株式数	1,300株
日本トリム	900	3,310.00	2,979,000	貸付株式数	300株

ローランド　ディー.ジー.	3,700	1,350.00	4,995,000	貸付株式数	1,400株
フオスター電機	7,000	1,298.00	9,086,000		
ＳＭＫ	1,700	2,629.00	4,469,300	貸付株式数	600株
ヨコオ	4,300	2,841.00	12,216,300		
ティアック	4,900	145.00	710,500	貸付株式数	1,800株
ホシデン	18,000	963.00	17,334,000		
ヒロセ電機	10,200	12,280.00	125,256,000		
日本航空電子	15,200	1,626.00	24,715,200		
ＴＯＡ	7,000	775.00	5,425,000		
マクセルホールディングス	14,500	1,096.00	15,892,000		
古野電気	8,600	964.00	8,290,400		
ユニデンホールディングス	1,900	1,927.00	3,661,300	貸付株式数	600株
スミダコーポレーション	5,100	886.00	4,518,600	貸付株式数	1,900株 (100株)
アイコム	3,800	2,980.00	11,324,000		
リオン	2,800	2,341.00	6,554,800		
本多通信工業	5,800	475.00	2,755,000		
船井電機	6,800	529.00	3,597,200	貸付株式数	2,500株 (1,700株)
横河電機	60,800	1,700.00	103,360,000		
新電元工業	2,300	2,716.00	6,246,800		
アズビル	41,900	3,025.00	126,747,500		
東亜ディーケーケー	3,300	870.00	2,871,000	貸付株式数	1,200株
日本光電工業	27,400	3,440.00	94,256,000		
チノー	2,200	1,412.00	3,106,400	貸付株式数	700株
共和電業	6,800	411.00	2,794,800		
日本電子材料	2,700	986.00	2,662,200		
堀場製作所	13,100	6,070.00	79,517,000		
アドバンテスト	49,300	5,920.00	291,856,000	貸付株式数	19,100株
小野測器	2,500	517.00	1,292,500		
エスペック	5,900	1,805.00	10,649,500		
キーエンス	59,800	45,300.00	2,708,940,000	貸付株式数	23,200株
日置電機	3,400	3,375.00	11,475,000	貸付株式数	700株
シスメックス	47,100	8,346.00	393,096,600		
日本マイクロニクス	11,600	1,126.00	13,061,600		
メガチップス	6,200	2,041.00	12,654,200	貸付株式数	2,400株 (2,400株)
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,400	3,400.00	11,560,000	貸付株式数	1,400株

IMAGICA GROUP	5,700	410.00	2,337,000	貸付株式数	2,100株 (2,000株)
澤藤電機	900	1,620.00	1,458,000	貸付株式数	300株
デンソー	144,800	4,344.00	629,011,200		
原田工業	3,200	849.00	2,716,800	貸付株式数	1,200株
コーセル	8,700	952.00	8,282,400	貸付株式数	3,100株
イリソ電子工業	5,600	3,855.00	21,588,000	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	10,800	1,446.00	15,616,800		
千代田インテグレ	3,000	1,805.00	5,415,000	貸付株式数	1,100株
アイ・オー・データ	2,300	986.00	2,267,800	貸付株式数	800株
レーザーテック	29,100	9,450.00	274,995,000		
スタンレー電気	46,600	2,859.00	133,229,400		
岩崎電気	2,600	2,163.00	5,623,800		
ウシオ電機	36,900	1,554.00	57,342,600		
岡谷電機	5,100	333.00	1,698,300		
ヘリオステクノH	6,300	370.00	2,331,000	貸付株式数	100株
エノモト	2,000	1,072.00	2,144,000		
日本セラミック	6,800	2,184.00	14,851,200		
遠藤照明	3,200	644.00	2,060,800		
古河電池	4,600	635.00	2,921,000	貸付株式数	1,700株
双信電機	3,300	396.00	1,306,800	貸付株式数	1,200株
山一電機	4,800	1,653.00	7,934,400		
図　研	4,400	2,780.00	12,232,000		
日本電子	13,100	3,200.00	41,920,000		
カ　シ　オ	58,800	1,893.00	111,308,400		
ファナック	62,700	19,955.00	1,251,178,500	貸付株式数	24,400株
日本シイエムケイ	15,700	449.00	7,049,300	貸付株式数	2,800株
エンプラス	3,400	2,629.00	8,938,600		
大真空	2,500	1,862.00	4,655,000	貸付株式数	200株
ロ　ー　ム	29,300	7,910.00	231,763,000		
浜松ホトニクス	47,500	4,720.00	224,200,000		
三井ハイテック	7,400	1,492.00	11,040,800	貸付株式数	2,700株 (100株)
新光電気工業	22,300	1,410.00	31,443,000		
京　セ　ラ	91,800	6,139.00	563,560,200		
協栄産業	700	1,263.00	884,100	貸付株式数	200株
太陽誘電	29,500	3,280.00	96,760,000	貸付株式数	11,700株
村田製作所	193,600	6,387.00	1,236,523,200		
双葉電子工業	10,300	1,008.00	10,382,400		
日東電工	45,200	6,220.00	281,144,000		

北陸電気工業	2,700	922.00	2,489,400	貸付株式数	1,000株
東海理化電機	17,100	1,686.00	28,830,600		
ニチコン	22,600	813.00	18,373,800		
日本ケミコン	5,100	1,728.00	8,812,800		
ＫＯＡ	10,100	1,086.00	10,968,600		
三井Ｅ＆ＳＨＤ	21,700	621.00	13,475,700		
日立造船	52,000	399.00	20,748,000		
三菱重工業	109,800	2,951.50	324,074,700		
川崎重工業	51,000	1,888.00	96,288,000		
ＩＨＩ	47,800	1,777.00	84,940,600		
名村造船所	22,200	182.00	4,040,400		
サノヤスホールディングス	9,400	174.00	1,635,600		
スプリックス	2,200	924.00	2,032,800	貸付株式数	500株
カーブスホールディングス	15,900	683.00	10,859,700	貸付株式数	6,300株
日本車輌	2,400	2,757.00	6,616,800		
三菱ロジスネクスト	8,900	1,094.00	9,736,600		
近畿車輌	1,000	1,303.00	1,303,000	貸付株式数	300株
ＦＰＧ	20,200	669.00	13,513,800	貸付株式数	8,000株 (200株)
島根銀行	1,500	513.00	769,500		
じもとホールディングス	45,000	96.00	4,320,000		
全国保証	18,400	4,205.00	77,372,000	貸付株式数	7,500株
めぶきフィナンシャルＧ	340,500	251.00	85,465,500		
東京きらぼしＦＧ	9,000	1,133.00	10,197,000		
九州フィナンシャルＧ	108,200	471.00	50,962,200		
かんぽ生命保険	22,900	1,457.00	33,365,300	貸付株式数	9,500株
ゆうちょ銀行	182,100	900.00	163,890,000	貸付株式数	72,800株
富山第一銀行	15,500	271.00	4,200,500		
コンコルディア・フィナンシャル	378,100	363.00	137,250,300		
ジェイリース	2,500	403.00	1,007,500	貸付株式数	800株
西日本フィナンシャルＨＤ	44,700	758.00	33,882,600		
マーキュリアインベストメント	2,800	575.00	1,610,000	貸付株式数	1,100株
イントラスト	2,500	796.00	1,990,000	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	1,400	1,976.00	2,766,400	貸付株式数	500株 (500株)
Ｃａｓａ	2,300	1,239.00	2,849,700	貸付株式数	900株
アルヒ	10,500	1,558.00	16,359,000	貸付株式数	4,200株

プレミアグループ	3,600	1,866.00	6,717,600	貸付株式数	1,400株
日産自動車	777,800	452.20	351,721,160	貸付株式数	320,800株
いすゞ自動車	191,700	1,056.50	202,531,050		
トヨタ自動車 ※	734,600	7,067.00	5,191,418,200	貸付株式数	286,800株
日野自動車	82,900	800.00	66,320,000		
三菱自動車工業	239,100	336.00	80,337,600		
エフテック	4,800	548.00	2,630,400	貸付株式数	1,600株
レシップホールディングス	2,600	566.00	1,471,600		
ＧＭＢ	1,500	697.00	1,045,500		
ファルテック	1,400	750.00	1,050,000		
武蔵精密工業	15,000	1,179.00	17,685,000		
日産車体	13,100	1,019.00	13,348,900	貸付株式数	3,100株
新明和工業	18,000	1,094.00	19,692,000		
極東開発工業	12,200	1,376.00	16,787,200		
日信工業	13,300	2,212.00	29,419,600		
トピー工業	5,600	1,427.00	7,991,200		
ティラド	2,400	1,481.00	3,554,400		
タチエス	10,900	971.00	10,583,900		
Ｎ　Ｏ　Ｋ	35,000	1,467.00	51,345,000		
フタバ産業	18,800	540.00	10,152,000		
ＫＹＢ	7,500	2,355.00	17,662,500	貸付株式数	2,800株
市光工業	10,100	563.00	5,686,300		
大同メタル工業	13,100	594.00	7,781,400	貸付株式数	800株
プレス工業	32,000	291.00	9,312,000		
ミクニ	8,400	300.00	2,520,000		
太平洋工業	13,900	1,086.00	15,095,400		
ケーヒン	15,000	2,548.00	38,220,000		
河西工業	9,200	492.00	4,526,400	貸付株式数	3,400株
アイシン精機	54,600	3,630.00	198,198,000		
マ　ツ　ダ	194,100	796.00	154,503,600	貸付株式数	75,300株
今仙電機製作所	6,100	793.00	4,837,300		
本田技研	517,700	3,026.00	1,566,560,200		
スズキ	131,300	4,079.00	535,572,700		
ＳＵＢＡＲＵ	204,000	2,589.50	528,258,000		
安永	3,300	1,033.00	3,408,900		
ヤマハ発動機	85,400	1,729.00	147,656,600	貸付株式数	34,100株
ショーワ	15,400	2,259.00	34,788,600		
小糸製作所	39,700	4,965.00	197,110,500		
ＴＢＫ	7,900	471.00	3,720,900	貸付株式数	3,000株
エクセディ	9,200	1,857.00	17,084,400	貸付株式数	2,400株

ミツバ	12,200	493.00	6,014,600		
豊田合成	21,400	2,449.00	52,408,600		
愛三工業	10,600	608.00	6,444,800		
盟和産業	1,000	988.00	988,000	貸付株式数	300株
日本プラスト	5,000	501.00	2,505,000		
ヨ　ロ　ズ	6,400	1,218.00	7,795,200		
エフ・シー・シー	10,800	2,030.00	21,924,000		
新家工業	1,500	1,206.00	1,809,000		
シマノ	24,600	19,920.00	490,032,000		
テイ・エス　テック	15,400	3,230.00	49,742,000	貸付株式数	5,500株
関西みらいＦＧ	37,700	405.00	15,268,500		
３３ＦＧ	6,000	1,556.00	9,336,000	貸付株式数	2,300株
第四北越フィナンシャルＧ	11,300	2,317.00	26,182,100	貸付株式数	100株
ジャムコ	3,300	817.00	2,696,100	貸付株式数	1,200株 (100株)
小　野　建	5,700	1,281.00	7,301,700		
はるやまＨＬＤＧＳ	2,900	758.00	2,198,200	貸付株式数	1,000株
南　陽	1,400	1,498.00	2,097,200		
ノ　ジ　マ	11,500	2,484.00	28,566,000	貸付株式数	200株
佐鳥電機	4,400	869.00	3,823,600	貸付株式数	700株
カッパ・クリエイト	9,400	1,503.00	14,128,200	貸付株式数	2,500株 (1,600株)
エコートレーディング	1,500	535.00	802,500	貸付株式数	500株
伯東	3,900	1,019.00	3,974,100		
コンドーテック	5,000	1,092.00	5,460,000	貸付株式数	1,800株
中山福	3,400	508.00	1,727,200		
ライトオン	4,900	581.00	2,846,900	貸付株式数	1,800株 (1,400株)
ナガイレーベン	9,300	2,627.00	24,431,100	貸付株式数	800株
ジーンズメイト	2,700	239.00	645,300	貸付株式数	700株
三菱食品	6,800	2,835.00	19,278,000		
良品計画	86,700	1,595.00	138,286,500		
三城ホールディングス	6,400	286.00	1,830,400		
松田産業	4,800	1,395.00	6,696,000		
第一興商	9,700	3,965.00	38,460,500	貸付株式数	3,700株
メディパルＨＤ	70,100	2,167.00	151,906,700		
アドヴァン	10,000	1,309.00	13,090,000	貸付株式数	700株
ＳＰＫ	2,800	1,448.00	4,054,400		
萩原電気ＨＬＤＧＳ	2,300	2,241.00	5,154,300		
アルビス	2,400	2,124.00	5,097,600		

アズワン	4,300	11,590.00	49,837,000		
スズデン	2,200	1,206.00	2,653,200	貸付株式数	800株
尾家産業	1,900	1,499.00	2,848,100	貸付株式数	800株
シモジマ	4,000	1,293.00	5,172,000		
ドウシシャ	6,000	1,565.00	9,390,000		
小津産業	1,500	1,804.00	2,706,000		
コナカ	7,100	327.00	2,321,700		
高速	3,900	1,477.00	5,760,300		
ハウス　ローゼ	700	1,625.00	1,137,500		
Ｇ－７ホールディングス	3,900	2,499.00	9,746,100		
たけびし	2,200	1,501.00	3,302,200	貸付株式数	900株
イオン北海道	8,200	805.00	6,601,000	貸付株式数	2,400株
コ　ジ　マ	10,800	520.00	5,616,000	貸付株式数	4,300株
ヒマラヤ	2,100	820.00	1,722,000	貸付株式数	800株
コーナン商事	9,200	3,110.00	28,612,000	貸付株式数	300株
ネットワンシステムズ	24,900	3,325.00	82,792,500		
エコス	2,400	1,904.00	4,569,600	貸付株式数	900株
ワタミ	7,800	1,086.00	8,470,800	貸付株式数	3,000株
マルシェ	1,500	623.00	934,500	貸付株式数	600株
リックス	1,400	1,551.00	2,171,400	貸付株式数	500株
システムソフト	22,400	112.00	2,508,800		
パンパシフィックＨＤ	143,600	2,155.00	309,458,000		
丸文	5,200	496.00	2,579,200		
西松屋チェーン	14,400	952.00	13,708,800	貸付株式数	5,600株
ゼンショーホールディングス	31,400	2,297.00	72,125,800	貸付株式数	12,800株
ハピネット	5,300	1,115.00	5,909,500	貸付株式数	2,100株
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,761.00	7,396,200	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,200	1,008.00	1,209,600	貸付株式数	500株
橋本総業ＨＬＤＧＳ	1,300	1,914.00	2,488,200		
日本ライフライン	19,400	1,451.00	28,149,400		
サイゼリヤ	10,400	2,313.00	24,055,200	貸付株式数	3,800株
タカショー	3,500	475.00	1,662,500		
ＶＴホールディングス	27,500	343.00	9,432,500		
マルカ	2,300	1,865.00	4,289,500	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,500	3,585.00	19,717,500		
魚力	1,700	1,575.00	2,677,500		
ＩＤＯＭ	17,900	499.00	8,932,100	貸付株式数	7,100株
日本エム・ディ・エム	3,900	1,712.00	6,676,800		

ポプラ	1,800	450.00	810,000	貸付株式数	700株
フジ・コーポレーション	1,700	2,043.00	3,473,100		
ユナイテッドアローズ	6,900	1,962.00	13,537,800		
進和	3,700	2,022.00	7,481,400	貸付株式数	1,400株
エスケイジャパン	1,600	316.00	505,600		
ダイトロン	2,700	1,766.00	4,768,200	貸付株式数	1,000株
ハイデイ日高	9,200	1,928.00	17,737,600	貸付株式数	3,800株 (900株)
シークス	8,300	1,111.00	9,221,300	貸付株式数	3,200株
京都きもの友禅	3,900	234.00	912,600	貸付株式数	1,600株
コロワイド	21,900	1,673.00	36,638,700	貸付株式数	8,600株
ピーシーデポコーポ	8,700	607.00	5,280,900	貸付株式数	3,400株
田中商事	2,100	704.00	1,478,400		
オーハシテクニカ	3,700	1,642.00	6,075,400		
壱番屋	4,600	5,450.00	25,070,000	貸付株式数	400株
白銅	2,300	1,411.00	3,245,300	貸付株式数	800株
トップカルチャー	2,400	385.00	924,000		
ＰＬＡＮＴ	1,300	600.00	780,000	貸付株式数	500株
スギホールディングス	13,000	6,980.00	90,740,000		
薬王堂ホールディングス	2,900	2,704.00	7,841,600	貸付株式数	1,100株
島津製作所	79,200	2,950.00	233,640,000		
Ｊ　Ｍ　Ｓ	5,700	852.00	4,856,400		
クボテック	1,900	365.00	693,500	貸付株式数	500株
長野計器	5,000	1,030.00	5,150,000		
ブイ・テクノロジー	3,100	4,085.00	12,663,500	貸付株式数	1,200株
スター精密	10,300	1,354.00	13,946,200		
東京計器	4,100	970.00	3,977,000		
愛知時計	900	4,420.00	3,978,000		
インターアクション	3,600	2,297.00	8,269,200	貸付株式数	100株
オーバル	6,400	233.00	1,491,200	貸付株式数	1,200株
東京精密	12,000	3,745.00	44,940,000		
マニー	26,500	2,947.00	78,095,500	貸付株式数	900株
ニコン	99,100	1,016.00	100,685,600	貸付株式数	39,600株
トプコン	33,600	1,023.00	34,372,800		
オリンパス	365,800	1,977.50	723,369,500		
理研計器	5,800	2,446.00	14,186,800		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	11,600	5,120.00	59,392,000		
キヤノン電子	6,900	1,740.00	12,006,000		
タムロン	5,400	2,058.00	11,113,200		

ＨＯＹＡ	131,900	10,200.00	1,345,380,000		
シ　ー　ド	2,700	796.00	2,149,200	貸付株式数	1,000株
ノーリツ鋼機	4,500	1,521.00	6,844,500		
エー・アンド・デイ	6,100	746.00	4,550,600		
朝日インテック	74,800	3,045.00	227,766,000	貸付株式数	23,000株
キヤノン	353,800	2,310.00	817,278,000	貸付株式数	146,500株
リ　コ　ー	168,800	895.00	151,076,000		
シチズン時計	78,800	401.00	31,598,800	貸付株式数	30,900株
リズム時計	2,000	624.00	1,248,000		
大研医器	5,100	624.00	3,182,400		
メニコン	9,400	5,240.00	49,256,000	貸付株式数	2,400株
シンシア	900	481.00	432,900	貸付株式数	300株 (300株)
中本パックス	1,600	1,600.00	2,560,000	貸付株式数	600株
スノーピーク	3,400	1,030.00	3,502,000	貸付株式数	1,300株
パラマウントベッドＨＤ	6,900	4,065.00	28,048,500		
トランザクション	4,400	1,082.00	4,760,800	貸付株式数	1,400株
粧美堂	2,000	361.00	722,000	貸付株式数	300株
ニホンフラッシュ	6,200	1,411.00	8,748,200		
前田工繊	7,300	2,458.00	17,943,400	貸付株式数	2,700株
永大産業	7,500	320.00	2,400,000		
アートネイチャー	7,000	641.00	4,487,000		
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	68,400	6,407.00	438,238,800		
アイフィスジャパン	1,800	699.00	1,258,200		
共立印刷	11,300	144.00	1,627,200		
ＳＨＯＥＩ	6,400	2,459.00	15,737,600		
フランスベッドＨＬＤＧＳ	9,700	868.00	8,419,600	貸付株式数	3,600株
マーベラス	9,500	736.00	6,992,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,600	3,655.00	38,743,000		
萩原工業	3,600	1,436.00	5,169,600	貸付株式数	1,400株 (300株)
エイベックス	11,500	931.00	10,706,500		
トッパン・フォームズ	14,500	1,124.00	16,298,000		
フジシールインターナショナル	14,800	2,176.00	32,204,800	貸付株式数	1,800株
タカラトミー	29,800	937.00	27,922,600		
廣済堂	4,900	848.00	4,155,200		

エステールホールディングス	2,200	609.00	1,339,800		
アーク	26,400	123.00	3,247,200		
レック	7,100	1,730.00	12,283,000	貸付株式数	2,700株
タカノ	2,500	721.00	1,802,500		
三光合成	7,500	317.00	2,377,500		
プロネクサス	5,800	1,208.00	7,006,400		
ホクシン	5,700	128.00	729,600		
ウッドワン	2,400	1,179.00	2,829,600		
大建工業	4,500	1,729.00	7,780,500		
き　も　と	12,400	158.00	1,959,200		
凸版印刷	93,500	1,893.00	176,995,500		
大日本印刷	86,600	2,534.00	219,444,400		
共同印刷	2,100	3,035.00	6,373,500		
ＮＩＳＳＨＡ	13,900	1,083.00	15,053,700	貸付株式数	200株 (200株)
光村印刷	600	1,470.00	882,000	貸付株式数	200株
藤森工業	5,900	3,715.00	21,918,500		
ヴィア・ホールディングス	8,100	500.00	4,050,000		
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,300	1,882.00	6,210,600	貸付株式数	1,300株 (100株)
前澤化成工業	4,000	1,032.00	4,128,000		
未来工業	3,500	1,984.00	6,944,000		
アシックス	54,900	1,361.00	74,718,900	貸付株式数	22,800株
ツ　ツ　ミ	2,200	1,781.00	3,918,200		
ウェーブロックＨＬＤＧＳ	2,300	778.00	1,789,400	貸付株式数	800株
ジェイ　エス　ピー	4,000	1,540.00	6,160,000	貸付株式数	1,400株
ニ　チ　ハ	9,200	2,414.00	22,208,800		
エフピコ	7,400	7,960.00	58,904,000		
小松ウオール工業	2,100	1,947.00	4,088,700		
ヤマハ	39,400	5,480.00	215,912,000		
河合楽器	2,100	2,779.00	5,835,900		
クリナップ	5,900	553.00	3,262,700		
ピジョン	40,000	4,200.00	168,000,000	貸付株式数	15,900株
天馬	4,400	1,785.00	7,854,000		
兼松サステック	400	1,429.00	571,600		
キングジム	5,700	952.00	5,426,400	貸付株式数	2,200株
象印マホービン	19,600	1,688.00	33,084,800	貸付株式数	600株
リンテック	15,900	2,624.00	41,721,600		

信越ポリマー	12,000	937.00	11,244,000		
東　リ	15,800	272.00	4,297,600		
イトーキ	14,400	399.00	5,745,600		
任　天　堂	40,500	45,850.00	1,856,925,000	貸付株式数	15,700株
三菱鉛筆	10,000	1,479.00	14,790,000		
松　風	3,000	1,600.00	4,800,000	貸付株式数	1,100株
タカラスタンダード	13,500	1,559.00	21,046,500	貸付株式数	4,700株
コ　ク　ヨ	31,200	1,389.00	43,336,800		
ナカバヤシ	6,600	581.00	3,834,600	貸付株式数	300株
ニ　フ　コ	24,500	2,569.00	62,940,500		
立川ブラインド	2,800	1,213.00	3,396,400	貸付株式数	1,100株
グローブライド	3,000	2,315.00	6,945,000		
オカムラ	22,800	869.00	19,813,200		
バルカー	5,500	2,020.00	11,110,000		
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,000	1,599.00	1,599,000		
伊　藤　忠	454,700	2,367.50	1,076,502,250		
丸　紅	671,800	553.30	371,706,940		
スクロール	9,600	375.00	3,600,000	貸付株式数	3,400株
高　島	1,000	1,760.00	1,760,000		
ヨンドシーホールディングス	6,700	2,028.00	13,587,600		
三陽商会	3,500	920.00	3,220,000	貸付株式数	1,300株
長瀬産業	36,400	1,387.00	50,486,800		
ナイガイ	2,500	362.00	905,000		
蝶　理	4,100	1,952.00	8,003,200		
豊田通商	72,500	2,959.00	214,527,500		
オンワードホールディングス	38,300	383.00	14,668,900	貸付株式数	5,000株
三共生興	10,000	473.00	4,730,000		
兼　松	24,500	1,364.00	33,418,000		
美　津　濃	5,900	2,152.00	12,696,800		
ツカモトコーポレーション	1,300	1,149.00	1,493,700	貸付株式数	400株
ファミリーマート	52,100	2,083.00	108,524,300	貸付株式数	20,200株
ルックホールディングス	2,100	854.00	1,793,400	貸付株式数	100株
三井物産	570,100	1,746.00	995,394,600		
日本紙パルプ	3,800	4,090.00	15,542,000		
東京エレクトロン	41,900	23,840.00	998,896,000	貸付株式数	16,300株
カメイ	8,100	1,079.00	8,739,900		
東都水産	800	3,435.00	2,748,000		

ＯＵＧホールディングス	1,100	2,645.00	2,909,500	貸付株式数	400株
スターゼン	2,400	4,470.00	10,728,000		
セイコーＨＤ	9,400	1,912.00	17,972,800	貸付株式数	3,600株
山　善	25,500	941.00	23,995,500		
椿本興業	1,200	3,345.00	4,014,000		
住友商事	404,200	1,334.50	539,404,900		
日本ユニシス	20,500	3,360.00	68,880,000		
内田洋行	2,800	7,170.00	20,076,000	貸付株式数	1,000株
三菱商事	455,700	2,508.50	1,143,123,450		
第一実業	3,300	3,885.00	12,820,500		
キヤノンマーケティングＪＰＮ	17,300	2,290.00	39,617,000		
西華産業	3,500	1,259.00	4,406,500		
佐藤商事	4,900	959.00	4,699,100	貸付株式数	100株
菱洋エレクトロ	6,700	2,715.00	18,190,500	貸付株式数	2,500株
東京産業	5,700	569.00	3,243,300		
ユアサ商事	6,200	3,070.00	19,034,000		
神鋼商事	1,600	1,974.00	3,158,400		
トルク	3,900	322.00	1,255,800		
阪和興業	12,400	2,041.00	25,308,400		
正栄食品	4,200	4,345.00	18,249,000		
カナデン	5,300	1,322.00	7,006,600	貸付株式数	1,900株
菱電商事	4,700	1,462.00	6,871,400	貸付株式数	1,600株
ニプロ	46,100	1,235.00	56,933,500	貸付株式数	500株
フルサト工業	3,400	1,491.00	5,069,400	貸付株式数	1,300株
岩谷産業	14,500	3,765.00	54,592,500	貸付株式数	5,900株
ナイス	2,500	826.00	2,065,000		
昭光通商	2,300	625.00	1,437,500		
ニチモウ	1,000	1,815.00	1,815,000	貸付株式数	300株
極東貿易	1,900	1,567.00	2,977,300	貸付株式数	600株
イ　ワ　キ	8,700	469.00	4,080,300	貸付株式数	3,300株
兼松エレクトロニクス	3,600	3,890.00	14,004,000		
三愛石油	16,200	1,104.00	17,884,800		
稲畑産業	14,100	1,333.00	18,795,300		
ＧＳＩクレオス	1,600	1,182.00	1,891,200		
明和産業	6,300	492.00	3,099,600	貸付株式数	2,500株
クワザワ	2,400	522.00	1,252,800		
ゴールドウイン	11,800	6,640.00	78,352,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
ユニ・チャーム	126,700	4,078.00	516,682,600	貸付株式数	49,500株

デサント	12,600	1,702.00	21,445,200		
キ　ン　グ	2,900	501.00	1,452,900		
ワ　キ　タ	13,900	1,020.00	14,178,000		
ヤマトインター－ナシヨナル	3,800	366.00	1,390,800	貸付株式数	1,500株
東邦ホールディングス	21,000	2,111.00	44,331,000		
サンゲツ	17,500	1,599.00	27,982,500		
ミツウロコグループ	9,700	1,155.00	11,203,500	貸付株式数	1,000株
シナネンホールディングス	2,800	2,737.00	7,663,600		
伊藤忠エネクス	14,100	861.00	12,140,100		
サンリオ	18,300	1,865.00	34,129,500	貸付株式数	7,200株
サンワ　テクノス	4,400	885.00	3,894,000	貸付株式数	1,700株
リョーサン	7,100	2,499.00	17,742,900		
新光商事	10,100	904.00	9,130,400		
トーホー	2,900	1,938.00	5,620,200	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
三信電気	3,400	1,690.00	5,746,000		
東陽テクニカ	7,600	1,067.00	8,109,200		
モスフード　サービス	8,700	2,965.00	25,795,500	貸付株式数	3,300株 (100株)
加賀電子	6,400	2,166.00	13,862,400		
三益半導体	5,000	2,225.00	11,125,000		
ソーダニツカ	6,800	540.00	3,672,000	貸付株式数	2,300株
立花エレテック	4,600	1,776.00	8,169,600	貸付株式数	1,800株
木曽路	8,600	2,563.00	22,041,800	貸付株式数	3,300株
ＳＲＳホールディングス	8,100	934.00	7,565,400	貸付株式数	3,000株
千　趣　会	12,200	412.00	5,026,400	貸付株式数	4,800株
タカキユー	6,100	147.00	896,700	貸付株式数	1,800株 (1,600株)
ケーヨー	13,200	642.00	8,474,400	貸付株式数	3,300株
上新電機	7,600	2,223.00	16,894,800	貸付株式数	2,800株
日本瓦斯	10,300	4,240.00	43,672,000		
ロイヤルホールディングス	11,600	2,025.00	23,490,000	貸付株式数	4,600株 (300株)
東　天　紅	500	1,001.00	500,500		
いなげや	8,100	1,691.00	13,697,100		
島　忠	12,200	2,921.00	35,636,200		
チヨダ	6,800	1,113.00	7,568,400		
ライフコーポレーション	5,000	3,395.00	16,975,000		

リンガーハット	8,200	2,488.00	20,401,600	貸付株式数	3,200株 (1,700株)
ＭｒＭａｘＨＤ	8,400	459.00	3,855,600	貸付株式数	3,400株
テンアライド	5,800	390.00	2,262,000	貸付株式数	2,300株
ＡＯＫＩホールディングス	13,100	717.00	9,392,700		
オークワ	10,200	1,569.00	16,003,800		
コメリ	10,100	2,614.00	26,401,400		
青山商事	13,100	885.00	11,593,500		
しまむら	7,600	7,790.00	59,204,000		
はせがわ	3,100	345.00	1,069,500	貸付株式数	300株
高　島　屋	46,200	1,054.00	48,694,800	貸付株式数	19,500株
松　屋	13,200	702.00	9,266,400	貸付株式数	5,400株
エイチ・ツー・オーリテイリング	30,800	866.00	26,672,800		
近鉄百貨店	2,400	3,405.00	8,172,000		
丸井グループ	60,000	2,166.00	129,960,000		
クレディセゾン	45,900	1,372.00	62,974,800		
アクシアル　リテイリング	5,200	4,190.00	21,788,000		
井　筒　屋	4,000	193.00	772,000	貸付株式数	400株
イオン	249,800	2,415.50	603,391,900	貸付株式数	97,400株
イ　ズ　ミ	13,200	3,490.00	46,068,000		
フオーバル	2,900	1,163.00	3,372,700		
平　和　堂	12,500	1,958.00	24,475,000	貸付株式数	5,100株
フ　ジ	7,100	1,924.00	13,660,400	貸付株式数	200株
ヤオコー	7,500	7,240.00	54,300,000	貸付株式数	2,900株
ゼビオホールディングス	8,000	906.00	7,248,000		
ケーズホールディングス	63,000	1,378.00	86,814,000		
ＰＡＬＴＡＣ	10,500	5,370.00	56,385,000		
三谷産業	8,700	382.00	3,323,400		
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,200	771.00	2,467,200		
日産東京販売ＨＤ	8,400	233.00	1,957,200		
新生銀行	48,300	1,490.00	71,967,000	貸付株式数	18,600株
あおぞら銀行	39,200	2,043.00	80,085,600	貸付株式数	15,600株
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ ※	4,439,700	462.60	2,053,805,220		
りそなホールディングス	715,200	388.60	277,926,720		
三井住友トラストＨＤ	123,200	3,270.00	402,864,000		
三井住友フィナンシャルＧ	448,800	3,279.00	1,471,615,200		
千葉銀行	217,400	525.00	114,135,000		

群馬銀行	127,600	343.00	43,766,800		
武蔵野銀行	9,200	1,600.00	14,720,000		
千葉興業銀行	17,700	268.00	4,743,600		
筑波銀行	28,100	189.00	5,310,900		
七十七銀行	21,800	1,585.00	34,553,000		
青森銀行	5,100	2,273.00	11,592,300		
秋田銀行	4,100	1,590.00	6,519,000		
山形銀行	7,500	1,399.00	10,492,500	貸付株式数	1,000株
岩手銀行	4,400	2,643.00	11,629,200	貸付株式数	1,600株
東邦銀行	59,400	234.00	13,899,600	貸付株式数	5,900株
東北銀行	3,100	949.00	2,941,900		
みちのく銀行	4,400	1,204.00	5,297,600	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ふくおかフィナンシャルG	55,000	1,847.00	101,585,000		
静岡銀行	161,400	722.00	116,530,800		
十六銀行	8,100	2,106.00	17,058,600		
スルガ銀行	63,000	416.00	26,208,000		
八十二銀行	158,200	420.00	66,444,000	貸付株式数	24,200株
山梨中央銀行	7,500	936.00	7,020,000		
大垣共立銀行	13,100	2,317.00	30,352,700	貸付株式数	5,000株
福井銀行	5,700	1,699.00	9,684,300		
北國銀行	6,800	2,877.00	19,563,600		
清水銀行	2,700	1,858.00	5,016,600		
富山銀行	1,300	2,301.00	2,991,300		
滋賀銀行	13,300	2,581.00	34,327,300		
南都銀行	11,100	2,248.00	24,952,800		
百五銀行	58,600	327.00	19,162,200	貸付株式数	19,200株
京都銀行	23,300	4,055.00	94,481,500		
紀陽銀行	23,500	1,713.00	40,255,500	貸付株式数	2,100株
ほくほくフィナンシャルG	43,700	938.00	40,990,600		
広島銀行	96,800	519.00	50,239,200	貸付株式数	37,300株
山陰合同銀行	39,200	549.00	21,520,800		
中国銀行	56,700	1,008.00	57,153,600		
鳥取銀行	2,200	1,276.00	2,807,200		
伊予銀行	93,000	636.00	59,148,000	貸付株式数	36,000株
百十四銀行	7,100	2,002.00	14,214,200	貸付株式数	2,600株
四国銀行	10,000	858.00	8,580,000	貸付株式数	3,800株
阿波銀行	10,500	2,615.00	27,457,500	貸付株式数	3,600株
大分銀行	3,700	2,414.00	8,931,800		

宮崎銀行	4,400	2,464.00	10,841,600		
佐賀銀行	3,800	1,160.00	4,408,000		
沖縄銀行	5,900	3,260.00	19,234,000		
琉球銀行	15,000	979.00	14,685,000	貸付株式数	5,800株
セブン銀行	219,300	305.00	66,886,500		
みずほフィナンシャルG	8,808,500	138.90	1,223,500,650		
高知銀行	2,500	706.00	1,765,000		
山口フィナンシャルG	80,800	666.00	53,812,800		
芙蓉総合リース	6,800	6,120.00	41,616,000		
みずほリース	10,000	2,423.00	24,230,000		
東京センチュリー	13,100	4,945.00	64,779,500	貸付株式数	2,400株
ＳＢＩホールディングス	73,000	2,373.00	173,229,000	貸付株式数	30,300株
日本証券金融	29,500	527.00	15,546,500		
アイフル	101,600	265.00	26,924,000		
日本アジア投資	6,300	247.00	1,556,100		
長野銀行	2,100	1,167.00	2,450,700		
名古屋銀行	5,300	2,485.00	13,170,500		
北洋銀行	97,500	217.00	21,157,500		
愛知銀行	2,300	3,000.00	6,900,000		
中京銀行	2,700	2,156.00	5,821,200	貸付株式数	1,000株
大光銀行	2,200	1,492.00	3,282,400		
愛媛銀行	9,300	1,175.00	10,927,500	貸付株式数	2,900株
トマト銀行	2,500	1,077.00	2,692,500		
京葉銀行	27,500	526.00	14,465,000	貸付株式数	6,200株
栃木銀行	30,200	177.00	5,345,400		
北日本銀行	2,000	2,089.00	4,178,000		
東和銀行	11,400	732.00	8,344,800		
福島銀行	7,300	184.00	1,343,200		
大東銀行	3,200	627.00	2,006,400		
リコーリース	5,100	3,085.00	15,733,500		
イオンフィナンシャルサービス	40,100	1,297.00	52,009,700	貸付株式数	15,400株
ア　コ　ム	132,200	437.00	57,771,400		
ジャックス	7,200	1,900.00	13,680,000		
オ　リ　コ	173,900	132.00	22,954,800		
日立キャピタル	15,600	2,292.00	35,755,200		
アプラスフィナンシャル	34,100	70.00	2,387,000	貸付株式数	12,900株
オリックス	405,300	1,491.00	604,302,300		
三菱ＵＦＪリース	163,200	543.00	88,617,600		
ジャフコ	10,000	3,770.00	37,700,000		

九州　リースサービス	2,900	484.00	1,403,600	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	51,100	359.00	18,344,900		
大和証券Ｇ本社	525,100	477.20	250,577,720		
野村ホールディングス	1,140,900	498.30	568,510,470		
岡三証券グループ	54,700	364.00	19,910,800		
丸三証券	19,400	466.00	9,040,400	貸付株式数	6,300株
東洋証券	24,300	137.00	3,329,100	貸付株式数	9,300株
東海東京ＨＤ	73,500	269.00	19,771,500		
光世証券	1,800	555.00	999,000	貸付株式数	600株
水戸証券	18,600	213.00	3,961,800		
いちよし証券	11,600	473.00	5,486,800		
松井証券	37,400	874.00	32,687,600	貸付株式数	14,400株
ＳＯＭＰＯホールディングス	122,800	3,740.00	459,272,000		
だいこう証券ビジ	3,200	918.00	2,937,600		
日本取引所グループ	187,500	2,403.00	450,562,500		
マネックスＧ	50,000	242.00	12,100,000		
極東証券	8,400	545.00	4,578,000		
岩井コスモホールディング	5,800	1,035.00	6,003,000		
藍澤證券	11,800	723.00	8,531,400		
フィデアホール	63,100	111.00	7,004,100		
池田泉州ＨＤ	75,500	176.00	13,288,000		
アニコム　ホールディングス	5,400	4,570.00	24,678,000	貸付株式数	2,100株
ＭＳ＆ＡＤ	169,100	3,229.00	546,023,900		
ＳＯＮＹ　ＦＨ	53,600	2,596.00	139,145,600		
マネーパートナーズＧＰ	6,600	216.00	1,425,600	貸付株式数	2,600株
スパークス・グループ	22,900	238.00	5,450,200		
小林洋行	2,800	255.00	714,000	貸付株式数	700株
第一生命ＨＬＤＧＳ	367,300	1,486.50	545,991,450	貸付株式数	146,900株
東京海上ＨＤ	229,500	4,891.00	1,122,484,500		
アドバンテッジリスクマネ	3,300	899.00	2,966,700	貸付株式数	1,000株
イー・ギャランティ	7,100	2,076.00	14,739,600	貸付株式数	400株
アサックス	3,600	652.00	2,347,200	貸付株式数	1,200株
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,600	2,064.00	5,366,400		
Ｔ＆Ｄホールディングス	193,700	1,071.00	207,452,700		
アドバンスクリエイト	1,600	2,267.00	3,627,200		
三井不動産	319,800	2,269.00	725,626,200		

三菱地所	454,600	1,786.00	811,915,600		
平和不動産	12,200	3,145.00	38,369,000		
東京建物	69,300	1,443.00	99,999,900		
ダイビル	17,600	1,105.00	19,448,000		
京阪神ビルディング	11,000	1,464.00	16,104,000		
住友不動産	146,600	3,221.00	472,198,600		
太平洋興発	2,600	620.00	1,612,000	貸付株式数	200株
テーオーシー	13,600	738.00	10,036,800	貸付株式数	4,900株
東京楽天地	1,200	5,000.00	6,000,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	7,900	2,281.00	18,019,900		
フジ住宅	8,400	547.00	4,594,800	貸付株式数	2,900株
空港施設	7,300	444.00	3,241,200		
明和地所	5,100	436.00	2,223,600		
ゴールドクレスト	5,400	1,637.00	8,839,800	貸付株式数	2,100株
リログループ	34,800	2,415.00	84,042,000		
エスリード	2,700	1,500.00	4,050,000		
日神グループＨＬＤＧＳ	10,300	401.00	4,130,300	貸付株式数	3,700株
日本エスコン	12,200	826.00	10,077,200		
タカラレーベン	31,200	379.00	11,824,800		
ＡＶＡＮＴＩＡ	3,800	780.00	2,964,000	貸付株式数	1,400株
イオンモール	32,700	1,600.00	52,320,000		
毎日コムネット	2,000	783.00	1,566,000		
ファースト住建	3,100	944.00	2,926,400	貸付株式数	1,000株
ランド	378,100	10.00	3,781,000		
カチタス	16,400	2,541.00	41,672,400	貸付株式数	200株
東祥	3,900	1,397.00	5,448,300	貸付株式数	400株
トーセイ	9,400	1,105.00	10,387,000		
穴吹興産	1,700	1,776.00	3,019,200	貸付株式数	500株
サンフロンティア不動産	9,500	970.00	9,215,000		
インテリックス	2,900	535.00	1,551,500	貸付株式数	100株
ランドビジネス	3,000	375.00	1,125,000	貸付株式数	1,000株
日本社宅サービス	1,900	1,121.00	2,129,900	貸付株式数	700株
グランディハウス	5,800	412.00	2,389,600		
東武鉄道	68,900	3,815.00	262,853,500		
相鉄ホールディングス	21,300	3,015.00	64,219,500		
東急	165,700	1,704.00	282,352,800		
京浜急行	84,600	1,793.00	151,687,800	貸付株式数	12,300株
小田急電鉄	98,400	2,667.00	262,432,800	貸付株式数	4,400株
京王電鉄	34,400	6,300.00	216,720,000		
京成電鉄	45,900	3,615.00	165,928,500		

富士急行	9,000	3,395.00	30,555,000	貸付株式数	3,600株
新京成電鉄	1,700	2,185.00	3,714,500		
東日本旅客鉄道	115,400	8,683.00	1,002,018,200		
西日本旅客鉄道	58,700	6,788.00	398,455,600		
東海旅客鉄道	54,800	18,830.00	1,031,884,000		
西武ホールディングス	88,700	1,444.00	128,082,800		
鴻池運輸	9,800	1,250.00	12,250,000		
西日本鉄道	18,600	2,943.00	54,739,800	貸付株式数	3,500株
ハマキョウレックス	5,000	3,230.00	16,150,000		
サカイ引越センター	3,500	6,060.00	21,210,000		
近鉄グループＨＬＤＧＳ	62,600	5,240.00	328,024,000		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	83,200	3,995.00	332,384,000		
南海電鉄	29,700	2,663.00	79,091,100		
京阪ホールディングス	28,000	5,070.00	141,960,000	貸付株式数	400株
神戸電鉄	1,500	3,825.00	5,737,500	貸付株式数	600株
名古屋鉄道	51,600	3,200.00	165,120,000	貸付株式数	11,400株
山陽電鉄	4,700	2,259.00	10,617,300		
トランコム	1,800	7,160.00	12,888,000		
日本通運	21,500	5,790.00	124,485,000		
ヤマトホールディングス	109,900	2,403.00	264,089,700		
山　九	17,300	4,450.00	76,985,000		
日　新	5,400	1,709.00	9,228,600		
丸　運	3,500	244.00	854,000		
丸全昭和運輸	5,100	2,954.00	15,065,400		
センコーグループＨＬＤＧＳ	35,200	851.00	29,955,200		
トナミホールディングス	1,500	6,610.00	9,915,000		
ニッコンホールディングス	22,000	2,305.00	50,710,000		
日石輸送	600	3,080.00	1,848,000		
福山通運	7,900	3,610.00	28,519,000	貸付株式数	3,200株
セイノーホールディングス	46,700	1,474.00	68,835,800		
エスライン	1,800	1,031.00	1,855,800	貸付株式数	100株
神奈川中央交通	1,600	4,245.00	6,792,000		
日立物流	11,600	3,000.00	34,800,000		
丸和運輸機関	6,600	2,949.00	19,463,400	貸付株式数	2,600株 (1,400株)
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	6,400	1,594.00	10,201,600		
日本郵船	51,700	1,633.00	84,426,100		

商船三井	39,000	2,061.00	80,379,000		
川崎汽船	19,600	1,162.00	22,775,200	貸付株式数	7,800株
ＮＳユナイテッド海運	3,300	1,583.00	5,223,900		
明治海運	6,300	347.00	2,186,100		
飯野海運	29,300	353.00	10,342,900	貸付株式数	3,700株
共栄タンカー	1,200	846.00	1,015,200		
九州旅客鉄道	54,900	3,060.00	167,994,000		
ＳＧホールディングス	65,900	3,440.00	226,696,000	貸付株式数	26,200株
日本航空	110,200	2,377.00	261,945,400		
ＡＮＡホールディングス	114,700	2,784.00	319,324,800		
パスコ	1,300	1,520.00	1,976,000		
西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,200	2,182.00	2,618,400	貸付株式数	100株
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	700	1,944.00	1,360,800		
ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	2,900	3,420.00	9,918,000	貸付株式数	1,100株
国際紙パルプ商事	15,900	299.00	4,754,100		
ブックオフＧＨＤ	3,900	844.00	3,291,600	貸付株式数	1,500株 (100株)
三菱倉庫	19,300	2,906.00	56,085,800		
三井倉庫ＨＯＬＤ	7,100	1,578.00	11,203,800		
住友倉庫	22,100	1,381.00	30,520,100		
渋沢倉庫	3,400	2,165.00	7,361,000	貸付株式数	1,200株
ヤマタネ	3,200	1,221.00	3,907,200		
東陽倉庫	11,000	330.00	3,630,000		
乾汽船	3,700	1,060.00	3,922,000	貸付株式数	1,300株
日本トランスシティ	13,900	545.00	7,575,500		
ケイヒン	1,000	1,286.00	1,286,000		
中央倉庫	3,600	1,037.00	3,733,200		
川西倉庫	1,100	1,017.00	1,118,700	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,800	908.00	4,358,400		
ファイズホールディングス	1,400	1,144.00	1,601,600	貸付株式数	500株
東洋埠頭	1,900	1,388.00	2,637,200		
宇徳	5,400	489.00	2,640,600	貸付株式数	100株
上　組	34,800	2,190.00	76,212,000		
サンリツ	1,400	608.00	851,200	貸付株式数	300株
キムラユニティー	1,500	1,025.00	1,537,500		
キユーソー流通システム	1,600	1,748.00	2,796,800	貸付株式数	300株 (300株)

近鉄エクスプレス	13,400	1,790.00	23,986,000		
東海運	3,600	269.00	968,400	貸付株式数	1,300株
エーアイテイー	4,400	810.00	3,564,000		
内外トランスライン	2,100	1,033.00	2,169,300		
ショーエイコーポ	700	883.00	618,100	貸付株式数	200株
日本コンセプト	2,000	1,374.00	2,748,000		
東京放送ＨＤ	39,500	1,693.00	66,873,500	貸付株式数	15,700株
日本テレビＨＬＤＳ	53,600	1,245.00	66,732,000		
朝日放送グループＨＤ	6,200	806.00	4,997,200	貸付株式数	300株
テレビ朝日ＨＤ	17,900	1,643.00	29,409,700	貸付株式数	7,300株
スカパーＪＳＡＴＨＤ	42,200	442.00	18,652,400		
テレビ東京ＨＤ	5,300	2,509.00	13,297,700		
日本ＢＳ放送	2,100	1,140.00	2,394,000	貸付株式数	800株
ビジョン	6,100	847.00	5,166,700	貸付株式数	2,400株
スマートバリュー	1,800	1,193.00	2,147,400		
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	2,600	1,344.00	3,494,400	貸付株式数	900株
ワイヤレスゲート	3,200	578.00	1,849,600	貸付株式数	1,200株
コネクシオ	3,700	1,539.00	5,694,300		
日本通信	51,500	172.00	8,858,000	貸付株式数	20,100株 (1,000株)
クロップス	1,300	709.00	921,700		
日本電信電話	863,400	2,511.00	2,167,997,400	貸付株式数	337,000株
ＫＤＤＩ	481,500	3,199.00	1,540,318,500	貸付株式数	187,900株
ソフトバンク	586,800	1,368.00	802,742,400		
光通信	6,700	24,120.00	161,604,000		
ＮＴＴドコモ	461,900	2,918.00	1,347,824,200	貸付株式数	186,200株
エムティーアイ	6,300	616.00	3,880,800		
GMOインターネット	25,700	2,838.00	72,936,600	貸付株式数	10,200株
ファイバーゲート	1,700	1,510.00	2,567,000	貸付株式数	600株
アイドママーケティングコミュ	2,100	573.00	1,203,300		
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	17,600	1,700.00	29,920,000		
学研ホールディングス	8,800	1,569.00	13,807,200		
ゼンリン	12,900	1,322.00	17,053,800		
昭文社ホールディングス	3,100	407.00	1,261,700	貸付株式数	1,100株
インプレスホールディングス	5,300	152.00	805,600		
東京電力ＨＤ	528,000	375.00	198,000,000	貸付株式数	1,900株
中部電力	200,800	1,441.00	289,352,800		

関西電力	249,500	1,084.50	270,582,750		
中国電力	94,800	1,464.00	138,787,200		
北陸電力	60,100	702.00	42,190,200		
東北電力	161,900	1,077.00	174,366,300		
四国電力	59,400	815.00	48,411,000		
九州電力	136,700	904.00	123,576,800		
北海道電力	61,900	443.00	27,421,700		
沖縄電力	13,020	1,901.00	24,751,020		
電源開発	52,400	2,034.00	106,581,600		
エフオン	3,700	596.00	2,205,200	貸付株式数	1,200株
イーレックス	9,600	1,394.00	13,382,400	貸付株式数	3,600株 (3,600株)
レノバ	11,200	904.00	10,124,800	貸付株式数	3,200株
東京瓦斯	126,100	2,541.00	320,420,100		
大阪瓦斯	127,300	2,144.00	272,931,200		
東邦瓦斯	32,600	5,330.00	173,758,000		
北海道瓦斯	3,600	1,632.00	5,875,200		
広島ガス	12,800	354.00	4,531,200	貸付株式数	4,500株
西部瓦斯	7,500	2,625.00	19,687,500		
静岡ガス	18,400	980.00	18,032,000		
メタウォーター	3,200	4,935.00	15,792,000		
アイネット	3,400	1,505.00	5,117,000		
松　竹	4,300	14,380.00	61,834,000	貸付株式数	1,300株
東　宝	38,400	3,940.00	151,296,000		
エイチ・アイ・エス	10,000	2,042.00	20,420,000	貸付株式数	4,000株
東　映	2,400	14,650.00	35,160,000		
ラックランド	1,500	2,200.00	3,300,000	貸付株式数	500株
ＮＴＴデータ	174,000	1,292.00	224,808,000		
共立メンテナンス	10,600	3,820.00	40,492,000	貸付株式数	4,100株
イチネンホールディングス	7,200	1,274.00	9,172,800		
建設技術研究所	4,400	1,731.00	7,616,400		
スペース	3,900	1,015.00	3,958,500		
長　大	2,400	1,050.00	2,520,000		
アインホールディングス	8,100	6,870.00	55,647,000	貸付株式数	3,200株
燦ホールディングス	2,700	1,225.00	3,307,500		
ピー・シー・エー	900	4,400.00	3,960,000	貸付株式数	300株
スバル興業	400	8,030.00	3,212,000		
東京テアトル	3,100	1,269.00	3,933,900	貸付株式数	900株
タナベ経営	1,100	1,289.00	1,417,900		
ビジネスＢ太田昭和	1,100	2,662.00	2,928,200	貸付株式数	200株

ナ　ガ　ワ	2,000	7,870.00	15,740,000	貸付株式数	800株
よみうりランド	1,400	3,720.00	5,208,000	貸付株式数	500株
東京都競馬	4,200	3,645.00	15,309,000	貸付株式数	1,600株
常磐興産	2,600	1,511.00	3,928,600	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,400	2,335.00	24,284,000	貸付株式数	4,100株
東京ドーム	26,500	929.00	24,618,500	貸付株式数	8,400株
ＤＴＳ	14,700	2,377.00	34,941,900		
スクウェア・エニックス・ＨＤ	27,800	5,300.00	147,340,000	貸付株式数	11,000株
シーイーシー	7,100	1,860.00	13,206,000		
カプコン	30,700	3,860.00	118,502,000		
西尾レントオール	6,300	2,393.00	15,075,900		
アイ・エス・ビー	1,400	2,140.00	2,996,000	貸付株式数	500株
アゴーラ・ホスピタリティーＧ	47,500	23.00	1,092,500		
日本空港ビルデング	20,900	4,970.00	103,873,000	貸付株式数	8,200株
トランス・コスモス	6,100	2,464.00	15,030,400		
乃村工藝社	26,900	1,006.00	27,061,400		
ジャステック	4,200	1,151.00	4,834,200		
ＳＣＳＫ	15,100	5,500.00	83,050,000		
藤田観光	2,900	1,880.00	5,452,000	貸付株式数	1,100株 (100株)
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	3,900	1,178.00	4,594,200	貸付株式数	1,500株
日本管財	7,200	1,877.00	13,514,400	貸付株式数	2,500株
トーカイ	6,200	2,660.00	16,492,000		
白　洋　舎	800	2,947.00	2,357,600	貸付株式数	300株
セコム	67,100	9,667.00	648,655,700	貸付株式数	26,000株
日本システムウエア	2,200	2,333.00	5,132,600		
セントラル警備保障	3,100	4,660.00	14,446,000		
アイネス	6,500	1,387.00	9,015,500		
丹青社	11,900	774.00	9,210,600		
メイテツク	7,900	5,450.00	43,055,000		
ＴＫＣ	5,600	5,580.00	31,248,000		
富士ソフト	8,500	4,370.00	37,145,000		
応用地質	6,900	1,369.00	9,446,100		
船井総研ホールディン	13,000	2,529.00	32,877,000		
ＮＳＤ	21,300	1,715.00	36,529,500		
進学会ホールディングス	2,500	512.00	1,280,000	貸付株式数	100株
丸紅建材リース	700	1,596.00	1,117,200	貸付株式数	200株

オ　オ　バ	4,800	657.00	3,153,600		
コナミホールディングス	23,600	3,910.00	92,276,000		
いであ	1,300	1,803.00	2,343,900	貸付株式数	400株
学　究　社	1,800	1,127.00	2,028,600		
ベネッセホールディングス	21,100	2,966.00	62,582,600		
イオンディライト	7,800	3,145.00	24,531,000		
ナック	4,000	906.00	3,624,000		
福井コンピュータＨＬＤＳ	2,600	2,950.00	7,670,000	貸付株式数	1,000株
ニチイ学館	9,200	1,666.00	15,327,200		
ダイセキ	10,700	2,748.00	29,403,600		
ステップ	2,300	1,517.00	3,489,100		
日鉄物産	4,600	3,715.00	17,089,000		
泉州電業	2,000	2,788.00	5,576,000		
元気寿司	1,700	2,677.00	4,550,900		
トラスコ中山	13,600	2,573.00	34,992,800		
ヤマダ電機	199,300	553.00	110,212,900		
オートバックスセブン	23,900	1,381.00	33,005,900		
モリト	4,700	736.00	3,459,200	貸付株式数	1,800株
アークランドサカモト	10,100	1,205.00	12,170,500		
ニトリホールディングス	28,200	19,710.00	555,822,000		
グルメ杵屋	4,500	1,008.00	4,536,000	貸付株式数	1,800株 (200株)
愛　眼	5,400	215.00	1,161,000	貸付株式数	1,300株
ケーユーホールディングス	3,400	838.00	2,849,200	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	21,700	2,493.00	54,098,100	貸付株式数	8,500株
加藤産業	10,100	3,795.00	38,329,500		
北恵	1,300	915.00	1,189,500		
イノテック	3,900	1,107.00	4,317,300		
イエローハット	12,300	1,515.00	18,634,500		
松屋フーズＨＬＤＧＳ	3,200	3,920.00	12,544,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
ＪＢＣＣホールディングス	4,500	1,626.00	7,317,000		
ＪＫホールディングス	6,000	890.00	5,340,000	貸付株式数	2,100株
サガミホールディングス	8,800	1,300.00	11,440,000	貸付株式数	3,500株
日　伝	6,000	2,226.00	13,356,000	貸付株式数	2,200株
関西スーパーマーケット	5,500	1,109.00	6,099,500		
ミロク情報サービス	5,900	2,479.00	14,626,100	貸付株式数	1,500株 (100株)
北沢産業	5,200	291.00	1,513,200	貸付株式数	200株

杉本商事	3,400	1,879.00	6,388,600	貸付株式数	1,300株
因幡電機産業	18,700	2,495.00	46,656,500		
王将フードサービス	4,800	6,280.00	30,144,000		
プレナス	7,300	1,824.00	13,315,200	貸付株式数	3,000株 (1,700株)
ミニストップ	4,700	1,590.00	7,473,000	貸付株式数	1,700株
アークス	13,000	2,183.00	28,379,000		
バローホールディングス	14,400	2,172.00	31,276,800		
東　テ　ク	2,100	2,230.00	4,683,000		
ミスミグループ本社	81,700	2,955.00	241,423,500		
藤　　久	600	1,373.00	823,800	貸付株式数	200株
アルテック	5,600	241.00	1,349,600		
ベ　ル　ク	3,200	6,620.00	21,184,000		
大　庄	3,400	1,430.00	4,862,000	貸付株式数	1,300株
タキヒヨー	2,000	1,793.00	3,586,000	貸付株式数	700株
ファーストリテイリング	8,700	63,940.00	556,278,000	貸付株式数	3,500株
ソフトバンクグループ	513,600	5,220.00	2,680,992,000	貸付株式数	200,000株
蔵王産業	1,200	1,472.00	1,766,400		
スズケン	27,500	4,030.00	110,825,000		
サンドラッグ	24,500	3,530.00	86,485,000		
サックスバーホールディング	5,200	568.00	2,953,600	貸付株式数	1,600株
ジェコス	4,200	991.00	4,162,200		
ヤマザワ	1,400	1,727.00	2,417,800	貸付株式数	100株
や　ま　や	1,300	2,282.00	2,966,600		
グローセル	6,300	450.00	2,835,000		
ベルーナ	13,500	611.00	8,248,500		
合計			149,144,512,780		

（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

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考

新株予約権証券	千葉興業銀行第7回新株予約権	17,700	0	
新株予約権証券　合計			0	
合計			0	

新株予約権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

「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

	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	94,091,106	124,063,442
国債証券	15,069,587,840	17,297,379,830
地方債証券	1,144,791,100	1,557,629,300
特殊債券	717,137,200	726,014,200
社債券	1,045,023,400	827,793,900
未収利息	44,941,945	48,444,133
前払費用	1,372,937	1,675,348
流動資産合計	18,116,945,528	20,583,000,153
資産合計	18,116,945,528	20,583,000,153
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,776,000	2,196,613
その他未払費用	275	969
流動負債合計	3,776,275	2,197,582
負債合計	3,776,275	2,197,582
純資産の部		
元本等		
元本　※1	13,864,117,784	15,964,638,245

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,249,051,469	4,616,164,326
元本等合計	18,113,169,253	20,580,802,571
純資産合計	18,113,169,253	20,580,802,571
負債純資産合計	18,116,945,528	20,583,000,153

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年6月6日 至　2020年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
1．※1　期首	2018年6月6日	2019年6月6日
期首元本額	12,561,819,123円	13,864,117,784円
期中追加設定元本額	2,439,429,897円	4,335,667,786円
期中一部解約元本額	1,137,131,236円	2,235,147,325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）	38,029,395円	220,452,950円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	131,147円	2,051,993円

	ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	125,293,828円	128,078,758円
	ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,276,161,232円	1,834,153,495円
	ダイワ・ライフ・バランス３０	5,944,077,268円	6,266,365,831円
	ダイワ・ライフ・バランス５０	3,215,671,506円	3,659,650,103円
	ダイワ・ライフ・バランス７０	985,461,372円	1,101,824,963円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	768,478,355円	877,405,843円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	608,543,705円	702,693,232円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	198,062,900円	221,886,329円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	54,610,175円	52,146,312円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	53,809,820円	65,600,176円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	5,611,687円	12,365,722円
	ダイワつみたてインデックス日本債券	53,186,457円	287,797,255円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	24,664,794円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	7,482,369円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	－円	3,751,222円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	334,421,356円	306,933,836円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	199,880,911円	189,333,062円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	435,408円	－円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	2,251,262円	－円
計		13,864,117,784円	15,964,638,245円
2.	期末日における受益権の総数	13,864,117,784口	15,964,638,245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　2019年6月6日 至　2020年6月5日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2020年6月5日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	374,820,970	△248,052,400
地方債証券	6,358,300	△7,650,600
特殊債券	1,293,400	△3,831,300
社債券	3,174,100	△7,080,300
合計	385,646,770	△266,614,600

（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2019年6月5日まで、及び2019年12月3日から2020年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3065円 (13,065円)	1.2891円 (12,891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	４０３　２年国債	160,000,000	160,478,400	
	４０６　２年国債	180,000,000	180,667,800	
	４０７　２年国債	30,000,000	30,115,800	
	４０８　２年国債	160,000,000	160,652,800	
	４０９　２年国債	40,000,000	40,172,000	
	１２９　５年国債	182,000,000	182,596,960	
	１３０　５年国債	247,000,000	247,968,240	
	１３１　５年国債	190,000,000	190,864,500	
	１３２　５年国債	170,000,000	170,865,300	
	１３３　５年国債	230,000,000	231,290,300	

１３４　５年国債	170,000,000	171,059,100	
１３５　５年国債	260,000,000	261,778,400	
１３６　５年国債	140,000,000	141,044,400	
１３７　５年国債	280,000,000	282,170,000	
１３８　５年国債	180,000,000	181,468,800	
１３９　５年国債	200,000,000	201,708,000	
１４０　５年国債	110,000,000	110,958,100	
１４１　５年国債	170,000,000	171,499,400	
１４２　５年国債	20,000,000	20,177,600	
１４３　５年国債	110,000,000	111,003,200	
１　４０年国債	30,000,000	44,500,500	
２　４０年国債	23,000,000	33,171,290	
３　４０年国債	19,000,000	27,622,960	
４　４０年国債	30,000,000	43,956,000	
５　４０年国債	35,000,000	49,669,550	
６　４０年国債	28,000,000	39,205,880	
７　４０年国債	31,000,000	41,810,940	
８　４０年国債	23,000,000	29,046,930	
９　４０年国債	40,000,000	37,866,400	
１０　４０年国債	91,000,000	100,897,160	
１１　４０年国債	85,000,000	91,503,350	
１２　４０年国債	99,000,000	96,339,870	
３１７　１０年国債	40,000,000	40,646,000	
３１８　１０年国債	33,000,000	33,490,710	
３１９　１０年国債	140,000,000	142,711,800	
３２０　１０年国債	35,000,000	35,624,400	
３２１　１０年国債	65,000,000	66,340,300	
３２２　１０年国債	140,000,000	142,636,200	
３２３　１０年国債	70,000,000	71,498,700	
３２４　１０年国債	80,000,000	81,549,600	
３２５　１０年国債	160,000,000	163,484,800	
３２６　１０年国債	20,000,000	20,429,800	
３２７　１０年国債	90,000,000	92,162,700	
３２８　１０年国債	60,000,000	61,248,000	
３２９　１０年国債	160,000,000	164,580,800	
３３０　１０年国債	81,000,000	83,498,850	
３３１　１０年国債	10,000,000	10,242,500	
３３２　１０年国債	65,000,000	66,684,150	
３３３　１０年国債	83,000,000	85,285,820	

３３４　１０年国債	220,000,000	226,371,200	
３３５　１０年国債	210,000,000	215,514,600	
３３７　１０年国債	190,000,000	193,505,500	
３３８　１０年国債	80,000,000	81,901,600	
３３９　１０年国債	25,000,000	25,619,250	
３４０　１０年国債	120,000,000	123,088,800	
３４１　１０年国債	15,000,000	15,316,800	
３４２　１０年国債	20,000,000	20,197,200	
３４３　１０年国債	92,000,000	92,946,680	
３４４　１０年国債	50,000,000	50,520,500	
３４５　１０年国債	280,000,000	282,937,200	
３４６　１０年国債	40,000,000	40,421,600	
３４７　１０年国債	180,000,000	181,904,400	
３４８　１０年国債	170,000,000	171,800,300	
３４９　１０年国債	200,000,000	202,114,000	
３５０　１０年国債	140,000,000	141,474,200	
３５１　１０年国債	160,000,000	161,609,600	
３５２　１０年国債	200,000,000	201,906,000	
３５３　１０年国債	170,000,000	171,450,100	
３５４　１０年国債	140,000,000	141,104,600	
３５５　１０年国債	75,000,000	75,540,750	
３５６　１０年国債	185,000,000	186,198,800	
３５７　１０年国債	75,000,000	75,462,750	
３５８　１０年国債	195,000,000	196,138,800	
２　３０年国債	9,000,000	11,058,480	
３　３０年国債	4,000,000	4,893,280	
４　３０年国債	8,000,000	10,349,120	
５　３０年国債	8,000,000	9,824,640	
６　３０年国債	9,000,000	11,324,430	
７　３０年国債	12,000,000	15,054,720	
１０　３０年国債	15,000,000	16,734,450	
１１　３０年国債	9,000,000	10,741,950	
１２　３０年国債	11,000,000	13,731,300	
１３　３０年国債	11,000,000	13,618,110	
１４　３０年国債	22,000,000	28,490,880	
１５　３０年国債	21,000,000	27,555,150	
１６　３０年国債	26,000,000	34,210,020	
１７　３０年国債	17,000,000	22,203,700	
１８　３０年国債	20,000,000	25,899,400	

１９　３０年国債	15,000,000	19,483,350	
２０　３０年国債	16,000,000	21,315,680	
２１　３０年国債	16,000,000	20,889,120	
２２　３０年国債	17,000,000	22,772,350	
２３　３０年国債	16,000,000	21,499,680	
２４　３０年国債	15,000,000	20,202,000	
２５　３０年国債	17,000,000	22,408,890	
２６　３０年国債	32,000,000	42,804,480	
２７　３０年国債	32,000,000	43,568,640	
２８　３０年国債	34,000,000	46,547,700	
２９　３０年国債	43,000,000	58,399,590	
３０　３０年国債	56,000,000	75,442,640	
３１　３０年国債	76,000,000	101,583,120	
３２　３０年国債	45,000,000	61,290,450	
３３　３０年国債	75,000,000	98,252,250	
３４　３０年国債	70,000,000	94,810,800	
３５　３０年国債	68,000,000	89,781,080	
３６　３０年国債	73,000,000	96,788,510	
３７　３０年国債	75,000,000	98,319,750	
３８　３０年国債	45,000,000	58,213,800	
３９　３０年国債	50,000,000	65,886,500	
４０　３０年国債	44,000,000	57,060,520	
４１　３０年国債	34,000,000	43,413,580	
４２　３０年国債	53,000,000	67,740,890	
４３　３０年国債	40,000,000	51,176,400	
４４　３０年国債	42,000,000	53,787,720	
４５　３０年国債	43,000,000	53,151,870	
４６　３０年国債	55,000,000	68,026,750	
４７　３０年国債	50,000,000	63,078,500	
４８　３０年国債	50,000,000	60,783,000	
４９　３０年国債	68,000,000	82,700,240	
５０　３０年国債	60,000,000	64,330,800	
５１　３０年国債	55,000,000	52,285,200	
５２　３０年国債	57,000,000	56,867,760	
５３　３０年国債	55,000,000	56,156,650	
５４　３０年国債	55,000,000	58,896,750	
５５　３０年国債	56,000,000	59,928,960	
５６　３０年国債	50,000,000	53,537,000	
５７　３０年国債	50,000,000	53,500,500	

５８　３０年国債	55,000,000	58,880,800	
５９　３０年国債	55,000,000	57,492,050	
６０　３０年国債	48,000,000	52,627,200	
６１　３０年国債	50,000,000	52,171,000	
６２　３０年国債	46,000,000	45,541,380	
６３　３０年国債	50,000,000	48,122,000	
６４　３０年国債	50,000,000	48,047,500	
６５　３０年国債	55,000,000	52,769,750	
６６　３０年国債	102,000,000	97,834,320	
５２　２０年国債	19,000,000	19,554,040	
５３　２０年国債	13,000,000	13,450,710	
５４　２０年国債	14,000,000	14,506,940	
５５　２０年国債	41,000,000	42,580,140	
５６　２０年国債	12,000,000	12,526,080	
５７　２０年国債	24,000,000	25,003,200	
５８　２０年国債	35,000,000	36,640,800	
５９　２０年国債	3,000,000	3,140,760	
６１　２０年国債	40,000,000	41,278,400	
６２　２０年国債	16,000,000	16,458,080	
６３　２０年国債	30,000,000	31,772,400	
６４　２０年国債	35,000,000	37,343,950	
６５　２０年国債	42,000,000	45,018,960	
６６　２０年国債	30,000,000	32,049,900	
６７　２０年国債	19,000,000	20,457,680	
６８　２０年国債	25,000,000	27,202,750	
６９　２０年国債	12,000,000	13,011,720	
７０　２０年国債	18,000,000	19,830,060	
７１　２０年国債	17,000,000	18,590,690	
７２　２０年国債	53,000,000	58,029,700	
７５　２０年国債	14,000,000	15,472,100	
７６　２０年国債	25,000,000	27,388,500	
７８　２０年国債	17,000,000	18,705,610	
７９　２０年国債	14,000,000	15,475,320	
８１　２０年国債	65,000,000	72,175,350	
８２　２０年国債	28,000,000	31,239,600	
８５　２０年国債	31,000,000	34,904,450	
８６　２０年国債	6,000,000	6,825,360	
８８　２０年国債	33,000,000	37,726,590	
８９　２０年国債	15,000,000	17,057,700	

９２　２０年国債	45,000,000	51,359,400	
９３　２０年国債	18,000,000	20,510,460	
９４　２０年国債	45,000,000	51,582,600	
９５　２０年国債	30,000,000	34,963,200	
９６　２０年国債	23,000,000	26,480,590	
９７　２０年国債	25,000,000	29,091,250	
９８　２０年国債	34,000,000	39,315,900	
９９　２０年国債	53,000,000	61,547,840	
１００　２０年国債	35,000,000	41,086,850	
１０１　２０年国債	18,000,000	21,411,180	
１０２　２０年国債	10,000,000	11,951,800	
１０３　２０年国債	21,000,000	24,929,940	
１０４　２０年国債	64,000,000	74,946,560	
１０５　２０年国債	38,000,000	44,666,720	
１０６　２０年国債	16,000,000	18,939,680	
１０７　２０年国債	20,000,000	23,584,200	
１０８　２０年国債	68,000,000	79,026,200	
１０９　２０年国債	60,000,000	69,948,600	
１１０　２０年国債	27,000,000	31,950,450	
１１１　２０年国債	35,000,000	41,879,600	
１１２　２０年国債	40,000,000	47,501,600	
１１３　２０年国債	70,000,000	83,416,200	
１１４　２０年国債	45,000,000	53,829,900	
１１５　２０年国債	42,000,000	50,640,240	
１１６　２０年国債	27,000,000	32,681,880	
１１７　２０年国債	77,000,000	92,453,130	
１１８　２０年国債	13,000,000	15,530,580	
１１９　２０年国債	23,000,000	27,017,870	
１２０　２０年国債	75,000,000	86,604,750	
１２３　２０年国債	42,000,000	50,888,880	
１２４　２０年国債	55,000,000	66,065,450	
１２５　２０年国債	25,000,000	30,648,500	
１２６　２０年国債	21,000,000	25,295,970	
１２７　２０年国債	53,000,000	63,276,170	
１２８　２０年国債	32,000,000	38,285,440	
１２９　２０年国債	65,000,000	77,058,150	
１３０　２０年国債	28,000,000	33,274,360	
１３１　２０年国債	70,000,000	82,406,100	
１３２　２０年国債	25,000,000	29,493,750	

	１３３　２０年国債	57,000,000	67,893,840	
	１３４　２０年国債	15,000,000	17,906,550	
	１３５　２０年国債	20,000,000	23,643,200	
	１３６　２０年国債	65,000,000	76,086,400	
	１３７　２０年国債	18,000,000	21,310,200	
	１３９　２０年国債	120,000,000	140,648,400	
	１４１　２０年国債	48,000,000	57,048,000	
	１４２　２０年国債	45,000,000	54,035,100	
	１４３　２０年国債	48,000,000	56,550,720	
	１４４　２０年国債	40,000,000	46,625,600	
	１４５　２０年国債	80,000,000	95,484,000	
	１４６　２０年国債	115,000,000	137,500,900	
	１４７　２０年国債	100,000,000	118,448,000	
	１４８　２０年国債	70,000,000	82,093,900	
	１４９　２０年国債	100,000,000	117,424,000	
	１５０　２０年国債	115,000,000	133,608,150	
	１５１　２０年国債	120,000,000	136,178,400	
	１５２　２０年国債	100,000,000	113,541,000	
	１５３　２０年国債	100,000,000	115,129,000	
	１５４　２０年国債	100,000,000	113,735,000	
	１５５　２０年国債	93,000,000	103,044,000	
	１５６　２０年国債	85,000,000	86,345,550	
	１５７　２０年国債	93,000,000	91,507,350	
	１５８　２０年国債	95,000,000	97,797,750	
	１５９　２０年国債	82,000,000	85,671,960	
	１６０　２０年国債	80,000,000	84,840,800	
	１６１　２０年国債	80,000,000	83,483,200	
	１６２　２０年国債	80,000,000	83,463,200	
	１６３　２０年国債	72,000,000	75,097,440	
	１６４　２０年国債	90,000,000	92,259,000	
	１６５　２０年国債	95,000,000	97,251,500	
	１６６　２０年国債	80,000,000	84,665,600	
	１６７　２０年国債	70,000,000	71,516,200	
	１６８　２０年国債	55,000,000	55,192,500	
	１６９　２０年国債	80,000,000	78,793,600	
	１７０　２０年国債	40,000,000	39,354,000	
	１７１　２０年国債	60,000,000	59,019,600	
	１７２　２０年国債	85,000,000	85,077,350	
国債証券　合計			17,297,379,830	

地方債証券	７５１　東京都公債	100,000,000	101,499,200	
	２７－１５　北海道公債	100,000,000	100,500,300	
	２２２　神奈川県公債	100,000,000	99,574,600	
	４０１　大阪府公債	100,000,000	101,985,900	
	３　兵庫県公債１２年	100,000,000	102,308,300	
	１１兵庫県公債２０年	100,000,000	116,474,200	
	２８－１　静岡県公債	100,000,000	99,758,600	
	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	101,903,400	
	２２－１　福岡県１５年	100,000,000	108,557,400	
	２９－６　千葉県公債	100,000,000	100,558,100	
	１１６　共同発行地方	100,000,000	101,880,100	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	101,733,400	
	１６８　共同発行地方	100,000,000	100,389,100	
	２５－６　大阪市公債	100,000,000	102,223,100	
	１１　名古屋市２０年	100,000,000	118,283,600	
地方債証券　合計			1,557,629,300	
特殊債券	８１　政保道路機構	100,000,000	117,498,500	
	１９０　政保道路機構	100,000,000	101,702,500	
	２４１　政保道路機構	100,000,000	101,964,700	
	２６１　政保道路機構	100,000,000	101,689,000	
	３６　地方公共団体	100,000,000	101,657,500	
	６５　地方公共団体	100,000,000	101,994,600	
	１２７　都市再生	100,000,000	99,507,400	
特殊債券　合計			726,014,200	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	99,633,500	
	３３　中日本高速道	100,000,000	101,328,000	
	２５　西日本高速道	100,000,000	101,913,600	
	１７　パナソニツク	100,000,000	100,391,700	
	５　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	100,454,000	
	８０　三菱地所	100,000,000	113,146,900	
	３２東日本旅客鉄道	100,000,000	107,976,900	
	４９７　関西電力	100,000,000	102,949,300	
社債券　合計			827,793,900	
合計			20,408,817,230	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	481,629,403	173,603,398
コール・ローン	153,179,066	318,299,700
株式	104,190,649,830	131,681,035,925
投資証券	3,065,025,533	3,609,130,632
派生商品評価勘定	－	81,188,750
未収入金	10,267,250	701,175
未収配当金	210,200,525	198,865,568
差入委託証拠金	524,451,200	832,164,327
流動資産合計	108,635,402,807	136,894,989,475
資産合計	108,635,402,807	136,894,989,475
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	31,614,045	－
未払金	10,720,229	－
未払解約金	54,250,900	54,700,100
その他未払費用	242	8,070
流動負債合計	96,585,416	54,708,170
負債合計	96,585,416	54,708,170
純資産の部		
元本等		
元本　※1	44,634,928,104	51,293,925,045
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	63,903,889,287	85,546,356,260
元本等合計	108,538,817,391	136,840,281,305
純資産合計	108,538,817,391	136,840,281,305
負債純資産合計	108,635,402,807	136,894,989,475

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年6月6日 至　2020年6月5日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
1．※1　期首	2018年6月6日	2019年6月6日
期首元本額	41,789,264,029円	44,634,928,104円
期中追加設定元本額	6,502,632,821円	17,525,522,578円
期中一部解約元本額	3,656,968,746円	10,866,525,637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	458,816,981円	454,031,179円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	12,197,180円	10,677,933円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	166,937,738円	131,184,690円

ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	19,605,630円	16,165,872円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	536,507,951円	444,326,612円
外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	2,865,539円	16,856,230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）	562,712,630円	551,473,507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）	1,662,511,603円	2,240,316,478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）	536,134,777円	642,283,389円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	6,510,581円	8,073,192円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	441,378円	6,420,807円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	899,220,107円	1,606,714,185円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	671,270,509円	980,707,358円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	16,447,253円	37,453,162円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	28,298,528,476円	32,474,283,197円
ダイワ・ライフ・バランス３０	567,362,106円	639,509,932円
ダイワ・ライフ・バランス５０	846,468,072円	992,831,299円
ダイワ・ライフ・バランス７０	648,673,708円	747,726,631円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,492,040,730円	1,568,575,057円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	3,377,054円	2,786,310円

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	13,225,157円	13,728,464円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	4,116,773円	7,398,922円
ダイワつみたてインデックス外国株式	58,160,984円	328,138,672円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	2,497,968円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	1,899,391円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	－円	2,385,040円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	73,977円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	151,649円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	1,168,038円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	1,759,327円	－円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	201,023,739円	187,704,863円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	330,653,891円	321,603,097円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,865,499,019円	2,699,584,193円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	147,919,110円	138,083,824円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	662,523,384円	788,846,647円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	106,348,298円	186,268,819円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	452,660円	127,037,653円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,690,012,613円	2,770,721,586円
ダイワライフスタイル２５	19,377,609円	20,088,972円
ダイワライフスタイル５０	68,025,943円	70,781,731円
ダイワライフスタイル７５	55,805,930円	54,758,183円

計	44,634,928,104円	51,293,925,045円
2. 期末日における受益権の総数	44,634,928,104口	51,293,925,045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 2019年6月6日 至 2020年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年6月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	3,186,864,865	△2,767,010,734
投資証券	245,721,587	△413,560,522
合計	3,432,586,452	△3,180,571,256

（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2019年6月5日まで、及び2019年12月3日から2020年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種　類	2019年6月5日 現在				2020年6月5日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買　建	1,244,738,495	－	1,213,218,600	△31,519,895	1,429,210,755	－	1,507,853,315	78,642,560
合計	1,244,738,495	－	1,213,218,600	△31,519,895	1,429,210,755	－	1,507,853,315	78,642,560

（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	2019年6月5日 現在				2020年6月5日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	54,029,150	－	53,935,000	△94,150	204,591,810	－	207,138,000	2,546,190
アメリカ・ドル	54,029,150	－	53,935,000	△94,150	204,591,810	－	207,138,000	2,546,190
合計	54,029,150	－	53,935,000	△94,150	204,591,810	－	207,138,000	2,546,190

（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）

	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
1口当たり純資産額	2.4317円	2.6678円
（1万口当たり純資産額）	(24,317円)	(26,678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	3,550	124.000	440,200.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,230	226.690	732,208.700	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,100	102.380	624,518.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,400	80.650	354,860.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,780	121.880	216,946.400	
	SYNCHRONY FINANCIAL	18,500	24.330	450,105.000	
	ABBOTT LABORATORIES	56,166	88.250	4,956,649.500	
	HOWMET AEROSPACE INC	13,233	15.530	205,508.490	
	VERISK ANALYTICS INC	4,950	164.460	814,077.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	11,100	52.350	581,085.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	9,400	101.570	954,758.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	19,662	136.270	2,679,340.740	
	QORVO INC	3,650	113.400	413,910.000	
	AFLAC INC	23,350	39.330	918,355.500	
	DARDEN RESTAURANTS INC	4,150	86.040	357,066.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,050	53.470	270,023.500	
	ADOBE INC	15,350	385.800	5,922,030.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,050	31.750	223,837.500	
	LULULEMON ATHLETICA INC	3,990	317.420	1,266,505.800	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,400	12.650	182,160.000	
	GARMIN LTD	4,650	93.270	433,705.500	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,110	243.970	1,734,626.700	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	22,750	155.910	3,546,952.500	
WR BERKLEY CORP	4,575	61.420	280,996.500	
AUTOZONE INC	770	1,134.800	873,796.000	
DOLLAR TREE INC	7,721	93.260	720,060.460	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	36,650	12.750	467,287.500	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,500	77.830	272,405.000	
CELANESE CORP	3,750	96.390	361,462.500	
DR HORTON INC	10,816	53.580	579,521.280	
DENTSPLY SIRONA INC	7,000	48.040	336,280.000	
AUTODESK INC	7,100	225.200	1,598,920.000	
MOODY'S CORP	5,350	276.030	1,476,760.500	
ALBEMARLE CORP	3,550	79.970	283,893.500	
ATMOS ENERGY CORP	4,000	104.220	416,880.000	
ALLIANT ENERGY CORP	7,550	50.100	378,255.000	
CITIGROUP INC	67,973	55.650	3,782,697.450	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	13,870	149.970	2,080,083.900	
AMERICAN ELECTRIC POWER	15,600	84.400	1,316,640.000	
ALLEGHANY CORP	480	553.800	265,824.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,200	382.780	459,336.000	
HESS CORP	8,500	52.480	446,080.000	
DAVITA INC	3,500	82.390	288,365.000	
DANAHER CORP	19,950	168.790	3,367,360.500	
FORTIVE CORP	9,850	67.460	664,481.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	17,550	95.790	1,681,114.500	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	17,800	41.140	732,292.000	
BUNGE LTD	4,450	41.300	183,785.000	
TE CONNECTIVITY LTD	10,675	88.820	948,153.500	
APPLE INC	139,700	322.320	45,028,104.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,200	58.260	594,252.000	
BOEING CO/THE	17,060	184.300	3,144,158.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,765	64.630	307,961.950	
BECTON DICKINSON AND CO	8,719	243.550	2,123,512.450	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	18.810	126,027.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,350	105.970	460,969.500	
CDK GLOBAL INC	4,000	41.540	166,160.000	
NISOURCE INC	11,800	24.620	290,516.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,200	82.300	345,660.000	

BANK OF NEW YORK MELLON CORP	26,321	40.440	1,064,421.240	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	131,704	57.220	7,536,102.880	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	44,150	192.050	8,479,007.500	
ANSYS INC	2,780	282.160	784,404.800	
TRUIST FINANCIAL CORP	43,117	41.870	1,805,308.790	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	21,700	58.490	1,269,233.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	72,850	60.890	4,435,836.500	
JPMORGAN CHASE & CO	98,070	106.440	10,438,570.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	7,350	126.350	928,672.500	
LKQ CORP	10,350	30.445	315,105.750	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,480	195.480	289,310.400	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,062	65.400	658,054.800	
CADENCE DESIGN SYS INC	9,050	91.270	825,993.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,110	153.120	629,323.200	
DOLLAR GENERAL CORP	8,100	185.880	1,505,628.000	
SERVICENOW INC	6,080	376.950	2,291,856.000	
CATERPILLAR INC	17,650	128.960	2,276,144.000	
BROWN & BROWN INC	7,450	42.040	313,198.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,300	44.510	324,923.000	
CMS ENERGY CORP	9,300	58.790	546,747.000	
MOSAIC CO/THE	10,950	13.860	151,767.000	
DELTA AIR LINES INC	5,150	32.380	166,757.000	
CORNING INC	24,600	24.750	608,850.000	
CISCO SYSTEMS INC	135,250	46.860	6,337,815.000	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	4,200	55.860	234,612.000	
MORGAN STANLEY	38,100	48.690	1,855,089.000	
MSCI INC	2,700	311.580	841,266.000	
FAIR ISAAC CORP	950	407.070	386,716.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,100	225.710	248,281.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7,100	60.120	426,852.000	
BROADCOM INC	12,772	308.890	3,945,143.080	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,580	131.900	472,202.000	
ARAMARK	8,600	28.220	242,692.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,250	24.500	177,625.000	
DTE ENERGY COMPANY	6,250	111.130	694,562.500	
CENTENE CORP	18,387	64.390	1,183,938.930	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,500	101.030	353,605.000	

CITIZENS FINANCIAL GROUP	14,250	28.460	405,555.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,150	98.200	603,930.000	
GARTNER INC	2,920	130.580	381,293.600	
SPLUNK INC	5,030	181.580	913,347.400	
DOMINION ENERGY INC	26,841	84.960	2,280,411.360	
MONSTER BEVERAGE CORP	12,850	70.920	911,322.000	
SMITH (A.O.) CORP	4,700	50.570	237,679.000	
DEERE & CO	9,450	161.140	1,522,773.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	9,634	183.510	1,767,935.340	
VMWARE INC-CLASS A	2,680	148.080	396,854.400	
CABLE ONE INC	150	1,763.890	264,583.500	
BURLINGTON STORES INC	2,050	210.050	430,602.500	
NASDAQ INC	3,700	117.930	436,341.000	
VAIL RESORTS INC	1,360	206.970	281,479.200	
EAST WEST BANCORP INC	4,600	38.890	178,894.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,950	97.260	189,657.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,430	65.900	160,137.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	10,550	74.830	789,456.500	
COGNEX CORP	5,500	56.230	309,265.000	
TELEFLEX INC	1,500	366.600	549,900.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,800	117.600	329,280.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,400	205.390	492,936.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	710	463.850	329,333.500	
CATALENT INC	5,200	76.910	399,932.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4,280	206.200	882,536.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,000	173.580	347,160.000	
IDEX CORP	2,400	163.960	393,504.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	26,100	70.750	1,846,575.000	
ROLLINS INC	4,925	43.520	214,336.000	
AMETEK INC	7,425	94.210	699,509.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,800	74.270	579,306.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,350	40.770	177,349.500	
HEICO CORP	1,400	110.780	155,092.000	
XPO LOGISTICS INC	2,800	81.610	228,508.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,240	311.180	385,863.200	

LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,600	73.950	635,970.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,220	371.580	453,327.600	
COSTCO WHOLESALE CORP	14,050	310.750	4,366,037.500	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,600	105.540	274,404.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,800	224.390	403,902.000	
RPM INTERNATIONAL INC	4,100	77.440	317,504.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	850	1,041.560	885,326.000	
UGI CORP	7,050	34.110	240,475.500	
CUMMINS INC	4,850	174.810	847,828.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	24,700	69.810	1,724,307.000	
CDW CORP/DE	4,650	116.750	542,887.500	
SIGNATURE BANK	1,650	110.540	182,391.000	
COSTAR GROUP INC	1,170	652.740	763,705.800	
SVB FINANCIAL GROUP	1,610	223.190	359,335.900	
AMERCO	290	329.920	95,676.800	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,000	165.940	497,820.000	
MERCADOLIBRE INC	1,440	839.990	1,209,585.600	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,500	178.070	445,175.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	9,016	86.340	778,441.440	
IPG PHOTONICS CORP	1,170	161.290	188,709.300	
DEXCOM INC	2,900	344.850	1,000,065.000	
NORDSON CORP	1,850	190.520	352,462.000	
COPART INC	6,850	89.740	614,719.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	5,150	47.680	245,552.000	
SEATTLE GENETICS INC	3,750	150.430	564,112.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,420	260.070	629,369.400	
TRANSDIGM GROUP INC	1,650	481.730	794,854.500	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,800	120.110	336,308.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	11,100	15.950	177,045.000	
KINDER MORGAN INC	64,681	16.230	1,049,772.630	
HCA HEALTHCARE INC	8,600	106.960	919,856.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,220	499.040	608,828.800	
CABOT OIL & GAS CORP	13,450	19.980	268,731.000	
T-MOBILE US INC	13,471	100.170	1,349,390.070	
ZILLOW GROUP INC - C	4,550	61.420	279,461.000	
COCA-COLA CO/THE	129,850	47.920	6,222,412.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	7,100	40.310	286,201.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,250	77.610	407,452.500	

FRANKLIN RESOURCES INC	9,500	21.590	205,105.000	
CSX CORP	24,850	74.040	1,839,894.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,130	180.640	565,403.200	
EXPEDIA GROUP INC	4,375	89.880	393,225.000	
AUTOLIV INC	2,750	68.510	188,402.500	
AMAZON.COM INC	13,500	2,460.600	33,218,100.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19,740	71.000	1,401,540.000	
EXXON MOBIL CORP	135,005	49.100	6,628,745.500	
FLIR SYSTEMS INC	4,200	46.930	197,106.000	
AES CORP	21,900	13.840	303,096.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,350	217.130	293,125.500	
EOG RESOURCES INC	18,550	55.150	1,023,032.500	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5,200	101.840	529,568.000	
ABIOMED INC	1,440	236.020	339,868.800	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,950	99.450	492,277.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,790	91.140	892,260.600	
FORD MOTOR CO	123,123	6.570	808,918.110	
DISCOVERY INC - A	4,690	23.090	108,292.100	
EXACT SCIENCES CORP	4,600	84.800	390,080.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	22.680	110,837.160	
LIBERTY BROADBAND-A	850	133.640	113,594.000	
DISCOVERY INC-C	12,089	20.860	252,176.540	
AERCAP HOLDINGS NV	4,000	37.470	149,880.000	
FORTINET INC	4,800	139.580	669,984.000	
MARKEL CORP	440	981.410	431,820.400	
NEXTERA ENERGY INC	15,600	251.890	3,929,484.000	
MASIMO CORP	1,700	218.610	371,637.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	47,208	10.200	481,521.600	
INSULET CORP	1,950	172.980	337,311.000	
US BANCORP	46,700	40.070	1,871,269.000	
UNITED RENTALS INC	2,500	151.380	378,450.000	
F5 NETWORKS INC	1,900	142.890	271,491.000	
FASTENAL CO	18,600	41.700	775,620.000	
FISERV INC	18,583	105.750	1,965,152.250	
GENERAL ELECTRIC CO	280,550	7.740	2,171,457.000	
GENERAL MOTORS CO	40,600	29.160	1,183,896.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	7,750	157.090	1,217,447.500	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,540	214.820	2,264,202.800	

ALPHABET INC-CL A	9,560	1,414.300	13,520,708.000	
ALPHABET INC-CL C	9,787	1,412.180	13,821,005.660	
OWENS CORNING	3,750	55.940	209,775.000	
GENERAL MILLS INC	19,150	60.760	1,163,554.000	
FIRSTENERGY CORP	17,168	42.360	727,236.480	
GENUINE PARTS CO	4,550	90.240	410,592.000	
IHS MARKIT LTD	12,134	71.420	866,610.280	
FIFTH THIRD BANCORP	23,000	22.705	522,215.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	6,960	199.480	1,388,380.800	
HALLIBURTON CO	29,600	13.190	390,424.000	
HOME DEPOT INC	34,800	248.950	8,663,460.000	
ASSURANT INC	1,900	110.390	209,741.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,800	10.470	332,946.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,290	198.520	256,090.800	
HERSHEY CO/THE	4,740	133.430	632,458.200	
HUMANA INC	4,250	392.270	1,667,147.500	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,000	109.550	985,950.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,410	254.060	612,284.600	
HENRY SCHEIN INC	4,850	63.280	306,908.000	
HP INC	47,100	16.470	775,737.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	41,900	10.480	439,112.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,978	38.850	232,245.300	
HOLLYFRONTIER CORP	4,700	34.420	161,774.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,500	36.400	236,600.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	39.060	115,227.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	13,200	32.790	432,828.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	21,753	31.490	685,001.970	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	28,400	128.890	3,660,476.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	11,500	37.830	435,045.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,350	63.720	277,182.000	
ZOETIS INC	15,250	140.520	2,142,930.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	7,579	95.540	724,097.660	
CHENIERE ENERGY INC	7,600	48.450	368,220.000	
ALLEGION PLC	2,900	106.090	307,661.000	

LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	22.040	285,924.920	
WASTE CONNECTIONS INC	8,507	93.660	796,765.620	
JUNIPER NETWORKS INC	10,500	24.640	258,720.000	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,400	145.010	348,024.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,670	109.100	400,397.000	
JOHNSON & JOHNSON	84,000	146.730	12,325,320.000	
ABBVIE INC	56,072	93.040	5,216,938.880	
HOLOGIC INC	8,350	52.320	436,872.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	11,000	137.720	1,514,920.000	
KROGER CO	25,500	33.110	844,305.000	
KLA CORP	5,030	186.290	937,038.700	
LOCKHEED MARTIN CORP	8,080	403.670	3,261,653.600	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,680	257.310	689,590.800	
LOWE'S COS INC	24,450	128.680	3,146,226.000	
ELI LILLY & CO	27,405	150.710	4,130,207.550	
LAM RESEARCH CORP	4,590	291.840	1,339,545.600	
JONES LANG LASALLE INC	1,650	116.580	192,357.000	
LOEWS CORP	8,300	36.500	302,950.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,249	43.500	271,831.500	
MCDONALD'S CORP	23,750	193.240	4,589,450.000	
3M CO	18,350	162.550	2,982,792.500	
FACEBOOK INC-CLASS A	76,600	226.290	17,333,814.000	
S&P GLOBAL INC	7,800	327.390	2,553,642.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,960	211.500	414,540.000	
CONCHO RESOURCES INC	6,200	64.330	398,846.000	
PHILLIPS 66	14,150	83.130	1,176,289.500	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,250	21.720	331,230.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,850	170.770	657,464.500	
MYLAN NV	16,050	17.700	284,085.000	
METLIFE INC	24,800	39.340	975,632.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	21,700	35.890	778,813.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,870	228.660	427,594.200	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	33.680	161,664.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,458	149.230	814,497.340	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	780	840.660	655,714.800	
BAKER HUGHES CO	21,373	17.150	366,546.950	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,760	222.490	836,562.400	

MERCK & CO. INC.	80,821	81.550	6,590,952.550	
DUPONT DE NEMOURS INC	23,468	54.980	1,290,270.640	
MASCO CORP	9,300	47.800	444,540.000	
M & T BANK CORP	4,039	117.900	476,198.100	
MARSH & MCLENNAN COS	15,850	108.720	1,723,212.000	
BLACK KNIGHT INC	4,700	72.740	341,878.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,600	92.650	240,890.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	8,772	104.820	919,481.040	
WORKDAY INC-CLASS A	5,380	175.300	943,114.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,100	177.560	372,876.000	
SQUARE INC - A	11,100	87.720	973,692.000	
TRANSUNION	6,150	91.410	562,171.500	
VISTRA ENERGY CORP	14,250	20.280	288,990.000	
BEIGENE LTD-ADR	1,250	171.510	214,387.500	
NETAPP INC	7,450	45.260	337,187.000	
NIKE INC -CL B	39,650	101.280	4,015,752.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,200	191.500	1,570,300.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,750	106.850	828,087.500	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,150	79.270	328,970.500	
ALLY FINANCIAL INC	12,950	21.210	274,669.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,120	335.740	1,718,988.800	
APTIV PLC	8,100	83.690	677,889.000	
NEWMONT CORP	25,861	55.900	1,445,629.900	
MCKESSON CORP	5,550	159.520	885,336.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,700	60.570	526,959.000	
XYLEM INC	5,870	70.380	413,130.600	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	49,600	75.190	3,729,424.000	
NUCOR CORP	9,400	44.640	419,616.000	
WESTERN UNION CO	12,946	23.500	304,231.000	
GODADDY INC - CLASS A	5,700	79.140	451,098.000	
NEWELL BRANDS INC	13,742	15.465	212,520.030	
EVERGY INC	7,400	62.410	461,834.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	29,224	15.550	454,433.200	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	820	180.900	148,338.000	
OKTA INC	3,660	186.290	681,821.400	
COUPA SOFTWARE INC	2,200	218.050	479,710.000	
LIBERTY BROADBAND-C	3,350	136.140	456,069.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	12,405	22.530	279,484.650	

LINDE PLC	16,996	212.560	3,612,669.760	
WIX.COM LTD	1,700	219.750	373,575.000	
EQUITABLE HOLDINGS INC	13,300	21.810	290,073.000	
KKR & CO INC	16,300	30.310	494,053.000	
PAYCHEX INC	10,250	74.190	760,447.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,410	413.850	997,378.500	
ALTRIA GROUP INC	59,600	40.730	2,427,508.000	
PFIZER INC	176,513	36.010	6,356,233.130	
CIGNA CORP	11,910	202.390	2,410,464.900	
DELL TECHNOLOGIES -C	7,851	49.200	386,269.200	
ALTICE USA INC- A	10,900	25.940	282,746.000	
XCEL ENERGY INC	16,550	65.030	1,076,246.500	
STERIS PLC	2,650	160.630	425,669.500	
FOX CORP - CLASS B	5,433	29.945	162,691.180	
FOX CORP - CLASS A	11,649	30.530	355,643.970	
STRYKER CORP	10,820	198.080	2,143,225.600	
DOW INC	23,468	42.710	1,002,318.280	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,800	63.500	177,800.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3,550	210.350	746,742.500	
PARKER HANNIFIN CORP	4,170	196.860	820,906.200	
UBER TECHNOLOGIES INC	30,700	36.430	1,118,401.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,350	103.550	553,992.500	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	78,717	116.050	9,135,107.850	
EXELON CORP	30,772	38.980	1,199,492.560	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,050	113.680	801,444.000	
TELADOC HEALTH INC	2,300	157.150	361,445.000	
INGERSOLL-RAND INC	11,358	30.680	348,463.440	
NVR INC	110	3,396.380	373,601.800	
CONOCOPHILLIPS	34,700	44.710	1,551,437.000	
TWILIO INC - A	3,850	193.050	743,242.500	
DOCUSIGN INC	5,550	140.060	777,333.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,610	303.170	488,103.700	
MATCH GROUP INC	1,800	91.380	164,484.000	
PEPSICO INC	44,300	130.570	5,784,251.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,300	105.080	136,604.000	
DROPBOX INC-CLASS A	8,000	23.280	186,240.000	

MONGODB INC	1,500	220.040	330,060.000	
SNAP INC - A	28,300	19.260	545,058.000	
CORTEVA INC	23,968	30.170	723,114.560	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,800	65.460	837,888.000	
AMCOR PLC	50,100	10.530	527,553.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,500	95.980	335,930.000	
ROKU INC	3,050	102.930	313,936.500	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,750	130.700	751,525.000	
ACCENTURE PLC-CL A	20,230	203.100	4,108,713.000	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	10,200	37.940	386,988.000	
PENTAIR PLC	5,505	41.090	226,200.450	
QUALCOMM INC	36,450	86.040	3,136,158.000	
INVESCO LTD	12,000	9.560	114,720.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,200	142.200	312,840.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,200	44.640	410,688.000	
DATADOG INC - CLASS A	3,500	71.760	251,160.000	
PINTEREST INC- CLASS A	11,900	21.200	252,280.000	
AVALARA INC	2,500	101.470	253,675.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,250	598.540	1,945,255.000	
REPUBLIC SERVICES INC	7,100	86.840	616,564.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,310	1,742.640	2,282,858.400	
ROSS STORES INC	11,450	98.960	1,133,092.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,100	108.630	336,753.000	
RESMED INC	4,700	160.810	755,807.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,350	119.530	519,955.500	
ROBERT HALF INTL INC	3,950	55.860	220,647.000	
MODERNA INC	7,000	60.590	424,130.000	
RALPH LAUREN CORP	1,450	84.920	123,134.000	
PERKINELMER INC	3,550	103.020	365,721.000	
CARRIER GLOBAL CORP	26,637	22.680	604,127.160	
OTIS WORLDWIDE CORP	13,268	55.400	735,047.200	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,800	51.320	297,656.000	
AVANTOR INC	13,500	18.480	249,480.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	4,700	29.750	139,825.000	
DYNATRACE INC	4,300	36.150	155,445.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,350	337.240	455,274.000	

REGIONS FINANCIAL CORP	30,235	12.930	390,938.550	
CHEVRON CORP	59,818	96.280	5,759,277.040	
EDISON INTERNATIONAL	11,450	59.060	676,237.000	
TESLA INC	4,700	864.380	4,062,586.000	
NORTONLIFELOCK INC	19,550	21.100	412,505.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,022	142.500	715,635.000	
SYNOPSYS INC	4,900	182.450	894,005.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,685	540.030	2,530,040.550	
CBRE GROUP INC - A	10,850	50.410	546,948.500	
TWITTER INC	25,250	33.720	851,430.000	
SOUTHERN CO/THE	33,850	57.950	1,961,607.500	
SYSCO CORP	15,400	58.590	902,286.000	
TRAVELERS COS INC/THE	8,153	118.000	962,054.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	58.550	251,765.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,300	28.160	205,568.000	
SCHLUMBERGER LTD	44,302	20.330	900,659.660	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,050	39.290	198,414.500	
AT&T INC	228,791	31.800	7,275,553.800	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,700	38.270	179,869.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	14,100	18.980	267,618.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,680	575.160	1,541,428.800	
SEMPRA ENERGY	9,420	128.790	1,213,201.800	
TIFFANY & CO	3,470	114.530	397,419.100	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,650	54.050	413,482.500	
TEXAS INSTRUMENTS INC	29,750	128.580	3,825,255.000	
SALESFORCE.COM INC	26,821	171.440	4,598,192.240	
WESTROCK CO	8,530	30.690	261,785.700	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	24,484	34.410	842,494.440	
TERADYNE INC	5,500	73.190	402,545.000	
UNION PACIFIC CORP	21,980	176.430	3,877,931.400	
MARATHON PETROLEUM CORP	20,588	38.040	783,167.520	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	48,329	67.510	3,262,690.790	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	22,550	103.200	2,327,160.000	
IQVIA HOLDINGS INC	6,244	151.210	944,155.240	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	49.830	216,760.500	
AMEREN CORPORATION	8,050	73.990	595,619.500	

UNITEDHEALTH GROUP INC	30,226	298.080	9,009,766.080	
VERISIGN INC	3,370	210.230	708,475.100	
VALERO ENERGY CORP	13,142	70.050	920,597.100	
ULTA BEAUTY INC	1,760	247.980	436,444.800	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8,688	34.300	297,998.400	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,500	102.910	257,275.000	
ANTHEM INC	8,100	282.090	2,284,929.000	
WALT DISNEY CO/THE	57,562	123.690	7,119,843.780	
WELLS FARGO & CO	125,022	30.220	3,778,164.840	
WASTE MANAGEMENT INC	13,400	107.990	1,447,066.000	
WILLIAMS COS INC	38,900	20.710	805,619.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,700	122.380	452,806.000	
WHIRLPOOL CORP	2,150	134.890	290,013.500	
WALMART INC	45,200	122.110	5,519,372.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,550	129.510	848,290.500	
WYNN RESORTS LTD	3,250	95.380	309,985.000	
WABTEC CORP	5,861	67.380	394,914.180	
TJX COMPANIES INC	38,650	54.830	2,119,179.500	
WATERS CORP	2,050	202.390	414,899.500	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,760	261.170	459,659.200	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	23,900	44.200	1,056,380.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,173	204.050	851,500.650	
WESTERN DIGITAL CORP	9,750	45.980	448,305.000	
WEC ENERGY GROUP INC	9,980	92.570	923,848.600	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	16,100	51.940	836,234.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	54,400	193.640	10,534,016.000	
PPL CORP	24,800	30.010	744,248.000	
PULTEGROUP INC	8,900	35.010	311,589.000	
PPG INDUSTRIES INC	7,650	111.120	850,068.000	
NORTHERN TRUST CORP	6,400	87.980	563,072.000	
NVIDIA CORP	19,500	350.660	6,837,870.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,530	281.960	713,358.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	13,843	122.720	1,698,812.960	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,300	34.980	185,394.000	
TYSON FOODS INC-CL A	9,400	64.070	602,258.000	

NETFLIX INC	13,970	414.330	5,788,190.100	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12,690	348.150	4,418,023.500	
NRG ENERGY INC	7,950	35.440	281,748.000	
GLOBE LIFE INC	3,225	82.640	266,514.000	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,600	117.950	660,520.000	
TEXTRON INC	7,700	36.970	284,669.000	
NEWS CORP - CLASS A	11,737	12.790	150,116.230	
OGE ENERGY CORP	6,750	32.660	220,455.000	
OMNICOM GROUP	6,750	57.860	390,555.000	
ORACLE CORP	71,283	52.850	3,767,306.550	
MASTERCARD INC - A	28,550	301.370	8,604,113.500	
ONEOK INC	13,600	40.710	553,656.000	
CENTURYLINK INC	32,052	10.600	339,751.200	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,420	402.240	1,375,660.800	
YUM! BRANDS INC	9,550	94.990	907,154.500	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	3,550	127.590	452,944.500	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,050	42.310	255,975.500	
BANK OF AMERICA CORP	252,101	26.780	6,751,264.780	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,130	372.560	420,992.800	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,850	107.510	628,933.500	
AMERICAN EXPRESS CO	21,900	106.540	2,333,226.000	
ANALOG DEVICES INC	11,649	122.380	1,425,604.620	
ADVANCED MICRO DEVICES	37,600	52.630	1,978,888.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,850	45.090	399,046.500	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	27,572	35.210	970,810.120	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,500	128.670	707,685.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,100	57.690	351,909.000	
AVERY DENNISON CORP	2,750	118.740	326,535.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,400	55.600	967,440.000	
EMERSON ELECTRIC CO	19,700	63.130	1,243,661.000	
AON PLC-CLASS A	7,370	197.990	1,459,186.300	
AMGEN INC	18,800	220.880	4,152,544.000	
EATON CORP PLC	13,086	91.990	1,203,781.140	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,330	175.730	936,640.900	
APPLIED MATERIALS INC	29,100	58.130	1,691,583.000	

CME GROUP INC	11,500	184.510	2,121,865.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,694	13.760	160,909.440	
ECOLAB INC	8,350	222.000	1,853,700.000	
EQUIFAX INC	3,900	176.570	688,623.000	
GILEAD SCIENCES INC	40,250	77.540	3,120,985.000	
KEURIG DR PEPPER INC	11,500	28.420	326,830.000	
HORMEL FOODS CORP	9,600	47.970	460,512.000	
STATE STREET CORP	11,593	69.030	800,264.790	
SCHWAB (CHARLES) CORP	36,400	41.680	1,517,152.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	16,500	88.630	1,462,395.000	
CAMPBELL SOUP CO	6,000	48.770	292,620.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,200	69.520	291,984.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,450	56.490	533,830.500	
FEDEX CORP	7,850	139.210	1,092,798.500	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	14,804	77.150	1,142,128.600	
FMC CORP	4,200	99.800	419,160.000	
CERNER CORP	10,050	71.370	717,268.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,274	135.760	444,478.240	
CITRIX SYSTEMS INC	4,050	139.930	566,716.500	
INTEL CORP	136,400	62.970	8,589,108.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	12,400	18.610	230,764.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	11,650	44.280	515,862.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	10,100	178.720	1,805,072.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	51,100	6.450	329,595.000	
ILLUMINA INC	4,720	358.400	1,691,648.000	
SEALED AIR CORP	5,000	33.840	169,200.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,730	564.250	2,104,652.500	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,850	108.850	419,072.500	
SNAP-ON INC	1,850	142.910	264,383.500	
CARMAX INC	5,400	93.130	502,902.000	
COMERICA INC	4,500	42.900	193,050.000	
INGREDION INC	2,150	87.620	188,383.000	
DUKE ENERGY CORP	23,528	88.440	2,080,816.320	
TARGET CORP	16,280	119.960	1,952,948.800	
DOVER CORP	4,550	103.520	471,016.000	
WW GRAINGER INC	1,490	316.330	471,331.700	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,250	87.590	372,257.500	

CINTAS CORP	2,820	269.210	759,172.200	
CONAGRA BRANDS INC	15,800	33.310	526,298.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,750	65.810	312,597.500	
CLOROX COMPANY	3,950	204.250	806,787.500	
ENTERGY CORP	6,350	101.230	642,810.500	
MICROSOFT CORP	230,700	182.920	42,199,644.000	
INCYTE CORP	5,750	93.800	539,350.000	
CVS HEALTH CORP	41,569	66.530	2,765,585.570	
MEDTRONIC PLC	42,688	96.990	4,140,309.120	
MICRON TECHNOLOGY INC	34,900	51.220	1,787,578.000	
BLACKROCK INC	4,900	546.190	2,676,331.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	15,800	18.050	285,190.000	
HASBRO INC	4,050	77.060	312,093.000	
KELLOGG CO	8,400	64.710	543,564.000	
KEYCORP	32,300	13.530	437,019.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,200	155.380	497,216.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	46,011	51.290	2,359,904.190	
COOPER COS INC/THE	1,620	313.860	508,453.200	
CHUBB LTD	14,519	134.530	1,953,241.070	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	73.790	199,233.000	
ALLSTATE CORP	10,250	101.860	1,044,065.000	
EBAY INC	25,650	49.360	1,266,084.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	35,450	154.600	5,480,570.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	4,550	73.310	333,560.500	
XILINX INC	8,000	95.680	765,440.000	
DISH NETWORK CORP-A	8,150	34.740	283,131.000	
ZIONS BANCORP NA	5,200	37.230	193,596.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7,050	201.120	1,417,896.000	
TRIMBLE INC	8,250	43.060	355,245.000	
LENNAR CORP-A	8,600	61.080	525,288.000	
LEAR CORP	1,800	115.420	207,756.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,000	50.110	350,770.000	
PROGRESSIVE CORP	18,400	78.800	1,449,920.000	
PACCAR INC	11,037	75.690	835,390.530	
BIOGEN INC	5,680	299.650	1,702,012.000	
IDEXX LABORATORIES INC	2,670	310.080	827,913.600	
STARBUCKS CORP	37,450	78.740	2,948,813.000	
PTC INC	3,400	80.260	272,884.000	

	PERRIGO CO PLC	4,200	55.230	231,966.000	
	EVERSOURCE ENERGY	10,630	85.530	909,183.900	
	INTUIT INC	8,310	282.920	2,351,065.200	
	BORGWARNER INC	7,100	34.970	248,287.000	
	BEST BUY CO INC	7,300	79.920	583,416.000	
	BALL CORP	10,584	75.400	798,033.600	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	43,897	37.420	1,642,625.740	
	ELECTRONIC ARTS INC	9,250	117.180	1,083,915.000	
	VULCAN MATERIALS CO	4,150	120.640	500,656.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,300	272.820	2,264,406.000	
	VF CORP	10,900	64.090	698,581.000	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	17,375	24.120	419,085.000	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,900	108.000	205,200.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,850	127.100	362,235.000	
	CARNIVAL CORP	15,300	18.480	282,744.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	144,790	41.290	5,978,379.100	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	7,200	21.750	156,600.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	7,100	42.490	301,679.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	4.700	42,300.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	35,300	4.200	148,260.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 852,777,735.070 (93,029,523,119)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	657,000	3.362	2,208,834.000	
	UNILEVER PLC	38,110	44.000	1,676,840.000	
	BARCLAYS PLC	568,800	1.235	702,581.760	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	64,500	3.240	208,980.000	
	PRUDENTIAL PLC	84,900	11.710	994,179.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	145,791	1.267	184,717.190	
	EVRAZ PLC	15,000	3.020	45,300.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,064	22.490	136,379.360	
	BAE SYSTEMS PLC	102,300	5.112	522,957.600	
	AVIVA PLC	128,966	2.812	362,652.390	
	AVEVA GROUP PLC	2,000	40.120	80,240.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	162,900	16.512	2,689,804.800	
	INFORMA PLC	49,900	4.918	245,408.200	

MELROSE INDUSTRIES PLC	145,500	1.294	188,277.000	
AUTO TRADER GROUP PLC	31,900	5.660	180,554.000	
DCC PLC	3,150	68.700	216,405.000	
OCADO GROUP PLC	15,200	21.360	324,672.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,667	112.600	187,704.200	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,300	100.250	230,575.000	
HALMA PLC	12,250	22.950	281,137.500	
GVC HOLDINGS PLC	19,100	8.270	157,957.000	
JD SPORTS FASHION PLC	13,000	6.650	86,450.000	
M&G PLC	75,700	1.507	114,117.750	
RELX PLC	63,146	19.345	1,221,559.370	
DIAGEO PLC	74,400	28.820	2,144,208.000	
RIO TINTO PLC	35,750	44.700	1,598,025.000	
STANDARD CHARTERED PLC	86,800	4.310	374,108.000	
TESCO PLC	320,700	2.311	741,137.700	
SMITH & NEPHEW PLC	27,950	16.925	473,053.750	
GLENCORE PLC	346,725	1.691	586,520.010	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,250	16.225	166,306.250	
SMITHS GROUP PLC	12,383	13.700	169,647.100	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	41,983	2.891	121,372.850	
PEARSON PLC	23,563	5.118	120,595.430	
SAINSBURY (J) PLC	54,225	1.998	108,368.660	
NEXT PLC	4,200	54.000	226,800.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	100,700	1.587	159,861.250	
WHITBREAD PLC	6,861	25.250	173,240.250	
BUNZL PLC	10,405	19.905	207,111.520	
VODAFONE GROUP PLC	870,183	1.371	1,193,543.000	
CRODA INTERNATIONAL PLC	4,011	52.020	208,652.220	
KINGFISHER PLC	62,411	1.980	123,573.780	
WPP PLC	38,400	6.720	258,048.000	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	20,627	9.360	193,068.720	
SEVERN TRENT PLC	7,133	24.980	178,182.340	
RENTOKIL INITIAL PLC	61,200	4.900	299,880.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	23,100	70.380	1,625,778.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	16,550	9.860	163,183.000	
SCHRODERS PLC	4,150	30.300	125,745.000	
SSE PLC	33,900	12.675	429,682.500	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	31,000	5.294	164,114.000	

	ASTRAZENECA PLC	42,500	85.300	3,625,250.000	
	FERGUSON PLC	7,487	65.760	492,345.120	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	195,500	2.295	448,672.500	
	3I GROUP PLC	31,391	8.806	276,429.140	
	ASHTEAD GROUP PLC	14,650	24.940	365,371.000	
	SAGE GROUP PLC/THE	35,114	6.856	240,741.580	
	NATIONAL GRID PLC	114,434	9.438	1,080,028.090	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,296,465	0.338	778,157.160	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	31,760	4.274	135,742.240	
	IMPERIAL BRANDS PLC	30,400	14.890	452,656.000	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,150	43.630	181,064.500	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	74,310	32.000	2,377,920.000	
	BHP GROUP PLC	68,727	16.690	1,147,053.630	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,500	19.750	227,125.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	658,650	3.994	2,630,648.100	
	ANGLO AMERICAN PLC	40,383	17.804	718,978.930	
	MONDI PLC	15,650	15.855	248,130.750	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	73,400	1.884	138,322.300	
	COMPASS GROUP PLC	52,139	12.880	671,550.320	
	PERSIMMON PLC	9,900	24.570	243,243.000	
	BT GROUP PLC	290,100	1.158	335,935.800	
	COCA-COLA HBC AG-DI	6,550	21.050	137,877.500	
	BURBERRY GROUP PLC	12,189	16.400	199,899.600	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	5,636	41.060	231,414.160	
	INTERTEK GROUP PLC	5,200	54.780	284,856.000	
	ITV PLC	120,100	0.876	105,303.680	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	10,099	82.700	835,187.300	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	132,500	13.892	1,840,690.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	121,018	13.344	1,614,864.190	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,000	23.920	119,600.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,150	23.250	142,987.500	
	ANTOFAGASTA PLC	11,400	8.916	101,642.400	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	2.668	189,059.810	
	EXPERIAN PLC	29,654	29.140	864,117.560	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 49,064,954.310	

				(6,742,996,671)	
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	10.880	375,360.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,400	176.500	247,100.000	
	ICL GROUP LTD	23,600	12.660	298,776.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	750	518.000	388,500.000	
	BANK HAPOALIM BM	35,700	21.350	762,195.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	51,200	19.220	984,064.000	
	NICE LTD	2,050	648.800	1,330,040.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,100	70.150	287,615.000	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 4,673,650.000 (147,547,130)	
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	88,800	2.900	257,520.000	
	BHP GROUP LTD	93,750	36.310	3,404,062.500	
	SOUTH32 LTD	151,600	2.210	335,036.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	30,550	23.170	707,843.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	54,000	14.600	788,400.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	102,450	18.920	1,938,354.000	
	WESTPAC BANKING CORP	114,948	18.180	2,089,754.640	
	SANTOS LTD	53,100	5.660	300,546.000	
	AUSNET SERVICES	50,000	1.780	89,000.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	89,050	19.210	1,710,650.500	
	RIO TINTO LTD	11,750	98.400	1,156,200.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	53,500	6.160	329,560.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	4.820	289,200.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	20.140	68,476.000	
	COLES GROUP LTD	43,045	15.940	686,137.300	
	WISETECH GLOBAL LTD	4,500	22.510	101,295.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	25,000	13.480	337,000.000	
	EVOLUTION MINING LTD	53,000	5.700	302,100.000	
	AFTERPAY LTD	7,000	52.200	365,400.000	
	OIL SEARCH LTD	64,200	3.500	224,700.000	
	SEEK LTD	9,600	20.600	197,760.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	23,500	10.600	249,100.000	

	NEWCREST MINING LTD	26,000	29.060	755,560.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	56,350	67.660	3,812,641.000	
	AMPOL LTD	7,150	28.270	202,130.500	
	ORICA LTD	13,100	17.600	230,560.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	46,450	8.830	410,153.500	
	CIMIC GROUP LTD	2,800	26.790	75,012.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	39,700	36.600	1,453,020.000	
	COCA-COLA AMATIL LTD	15,700	8.980	140,986.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	66,700	3.450	230,115.000	
	CROWN RESORTS LTD	11,600	10.290	119,364.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	24,000	4.490	107,760.000	
	TELSTRA CORP LTD	134,500	3.270	439,815.000	
	AMP LTD	102,000	1.790	182,580.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	13,350	26.720	356,712.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	10,684	117.510	1,255,476.840	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	18,450	27.180	501,471.000	
	CSL LTD	14,450	294.230	4,251,623.500	
	WESFARMERS LTD	36,000	42.300	1,522,800.000	
	COCHLEAR LTD	2,050	197.000	403,850.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	12.210	199,023.000	
	SUNCORP GROUP LTD	38,257	9.570	366,119.490	
	ASX LTD	6,250	88.700	554,375.000	
	COMPUTERSHARE LTD	15,900	13.410	213,219.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	70,936	6.200	439,803.200	
	SONIC HEALTHCARE LTD	14,350	28.960	415,576.000	
	AGL ENERGY LTD	19,000	17.590	334,210.000	
	BRAMBLES LTD	50,400	11.420	575,568.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,750	69.400	399,050.000	
	TPG TELECOM LTD	12,000	7.850	94,200.000	
	REA GROUP LTD	1,600	105.690	169,104.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	3,800	58.590	222,642.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 36,362,615.470 (2,751,195,487)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	8,300	23.520	195,216.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	600	1,515.390	909,234.000	

RESTAURANT BRANDS INTERN	9,287	78.040	724,757.480	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	14,400	52.680	758,592.000	
INTACT FINANCIAL CORP	4,650	132.400	615,660.000	
BCE INC	4,530	58.860	266,635.800	
FRANCO-NEVADA CORP	6,000	179.040	1,074,240.000	
SUNCOR ENERGY INC	48,530	25.960	1,259,838.800	
METRO INC/CN	8,200	55.930	458,626.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	11,000	64.530	709,830.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	39,300	59.050	2,320,665.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,150	95.630	1,353,164.500	
TORONTO-DOMINION BANK	58,400	62.370	3,642,408.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	8,300	23.740	197,042.000	
ROYAL BANK OF CANADA	45,850	94.910	4,351,623.500	
TC ENERGY CORP	30,450	61.990	1,887,595.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	17,829	35.120	626,154.480	
BARRICK GOLD CORP	57,700	31.630	1,825,051.000	
CAE INC	7,900	24.180	191,022.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,212	94.220	585,294.640	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,300	30.210	160,113.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,650	45.500	211,575.000	
HYDRO ONE LTD	10,500	26.360	276,780.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	67.090	366,311.400	
WSP GLOBAL INC	3,400	87.300	296,820.000	
PARKLAND CORP	4,400	38.740	170,456.000	
QUEBECOR INC -CL B	5,300	30.500	161,650.000	
EMERA INC	7,700	55.290	425,733.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,000	32.810	131,240.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	11,200	57.960	649,152.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	7,800	78.630	613,314.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	16,700	19.470	325,149.000	
B2GOLD CORP	34,700	7.050	244,635.000	
AIR CANADA	4,100	19.420	79,622.000	
KINROSS GOLD CORP	37,900	8.510	322,529.000	
BANK OF MONTREAL	20,700	74.150	1,534,905.000	
POWER CORP OF CANADA	18,100	24.730	447,613.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,300	992.550	3,275,415.000	
NUTRIEN LTD	18,219	49.540	902,569.260	
CANOPY GROWTH CORP	7,400	22.400	165,760.000	

CRONOS GROUP INC	5,500	9.000	49,500.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,800	51.030	449,064.000	
CAMECO CORP	12,800	13.910	178,048.000	
TELUS CORP	10,800	24.590	265,572.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	15,100	14.430	217,893.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	121.840	219,312.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	37,600	27.410	1,030,616.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	430.120	387,108.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,200	60.840	559,728.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,537	96.410	244,592.170	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,000	37.180	260,260.000	
BLACKBERRY LTD	16,000	7.070	113,120.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	18,650	50.920	949,658.000	
ENBRIDGE INC	65,400	44.140	2,886,756.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	43,425	46.590	2,023,170.750	
MANULIFE FINANCIAL CORP	61,500	18.480	1,136,520.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	9,500	26.140	248,330.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,500	349.290	1,571,805.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,300	46.660	153,978.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,300	20.980	132,174.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,050	120.210	2,770,840.500	
CGI INC - CLASS A	7,900	90.410	714,239.000	
ONEX CORPORATION	2,600	63.770	165,802.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	15,100	23.790	359,229.000	
IGM FINANCIAL INC	2,400	34.270	82,248.000	
TMX GROUP LTD	1,900	131.460	249,774.000	
OPEN TEXT CORP	8,700	57.430	499,641.000	
CI FINANCIAL CORP	7,000	17.350	121,450.000	
SAPUTO INC	8,000	33.120	264,960.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	8.540	164,822.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	27,500	42.680	1,173,700.000	
YAMANA GOLD INC	32,300	6.920	223,516.000	
FORTIS INC	15,000	53.250	798,750.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,800	58.280	221,464.000	
LUNDIN MINING CORP	19,400	6.720	130,368.000	
CENOVUS ENERGY INC	31,400	6.500	204,100.000	
DOLLARAMA INC	9,700	47.990	465,503.000	

	ATCO LTD -CLASS I	2,200	38.370	84,414.000	
	ALTAGAS LTD	7,900	15.110	119,369.000	
	KEYERA CORP	7,400	22.480	166,352.000	
	INTER PIPELINE LTD	12,800	13.050	167,040.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 56,938,778.780 (4,598,375,774)	
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	42,000	21.630	908,460.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	57,500	21.990	1,264,425.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	43,675	4.380	191,296.500	
	KEPPEL CORP LTD	51,300	6.270	321,651.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	7.360	103,040.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	13,600	8.810	119,816.000	
	CAPITALAND LTD	82,900	3.140	260,306.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	69,300	1.010	69,993.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	23.100	62,370.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	106,200	9.300	987,660.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	209,000	0.820	171,380.000	
	VENTURE CORP LTD	8,600	16.480	141,728.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	278,950	2.580	719,691.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	50,000	3.490	174,500.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,300	8.400	229,320.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	58,900	4.090	240,901.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 5,966,537.500 (465,807,583)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	122,600	11.005	1,349,213.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	260	716.000	186,160.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,650	48.660	226,269.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	22,630	332.750	7,530,132.500	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,100	77.000	84,700.000	
	SIKA AG-REG	4,160	172.500	717,600.000	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	84,800.000	254,400.000	
	ABB LTD-REG	60,100	20.520	1,233,252.000	
	SWISS RE AG	9,400	75.980	714,212.000	
	NESTLE SA-REG	95,900	102.760	9,854,684.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	590	820.000	483,800.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,260	227.800	287,028.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	81,370	9.700	789,289.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	7,400	43.000	318,200.000	
	SGS SA-REG	190	2,351.000	446,690.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	580	225.000	130,500.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,450	146.850	212,932.500	
	TEMENOS AG - REG	2,120	145.150	307,718.000	
	ALCON INC	16,130	60.960	983,284.800	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	850	202.200	171,870.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,862	342.700	1,666,207.400	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,570	152.000	238,640.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	19.030	108,471.000	
	NOVARTIS AG-REG	69,200	81.770	5,658,484.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	100	1,928.000	192,800.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	16,660	60.960	1,015,593.600	
	SWISSCOM AG-REG	830	508.200	421,806.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	110	92.500	10,175.000	
	GEBERIT AG-REG	1,190	478.100	568,939.000	
	GIVAUDAN-REG	300	3,488.000	1,046,400.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	340	794.400	270,096.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,810	210.400	380,824.000	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,500	56.400	310,200.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,440	468.600	1,143,384.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	39.340	59,796.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	17,290	42.820	740,357.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,040	367.400	382,096.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,670	147.800	246,826.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,330	95.350	222,165.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	7,995.000	271,830.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 41,237,026.900	

				(4,708,031,361)	
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	3,300	433.500	1,430,550.000	
	ERICSSON LM-B SHS	98,430	89.040	8,764,207.200	
	VOLVO AB-B SHS	47,850	147.700	7,067,445.000	
	SKF AB-B SHARES	12,200	180.550	2,202,710.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,650	160.300	1,065,995.000	
	SWEDISH MATCH AB	5,450	667.000	3,635,150.000	
	TELE2 AB-B SHS	15,600	126.900	1,979,640.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	52,400	86.000	4,506,400.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	50,150	93.000	4,663,950.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	29,250	128.180	3,749,265.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	25,900	156.550	4,054,645.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	20,700	116.500	2,411,550.000	
	SKANSKA AB-B SHS	11,550	197.400	2,279,970.000	
	SANDVIK AB	36,450	170.250	6,205,612.500	
	INVESTOR AB-B SHS	14,700	516.000	7,585,200.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	21,600	376.200	8,125,920.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,550	130.400	1,245,320.000	
	TELIA CO AB	91,500	33.400	3,056,100.000	
	ALFA LAVAL AB	10,050	208.000	2,090,400.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	12,600	339.800	4,281,480.000	
	ASSA ABLOY AB-B	33,750	197.100	6,652,125.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,200	454.600	1,000,120.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,200	177.000	920,400.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	10,400	215.700	2,243,280.000	
	LUNDIN ENERGY AB	6,350	237.400	1,507,490.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	19,600	294.800	5,778,080.000	
	BOLIDEN AB	9,300	215.600	2,005,080.000	
	EPIROC AB-A	20,650	112.200	2,316,930.000	
	EPIROC AB-B	11,600	111.500	1,293,400.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,450	73.640	843,178.000	
	NORDEA BANK ABP	104,100	69.770	7,263,057.000	
	EQT AB	8,100	169.900	1,376,190.000	
	EVOLUTION GAMING GROUP	4,400	591.000	2,600,400.000	
	KINNEVIK AB - B	7,300	248.000	1,810,400.000	
	HEXAGON AB-B SHS	9,300	539.200	5,014,560.000	

	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,700	224.900	1,281,930.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 124,308,129.700 (1,474,294,418)	
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	57,200	429.500	24,567,400.000	
	DANSKE BANK A/S	22,700	90.740	2,059,798.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	125	7,000.000	875,000.000	
	H LUNDBECK A/S	2,300	267.400	615,020.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	6,500	701.600	4,560,400.000	
	GN STORE NORD A/S	4,300	364.600	1,567,780.000	
	CARLSBERG AS-B	3,450	900.600	3,107,070.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,250	371.600	2,694,100.000	
	COLOPLAST-B	3,850	1,052.500	4,052,125.000	
	DSV PANALPINA A/S	6,810	739.600	5,036,676.000	
	DEMANT A/S	3,425	192.300	658,627.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	200	7,514.000	1,502,800.000	
	TRYG A/S	4,000	199.600	798,400.000	
	PANDORA A/S	3,150	357.900	1,127,385.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,450	616.800	2,127,960.000	
	GENMAB A/S	2,100	1,913.500	4,018,350.000	
	ORSTED A/S	6,100	777.600	4,743,360.000	
	AMBU A/S-B	5,600	221.700	1,241,520.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 65,353,771.500 (1,084,219,069)	
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	41,500	4.880	202,520.000	
	MERCURY NZ LTD	23,000	4.705	108,215.000	
	A2 MILK CO LTD	23,400	19.350	452,790.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	62,089	4.450	276,296.050	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	38,900	7.100	276,190.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	18,700	28.800	538,560.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	14,000	13.490	188,860.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 2,043,431.050	

				(144,061,889)	
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	27.130	1,131,321.000	
	DNB ASA	30,800	139.250	4,288,900.000	
	ORKLA ASA	24,450	86.060	2,104,167.000	
	TELENOR ASA	23,200	149.850	3,476,520.000	
	EQUINOR ASA	33,823	146.900	4,968,598.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,710	346.500	1,978,515.000	
	MOWI ASA	14,100	193.400	2,726,940.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	181.300	1,332,555.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,100	244.400	757,640.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 22,765,156.700 (265,897,030)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	31,670	62.700	1,985,709.000	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,500	24.270	157,755.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	63,950	8.318	531,936.100	
	COMMERZBANK AG	32,935	3.973	130,850.750	
	VOLKSWAGEN AG	1,010	152.200	153,722.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	5,920	141.640	838,508.800	
	SIEMENS AG-REG	24,550	104.640	2,568,912.000	
	E.ON SE	71,600	10.030	718,148.000	
	UNIPER SE	6,650	28.560	189,924.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	10,600	58.070	615,542.000	
	GEA GROUP AG	4,500	28.840	129,780.000	
	CONTINENTAL AG	3,590	91.640	328,987.600	
	BASF SE	29,170	55.400	1,616,018.000	
	ALLIANZ SE-REG	13,240	185.720	2,458,932.800	
	THYSSENKRUPP AG	11,450	6.864	78,592.800	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,800	84.920	492,536.000	
	RWE AG	19,000	31.190	592,610.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,650	10.305	68,528.250	
	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	46.600	54,988.000	
	BRENNTAG AG	4,700	48.650	228,655.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	13,550	44.050	596,877.500	

UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	38.000	126,160.000	
HOCHTIEF AG	710	86.750	61,592.500	
SAP SE	33,442	119.600	3,999,663.200	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,610	232.300	1,070,903.000	
ZALANDO SE	4,950	62.500	309,375.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	4,900	50.540	247,646.000	
KION GROUP AG	1,850	55.460	102,601.000	
WIRECARD AG	3,620	95.650	346,253.000	
COVESTRO AG	5,200	36.460	189,592.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,150	316.200	363,630.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,000	52.040	260,200.000	
DELIVERY HERO SE	4,150	86.380	358,477.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	91.400	114,250.000	
METRO AG	5,000	9.016	45,080.000	
NEMETSCHEK SE	2,000	67.600	135,200.000	
SCOUT24 AG	3,600	70.450	253,620.000	
AROUNDTOWN SA	37,000	5.568	206,016.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,900	45.670	223,783.000	
KNORR-BREMSE AG	1,450	100.000	145,000.000	
TEAMVIEWER AG	4,450	46.165	205,434.250	
BEIERSDORF AG	3,290	99.500	327,355.000	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	1,950	37.160	72,462.000	
MERCK KGAA	4,250	103.100	438,175.000	
ADIDAS AG	6,170	254.800	1,572,116.000	
PUMA SE	2,710	69.460	188,236.600	
HENKEL AG & CO KGAA	3,400	75.650	257,210.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	105,950	15.005	1,589,779.750	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,920	76.900	532,148.000	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	29,000	37.000	1,073,000.000	
QIAGEN N.V.	7,298	39.070	285,132.860	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	40,500	20.650	836,325.000	
HANNOVER RUECK SE	1,850	161.900	299,515.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	31,500	30.690	966,735.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,060	153.750	931,725.000	
LANXESS AG	2,500	50.020	125,050.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,710	168.850	288,733.500	
DEUTSCHE WOHNEN SE	11,500	42.440	488,060.000	

SYMRISE AG	4,220	99.300	419,046.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.891	97,715.800	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,550	44.740	69,347.000	
VONOVIA SE	16,450	55.020	905,079.000	
LEG IMMOBILIEN AG	2,300	119.320	274,436.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	28,826	41.290	1,190,225.540	
NN GROUP NV	9,050	30.440	275,482.000	
ARCELORMITTAL	23,300	10.040	233,932.000	
HEINEKEN NV	8,200	86.000	705,200.000	
AEGON NV	58,244	2.843	165,587.690	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	35,033	23.190	812,415.270	
AKZO NOBEL N.V.	6,538	77.620	507,479.560	
KONINKLIJKE DSM NV	5,750	120.200	691,150.000	
WOLTERS KLUWER	8,900	68.840	612,676.000	
ING GROEP NV	126,250	6.563	828,578.750	
KONINKLIJKE KPN NV	114,650	2.337	267,937.050	
ASML HOLDING NV	13,620	310.300	4,226,286.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,050	8.304	108,367.200	
GALAPAGOS NV	1,390	173.900	241,721.000	
ADYEN NV	590	1,185.500	699,445.000	
UNILEVER NV	46,500	47.250	2,197,125.000	
JUST EAT TAKEAWAY	4,000	99.920	399,680.000	
PROSUS NV	15,500	75.100	1,164,050.000	
VOPAK	2,300	48.950	112,585.000	
RANDSTAD NV	3,700	42.050	155,585.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,750	78.500	294,375.000	
ALTICE EUROPE NV	20,500	3.856	79,048.000	
JCDECAUX SA	2,700	19.590	52,893.000	
TOTAL SA	79,650	36.115	2,876,559.750	
MICHELIN (CGDE)	5,450	97.040	528,868.000	
AIR LIQUIDE SA	15,277	125.350	1,914,971.950	
KERING	2,400	507.400	1,217,760.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	17,900	94.340	1,688,686.000	
BOUYGUES SA	7,400	29.650	219,410.000	
BNP PARIBAS	35,450	36.020	1,276,909.000	
PEUGEOT SA	19,150	14.200	271,930.000	

NATIXIS	29,550	2.327	68,762.850	
THALES SA	3,500	75.420	263,970.000	
DANONE	19,500	62.660	1,221,870.000	
CARREFOUR SA	19,800	14.530	287,694.000	
SUEZ	9,925	10.960	108,778.000	
VIVENDI	26,891	22.480	604,509.680	
L'OREAL	8,070	266.500	2,150,655.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	16,850	31.300	527,405.000	
LEGRAND SA	8,517	63.420	540,148.140	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	34.830	53,986.500	
PERNOD RICARD SA	6,737	147.050	990,675.850	
EURAZEO SE	1,254	48.380	60,668.520	
SOCIETE GENERALE SA	25,750	15.266	393,099.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	8,900	390.050	3,471,445.000	
ACCOR SA	6,150	27.200	167,280.000	
CAPGEMINI SE	5,120	93.200	477,184.000	
VALEO SA	7,150	23.220	166,023.000	
PUBLICIS GROUPE	7,050	30.510	215,095.500	
BUREAU VERITAS SA	9,700	19.325	187,452.500	
EIFFAGE	2,740	87.740	240,407.600	
SODEXO SA	2,700	66.300	179,010.000	
IPSEN	1,150	71.000	81,650.000	
INGENICO GROUP	1,970	133.800	263,586.000	
ORPEA	1,800	105.900	190,620.000	
AMUNDI SA	1,950	70.850	138,157.500	
TELEPERFORMANCE	1,920	229.400	440,448.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,750	68.340	187,935.000	
FAURECIA	2,250	37.260	83,835.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	370	605.000	223,850.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	900	230.600	207,540.000	
SEB SA	650	125.400	81,510.000	
ESSILORLUXOTTICA	9,000	120.750	1,086,750.000	
DASSAULT AVIATION SA	80	870.000	69,600.000	
WORLDLINE SA	4,514	71.820	324,195.480	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,000	31.400	94,200.000	
AXA SA	62,550	19.158	1,198,332.900	
EDENRED	7,950	41.070	326,506.500	
RENAULT SA	5,800	23.610	136,938.000	

HERMES INTERNATIONAL	1,020	774.000	789,480.000	
STMICROELECTRONICS NV	21,750	24.300	528,525.000	
REMY COINTREAU	630	124.400	78,372.000	
ATOS SE	2,960	69.880	206,844.800	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,180	152.250	636,405.000	
WENDEL	780	91.300	71,214.000	
ORANGE	63,300	11.315	716,239.500	
ALSTOM	6,300	43.000	270,900.000	
CNP ASSURANCES	4,850	11.190	54,271.500	
SANOFI	36,175	88.850	3,214,148.750	
VINCI SA	16,650	88.440	1,472,526.000	
AIRBUS SE	18,950	71.980	1,364,021.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	17,500	21.390	374,325.000	
CREDIT AGRICOLE SA	37,600	8.554	321,630.400	
BIOMERIEUX	1,340	119.500	160,130.000	
ENGIE	58,023	11.360	659,141.280	
EDF	18,550	8.500	157,675.000	
SES	11,000	7.300	80,300.000	
SAFRAN SA	10,420	98.600	1,027,412.000	
ILIAD SA	740	165.000	122,100.000	
ARKEMA	2,220	86.580	192,207.600	
ADP	910	103.400	94,094.000	
SCOR SE	4,950	26.480	131,076.000	
GETLINK SE	14,200	14.280	202,776.000	
BOLLORE	24,100	2.898	69,841.800	
UCB SA	4,130	89.500	369,635.000	
KBC GROUP NV	7,700	51.860	399,322.000	
COLRUYT SA	1,600	53.120	84,992.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,450	77.060	188,797.000	
SOLVAY SA	2,200	76.220	167,684.000	
UMICORE	6,350	42.460	269,621.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	24,400	48.765	1,189,866.000	
AGEAS	5,790	35.100	203,229.000	
PROXIMUS	4,950	20.220	100,089.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	39.040	56,608.000	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	104.000	109,200.000	
SOFINA	550	247.000	135,850.000	
PRYSMIAN SPA	7,850	19.450	152,682.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	35,743	14.005	500,580.710	

MEDIOBANCA SPA	18,865	6.792	128,131.080	
TENARIS SA	13,300	6.458	85,891.400	
UNICREDIT SPA	69,656	8.515	593,120.840	
TELECOM ITALIA SPA	262,982	0.350	92,175.190	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.361	62,091.140	
INTESA SANPAOLO	478,237	1.693	810,037.830	
ATLANTIA SPA	15,457	15.630	241,592.910	
POSTE ITALIANE SPA	16,000	8.568	137,088.000	
MONCLER SPA	6,300	34.580	217,854.000	
RECORDATI SPA	3,050	41.680	127,124.000	
ENI SPA	81,300	8.964	728,773.200	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	18,700	7.400	138,380.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	4.207	46,277.000	
DIASORIN SPA	850	174.200	148,070.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	8,300	9.135	75,820.500	
NEXI SPA	10,900	14.960	163,064.000	
LEONARDO SPA	13,175	6.680	88,009.000	
ENEL SPA	258,734	7.485	1,936,623.990	
SNAM SPA	66,600	4.502	299,833.200	
TERNA SPA	46,300	6.370	294,931.000	
EXOR NV	3,230	52.540	169,704.200	
CNH INDUSTRIAL NV	32,800	6.260	205,328.000	
FINECOBANK SPA	19,700	11.025	217,192.500	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	34,100	8.703	296,772.300	
FERRARI NV	4,145	155.200	643,304.000	
TELEFONICA SA	149,227	4.643	692,860.960	
ENDESA SA	9,250	22.440	207,570.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	213,012	3.212	684,194.540	
IBERDROLA SA	194,934	9.958	1,941,152.770	
BANKINTER SA	18,300	4.210	77,043.000	
REPSOL SA	43,400	9.046	392,596.400	
GRIFOLS SA	9,200	27.170	249,964.000	
BANCO SANTANDER SA	527,750	2.269	1,197,728.620	
AMADEUS IT GROUP SA	14,050	49.730	698,706.500	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	17.055	160,317.000	
MAPFRE SA	30,650	1.808	55,415.200	

	CAIXABANK SA	109,300	1.906	208,325.800	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	25.380	199,892.880	
	AENA SME SA	2,250	137.200	308,700.000	
	CELLNEX TELECOM SA	8,000	49.740	397,920.000	
	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	34,700	26.270	911,569.000	
	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	6,650	15.230	101,279.500	
	ENAGAS SA	7,950	22.170	176,251.500	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	13,900	16.745	232,755.500	
	FERROVIAL SA	16,270	25.650	417,325.500	
	UPM-KYMMENE OYJ	16,900	26.860	453,934.000	
	NOKIA OYJ	181,400	3.809	691,043.300	
	WARTSILA OYJ ABP	12,000	7.694	92,328.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	18,850	11.400	214,890.000	
	METSO OYJ	3,450	31.140	107,433.000	
	ELISA OYJ	4,600	55.360	254,656.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	15,300	32.570	498,321.000	
	FORTUM OYJ	13,850	17.690	245,006.500	
	KONE OYJ-B	10,950	61.500	673,425.000	
	NESTE OYJ	13,900	35.930	499,427.000	
	ORION OYJ-CLASS B	3,200	44.650	142,880.000	
	VERBUND AG	2,000	41.480	82,960.000	
	OMV AG	4,450	32.140	143,023.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	9,450	22.920	216,594.000	
	VOESTALPINE AG	4,250	19.895	84,553.750	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	4,400	17.660	77,704.000	
	ANDRITZ AG	2,100	34.920	73,332.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,800	29.060	197,608.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	5,000	57.500	287,500.000	
	JERONIMO MARTINS	7,700	15.725	121,082.500	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	82,700	4.386	362,722.200	
	GALP ENERGIA SGPS SA	15,050	11.650	175,332.500	
	KERRY GROUP PLC-A	5,150	109.000	561,350.000	
	CRH PLC	25,350	31.760	805,116.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,643	126.050	333,150.150	
ユーロ　小計				ユーロ 120,446,008.530	

				(14,893,148,954)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	44,500	43.800	1,949,100.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	73,000	56.000	4,088,000.000	
	MTR CORP	49,500	39.550	1,957,725.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	50,500	95.850	4,840,425.000	
	SINO LAND CO	104,000	9.630	1,001,520.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	86,169	51.300	4,420,469.700	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	15,500	43.600	675,800.000	
	CLP HOLDINGS LTD	52,500	77.800	4,084,500.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	48,507	29.850	1,447,933.950	
	HONG KONG & CHINA GAS	323,199	13.380	4,324,402.620	
	HANG SENG BANK LTD	24,500	124.300	3,045,350.000	
	WHEELOCK & CO LTD	27,000	56.150	1,516,050.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	198,000	8.450	1,673,100.000	
	WH GROUP LTD	321,000	6.800	2,182,800.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	38,300	292.000	11,183,600.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	66,000	17.060	1,125,960.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	9,300	74.000	688,200.000	
	NWS HOLDINGS LTD	42,500	6.690	284,325.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	17,500	20.650	361,375.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	45,240	17.440	788,985.600	
	SJM HOLDINGS LTD	58,000	9.310	539,980.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	38,200	18.460	705,172.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	86,669	43.850	3,800,435.650	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20,000	41.050	821,000.000	
	PCCW LTD	117,000	4.520	528,840.000	
	AIA GROUP LTD	389,400	71.000	27,647,400.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	41,000	31.300	1,283,300.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	53,900	25.500	1,374,450.000	
	SANDS CHINA LTD	77,600	32.300	2,506,480.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	44,000	71.250	3,135,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	125,500	23.700	2,974,350.000	
	WYNN MACAU LTD	54,000	14.200	766,800.000	

香港・ドル　小計			香港・ドル 97,722,829.520 (1,375,937,440)	
合計			131,681,035,925 [131,681,035,925]	

(2)　株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,417	701,728.790	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	9,987	766,302.510	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,000	484,950.000	
		VORNADO REALTY TRUST	5,397	222,950.070	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,550	1,067,094.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	11,850	730,671.000	
		EQUINIX INC	2,748	1,827,914.640	
		AMERICAN TOWER CORP	14,100	3,662,052.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	23,843	311,389.580	
		INVITATION HOMES INC	17,700	490,821.000	
		VICI PROPERTIES INC	14,400	320,112.000	
		VENTAS INC	12,200	502,396.000	
		WEYERHAEUSER CO	24,114	537,501.060	
		AGNC INVESTMENT CORP	18,300	254,187.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	13,350	2,238,127.500	
		IRON MOUNTAIN INC	8,910	258,924.600	
		VEREIT INC	33,500	215,070.000	
		SUN COMMUNITIES INC	2,900	402,665.000	
		PROLOGIS INC	23,702	2,212,581.700	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,970	599,986.100	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,200	305,984.000	
		DUKE REALTY CORP	11,450	413,917.500	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,050	513,484.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,360	223,680.800	
		WELLTOWER INC	12,900	757,359.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	16,450	456,981.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,550	421,633.500	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,400	342,954.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	47,900	319,972.000	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5,350	202,497.500	

	REALTY INCOME CORP	10,900	655,199.000	
	PUBLIC STORAGE	4,940	991,161.600	
	REGENCY CENTERS CORP	5,300	263,993.000	
	UDR INC	9,150	354,471.000	
	WP CAREY INC	5,400	359,910.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,900	229,425.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,300	1,136,768.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,000	405,840.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	16,050	311,691.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 26,474,346.950 (2,888,086,508)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,662	145,481.990	
	SEGRO PLC	35,250	312,033.000	
	BRITISH LAND CO PLC	25,550	115,409.350	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 572,924.340 (78,736,992)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	21,500	280,790.000	
	TRANSURBAN GROUP	86,300	1,284,144.000	
	SYDNEY AIRPORT	33,300	203,130.000	
	APA GROUP	38,100	441,579.000	
	SCENTRE GROUP	159,922	396,606.560	
	DEXUS	33,150	317,245.500	
	GPT GROUP	63,160	262,745.600	
	MIRVAC GROUP	126,100	312,728.000	
	STOCKLAND	72,000	276,480.000	
	GOODMAN GROUP	52,900	805,667.000	
	VICINITY CENTRES	99,273	166,282.270	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 4,747,397.930 (359,188,127)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,800	69,504.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,100	46,620.000	

		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,400	114,672.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	75,905.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 306,701.000 (24,769,172)	
	シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	79,600	142,484.000	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101,000	319,160.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	77,200	161,348.000	
		SUNTEC REIT	63,000	98,910.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	69,800	135,412.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	65,500	136,240.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 993,554.000 (77,566,761)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,200	267,540.000	
		ICADE	950	66,072.500	
		GECINA SA	1,400	172,760.000	
		KLEPIERRE	6,250	132,375.000	
		COVIVIO	1,500	98,025.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 736,772.500 (91,101,920)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	67,000	4,361,700.000	
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	75,000	592,500.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	122,000	1,415,200.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 6,369,400.000 (89,681,152)	
投資証券　合計				3,609,130,632 [3,609,130,632]	
合計				3,609,130,632 [3,609,130,632]	

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 589銘柄 投資証券 39銘柄	97.0%	3.0%	70.9%
イギリス・ポンド	株式 85銘柄 投資証券 3銘柄	98.8%	1.2%	5.0%
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 53銘柄 投資証券 11銘柄	88.5%	11.5%	2.3%
カナダ・ドル	株式 81銘柄 投資証券 4銘柄	99.5%	0.5%	3.4%
シンガポール・ドル	株式 16銘柄 投資証券 6銘柄	85.7%	14.3%	0.4%
スイス・フラン	株式 40銘柄	100%	-%	3.5%
スウェーデン・クローナ	株式 36銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	100%	-%	0.8%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 241銘柄 投資証券 5銘柄	99.4%	0.6%	11.1%
香港・ドル	株式 32銘柄 投資証券 3銘柄	93.9%	6.1%	1.1%

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。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	3,379,392,000	812,943,865
コール・ローン	861,317,816	1,430,530,889
国債証券	171,499,593,659	193,703,890,662
派生商品評価勘定	215,093	40,228,465
未収入金	22,800	1,151,268
未収利息	1,160,393,657	1,123,515,415
前払費用	31,260,275	62,119,399
流動資産合計	176,932,195,300	197,174,379,963
資産合計	176,932,195,300	197,174,379,963
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,287,893	－
未払金	3,193,588,037	225,601,881
未払解約金	102,175,032	97,730,682
その他未払費用	2,684	5,752
流動負債合計	3,300,053,646	323,338,315
負債合計	3,300,053,646	323,338,315
純資産の部		
元本等		
元本　※1	62,672,577,238	65,630,254,690
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	110,959,564,416	131,220,786,958
元本等合計	173,632,141,654	196,851,041,648
純資産合計	173,632,141,654	196,851,041,648
負債純資産合計	176,932,195,300	197,174,379,963

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年6月6日 至　2020年6月5日

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
1．※1　期首	2018年6月6日	2019年6月6日
期首元本額	60,553,811,990円	62,672,577,238円
期中追加設定元本額	5,973,602,493円	10,676,817,746円
期中一部解約元本額	3,854,837,245円	7,719,140,294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	654,072,209円	622,267,469円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	22,454,828円	17,542,061円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	152,368,413円	106,646,210円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	41,724,252円	31,704,023円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	484,204,601円	355,714,969円
外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	10,650,859円	60,771,118円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	388,141,958円	458,724,525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）	1,241,090,560円	1,662,091,109円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	771,389,181円	634,121,149円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	2,265,454円	1,076,866円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	61,299円	899,682円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	555,040,636円	638,965,164円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	597,179,355円	816,339,611円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	8,700,775円	31,795,513円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	43,717,317,336円	46,840,325,430円
ダイワ・ライフ・バランス３０	759,335,471円	762,953,937円
ダイワ・ライフ・バランス５０	377,147,861円	407,450,283円

ダイワ・ライフ・バランス７０	231,100,757円	244,898,386円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	360,169,154円	392,918,790円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	284,742,207円	314,110,022円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	92,710,863円	98,246,948円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	10,216,687円	9,276,813円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	18,537,253円	20,253,456円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	2,100,634円	4,155,725円
ダイワつみたてインデックス外国債券	26,939,221円	122,118,491円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	－円	2,998,751円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	－円	818,378円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	－円	824,291円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	218,084,512円	189,344,850円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	154,401,436円	139,026,561円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	5,263,427,071円	4,342,555,265円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	815,488円	－円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	1,574,412円	－円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	314,888,512円	265,380,470円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	147,900,420円	145,424,954円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	30,674,106円	30,509,234円

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	364,363円	18,798,389円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,618,281,887円	5,734,659,693円
ダイワライフスタイル２５	34,633,899円	32,333,560円
ダイワライフスタイル５０	60,827,287円	57,394,936円
ダイワライフスタイル７５	17,042,021円	14,817,608円
計	62,672,577,238円	65,630,254,690円
2. 期末日における受益権の総数	62,672,577,238口	65,630,254,690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 2019年6月6日 至 2020年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2020年6月5日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	7,664,306,011	4,546,616,505
合計	7,664,306,011	4,546,616,505

（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2019年6月5日まで、及び2019年12月3日から2020年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2019年6月5日 現在			2020年6月5日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	716,511,480	－	712,438,680	△4,072,800	1,273,473,895	－	1,313,702,360	40,228,465
アメリカ・ドル	312,939,239	－	309,399,840	△3,539,399	78,272,860	－	79,155,780	882,920
イギリス・ポンド	47,583,745	－	47,742,120	158,375	69,482,595	－	72,124,500	2,641,905
オーストラリア・ドル	3,850,994	－	3,850,500	△494	17,464,339	－	18,531,800	1,067,461
カナダ・ドル	51,595,479	－	51,509,790	△85,689	31,501,334	－	32,610,880	1,109,546
シンガポール・ドル	23,732,703	－	23,712,000	△20,703	20,422,136	－	20,909,360	487,224
スウェーデン・クローナ	2,156,276	－	2,154,480	△1,796	24,137,565	－	25,344,820	1,207,255
デンマーク・クローネ	7,784,257	－	7,770,330	△13,927	－	－	－	－
ノルウェー・クローネ	12,093,167	－	12,072,240	△20,927	10,795,217	－	11,471,610	676,393
ポーランド・ズロチ	23,728,799	－	23,779,170	50,371	－	－	－	－
メキシコ・ペソ	20,124,048	－	19,716,060	△407,988	59,912,376	－	61,756,960	1,844,584
ユーロ	202,844,120	－	202,647,150	△196,970	961,485,473	－	991,796,650	30,311,177
南アフリカ・ランド	8,078,653	－	8,085,000	6,347	－	－	－	－
合計	716,511,480	－	712,438,680	△4,072,800	1,273,473,895	－	1,313,702,360	40,228,465

（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）

	2019年6月5日現在	2020年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.7705円 (27,705円)	2.9994円 (29,994円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,592,282.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,208,913.410	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,324,363.120	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,532,843.770	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,622,163.590	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,895,378.800	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,556,277.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,892,498.650	

		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,893,470.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,446,178.280	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,699,191.680	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,332,565.440	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,556,721.300	
		8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,342,988.180	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	778,515.060	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,119,442.950	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	992,926.140	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	968,345.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	1,013,074.740	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	653,955.610	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	1,088,850.000	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	891,000.000	1,308,789.900	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	676,000.000	1,010,775.480	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,356,682.250	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	829,787.080	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	797,189.190	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,442,941.460	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,685,345.030	

		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,641,176.800	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,848,456.500	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,591,850.900	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,575,595.760	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	591,000.000	854,083.650	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,225,417.480	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	2,017,171.860	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	2,103,164.700	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	2,161,360.920	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,896,208.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	2,125,870.320	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,737,536.130	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,755,441.170	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	2,011,126.600	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,434,702.960	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	1,898,000.000	2,390,872.640	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,529,715.180	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,990,459.430	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,707,000.000	5,237,286.670	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,536,663.930	

		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,901,307.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,679,977.720	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,534,667.420	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,329,856.180	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,716,168.750	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,216,728.920	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,410,844.330	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	4,958,917.020	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,957,803.680	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,266,034.780	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,527,000.000	2,580,875.640	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	6,170,566.350	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	3,038,744.060	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,809,000.000	3,911,957.270	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,972,063.640	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,270,024.640	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,663,103.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,689,132.360	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	1,326,000.000	1,370,222.100	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,933,388.640	

		2% United States Treasury Note/Bond 20220731	4,179,000.000	4,340,601.930	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	6,199,281.350	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,873,000.000	4,908,407.820	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,535,342.750	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,559,657.120	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,397,486.400	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	709,000.000	918,984.530	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,659,296.800	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,564,005.220	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,234,161.920	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,366,000.000	4,640,228.460	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,664,233.910	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,648,000.000	4,337,107.200	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,064,485.200	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,752,051.260	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	3,729,000.000	3,967,283.100	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,152,468.800	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	4,072,822.320	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,602,525.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,524,800.000	

		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,103,350.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,709,636.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,954,672.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,742,772.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,740,293.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,866,875.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,485,296.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,596,382.400	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	3,078,808.200	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,773,237.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	3,043,350.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,614,450.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,500,000.000	4,471,775.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,649,111.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	3,400,000.000	3,478,336.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211231	4,000,000.000	4,114,040.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,674,600.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	6,140,000.000	6,801,462.200	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,092,775.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,655,534.400	

		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,637,285.400	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,097,229.800	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,455,066.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,863,495.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,987,899.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	7,160,960.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	4,579,505.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,095,370.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,196,860.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,091,620.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	3,800,000.000	4,052,624.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,095,610.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,562,360.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,567,880.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	3,003,965.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,221,700.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,450,000.000	4,322,470.500	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,300,480.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,128,900.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,596,075.000	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,688,850.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,606,425.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	6,136,790.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	4,389,735.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,788,995.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,448,480.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	3,037,552.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,697,960.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	5,650,000.000	6,530,157.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,514,995.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,853,084.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,998,053.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	4,990,730.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,083,947.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,208,560.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,646,354.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,597,330.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,680,850.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,127,392.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,978,769.000	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,685,350.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	3,000,000.000	3,074,880.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,680,650.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,350,370.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,388,671.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,150,762.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,855,750.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,560,483.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,576,050.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,809,750.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,887,136.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	4,027,752.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,613,330.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,833,000.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,257,100.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,108,150.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,836,900.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,350,600.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,154,200.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	4,900,000.000	5,864,271.000	

		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	6,370,352.400	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,388,350.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,179,360.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,903,572.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,910,410.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,706,050.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,110,730.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,649,268.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,116,580.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,318,720.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,796,475.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	6,211,708.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,781,250.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,553,671.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,634,645.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,746,875.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,840,600.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,526,548.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	6,017,751.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,446,897.000	

		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,760,575.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	3,100,552.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,609,760.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,280,050.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,700,130.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,700,000.000	2,741,445.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	3,021,592.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,130,440.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20210731	4,700,000.000	4,785,164.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,500,000.000	3,702,860.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,699,000.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	7,426,608.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,598,840.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	5,277,764.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,100,000.000	3,150,251.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,937,788.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,151,840.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	3,087,990.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20210930	5,100,000.000	5,187,822.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,663,075.000	

		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,146,940.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,978,271.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,049,760.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,550,000.000	2,596,308.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,196,380.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	6,450,000.000	7,019,857.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	5,303,295.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20211130	1,500,000.000	1,528,875.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,131,400.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,150,930.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,105,810.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,685,525.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,655,650.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20211231	1,500,000.000	1,533,570.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,131,400.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	4,700,000.000	4,913,662.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,500,000.000	2,548,325.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,319,165.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	3,600,000.000	3,834,252.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,385,728.000	

		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,000,000.000	4,366,560.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20220228	200,000.000	203,210.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	310,125.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	200,000.000	206,984.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	200,000.000	201,428.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	200,000.000	200,968.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20220331	200,000.000	200,648.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	200,000.000	200,054.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	300,000.000	300,000.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	3,400,000.000	3,337,814.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	500,000.000	498,140.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,000,000.000	1,997,180.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220430	500,000.000	499,355.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	1,000,000.000	991,090.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	2,000,000.000	1,823,900.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 806,784,423.600 (88,012,112,770)	
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	921,000.000	1,017,060.300	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,905,655.000	

		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,594,066.500	
		0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,344,476.000	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,790,000.000	2,124,193.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	2,750,000.000	3,248,300.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,510,000.000	2,047,107.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,510,000.000	1,629,108.800	
		0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,044,940.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,500,000.000	2,801,625.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,060,000.000	1,553,324.000	
		1% United Kingdom Gilt 20240422	2,600,000.000	2,697,838.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	930,000.000	1,171,986.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,088,510.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	2,100,000.000	2,221,611.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	2,600,000.000	2,672,306.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	90,000.000	99,477.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20230131	500,000.000	500,890.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	500,000.000	501,550.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	50,000.000	47,605.000	
		8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,189,851.440	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,410,707.480	

		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,940,186.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,816,477.440	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,912,000.000	2,969,144.800	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,257,000.000	2,159,903.100	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,608,000.000	3,408,960.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,666,000.000	3,066,939.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,607,686.080	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,816,000.000	3,242,649.600	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,830,000.000	2,669,055.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,590,781.300	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,382,718.800	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,478,726.180	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,260,000.000	1,949,850.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,574,000.000	3,414,793.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,647,152.200	
		3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	840,154.810	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,907,982.400	
		1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,329,639.780	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,338,672.400	
		2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,696,346.960	

	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,586,000.000	3,471,278.200	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,218,355.320	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,274,000.000	3,680,014.200	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 93,739,654.490 (12,882,640,716)	
イスラエル・シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,500,000.000	2,041,455.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20220131	2,000,000.000	2,180,120.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	2,005,308.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,299,844.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	1,500,000.000	1,696,890.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	1,900,000.000	2,030,188.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,969,704.000	
	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,027,720.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,500,000.000	2,141,040.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,500,000.000	1,687,695.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,564,920.000	
	0.75% Israel Government Bond - Fixed 20220731	1,000,000.000	1,013,830.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	800,000.000	815,952.000	
イスラエル・シュケル　小計			イスラエル・シュケル 23,474,666.000 (741,095,206)	

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 20220715	2,162,000.000	2,408,943.640	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	3,568,000.000	4,099,560.640	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,789,000.000	3,549,197.730	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,702,222.370	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,504,000.000	2,993,557.040	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,498,000.000	2,838,402.460	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,757,954.360	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,948,000.000	3,579,844.840	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,480,612.770	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,007,000.000	1,194,886.060	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	995,868.720	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,052,412.640	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,678,000.000	2,965,349.400	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,152,000.000	1,424,620.800	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	800,000.000	820,936.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,300,000.000	2,644,609.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,550,000.000	1,624,586.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,600,000.000	3,011,528.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,470,000.000	2,813,601.700	

	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	990,000.000	1,158,765.300	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,958,229.200	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	500,000.000	506,335.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,385,240.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,200,000.000	2,182,224.000	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 55,149,487.670 (4,172,610,237)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	405,000.000	611,371.800	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	586,000.000	883,875.520	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,420,867.520	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,786,094.170	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,629,987.920	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	2,083,018.380	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	984,813.840	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,836,011.050	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,461,000.000	2,182,529.460	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,297,343.670	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,521,334.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,815,726.220	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,257,427.440	

	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	1,026,781.470	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,480,000.000	2,495,996.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,278,440.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,445,616.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,777,265.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,330,548.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	2,100,000.000	2,182,509.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,000,000.000	1,053,610.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,390,000.000	1,657,394.300	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,392,007.800	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,283,160.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,463,490.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210801	400,000.000	405,896.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,350,000.000	1,424,074.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20211101	800,000.000	811,264.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	1,600,000.000	1,659,984.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	1,100,000.000	1,122,308.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220501	5,000.000	5,114.700	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	1,500,000.000	1,502,505.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,500,000.000	1,497,600.000	

カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 46,125,964.760 (3,725,132,914)	
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	911,268.800	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	465,361.860	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	687,760.850	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	425,612.450	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	504,726.750	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	509,768.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	719,540.140	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	727,977.200	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	730,068.750	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	571,149.520	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	898,803.200	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	272,000.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	465,938.600	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	513,140.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	500,000.000	574,520.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	466,627.500	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	625,322.500	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	518,037.800	

	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	150,000.000	177,019.500	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	200,000.000	227,230.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 10,991,873.420 (858,135,557)	
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	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,255,000.000	6,581,506.350	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,097,674.100	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,507,864.250	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,595,000.000	6,346,072.800	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	6,090,607.200	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,836,513.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	4,700,000.000	5,011,422.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 46,471,660.200 (551,153,890)	
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	12,662,000.000	23,271,363.180	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	7,933,162.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,177,854.080	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,722,594.130	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,364,678.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	7,590,000.000	8,069,991.600	

	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	800,000.000	814,568.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 60,354,211.490 (1,001,276,369)	
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	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	8,204,000.000	8,630,525.960	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,511,830.050	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,621,684.150	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,545,410.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,741,490.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,888,640.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,250,000.000	3,577,502.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,000,000.000	4,272,360.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 35,789,443.160 (418,020,697)	
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	2,599,079.670	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,761,300.600	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,106,009.530	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,465,665.900	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,410,062.400	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,850,000.000	3,008,944.500	

		2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	3,082,236.500	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	3,340,000.000	3,767,186.000	
		2.25% Poland Government Bond 20241025	2,400,000.000	2,562,960.000	
		Poland Government Bond 20220725	1,500,000.000	1,486,425.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,138,572.250	
		5.75% Poland Government Bond 20211025	1,684,000.000	1,814,038.480	
		4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,935,143.750	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	2,750,000.000	3,062,125.000	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,904,122.350	
ポーランド・ズロチ　小計				ポーランド・ズロチ 42,103,871.930 (1,174,276,988)	
	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	1,273,000.000	1,333,874.860	
		5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	866,766.240	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,327,476.420	
		4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	916,000.000	937,031.360	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,658,753.540	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,433,003.000	
		3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	897,207.500	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	784,311.830	
		4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	681,820.860	

		3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,032,571.540	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,514,246.780	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,261,441.460	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	709,464.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,129,615.900	
		4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	878,750.660	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,860,274.890	
		3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,202,691.510	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,346,343.200	
		3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,359,235.920	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,060,544.100	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	696,806.500	
		3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	359,789.760	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	1,600,000.000	1,648,048.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	799,965.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	951,516.800	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,223,166.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,273,440.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	800,000.000	832,104.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	801,927.000	

	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	710,904.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	694,928.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	2,060,011.400	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,000,000.000	1,183,780.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	416,568.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	800,000.000	853,760.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,000,000.000	1,038,140.000	
マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 38,820,280.030 (992,634,561)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	20,290,000.000	20,409,711.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	16,300,000.000	18,060,563.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	19,000,000.000	19,593,370.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	16,300,000.000	17,962,274.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	5,000,000.000	5,204,800.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	25,033,000.000	27,231,147.730	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	28,339,948.770	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	26,468,000.000	28,961,285.600	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,751,926.940	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	25,044,000.000	29,151,466.440	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	14,894,000.000	17,355,978.200	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	16,326,000.000	16,549,013.160	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	14,470,207.150	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	25,249,397.560	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	16,654,000.000	17,950,180.820	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	8,799,886.560	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 307,041,156.930 (1,529,064,962)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	

		0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	448,560.720	
		0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	297,930.150	
		0.5% Finland Government Bond 20260415	1,111,000.000	1,167,372.140	
		Finland Government Bond 20230915	200,000.000	203,470.000	
		1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	451,807.200	
		Finland Government Bond 20220415	770,000.000	778,054.200	
		0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	843,184.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	419,809.400	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	527,820.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	527,850.000	
		Finland Government Bond 20240915	200,000.000	204,088.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	305,929.700	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	948,488.310	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,203,288.640	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	634,000.000	805,661.840	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	334,915.200	
		Austria Government Bond 20230715	900,000.000	914,355.000	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	780,000.000	822,010.800	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	490,000.000	890,217.300	
		Austria Government Bond 20220920	400,000.000	405,056.000	

		0.75% Austria Government Bond 20280220	900,000.000	966,330.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,033,527.600	
		Austria Government Bond 20240715	800,000.000	815,904.000	
		Austria Government Bond 20300220	680,000.000	684,494.800	
		Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,014,670.000	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	752,507.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,480,407.810	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,074,000.000	1,177,179.180	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	938,957.340	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,380,174.420	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,501,221.880	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	945,760.000	
		0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	501,000.500	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,495,424.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,090,908.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	664,792.000	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	463,716.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,340,000.000	1,437,257.200	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	622,572.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,200,000.000	1,299,852.000	

		1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	745,650.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,226,771.000	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	633,309.600	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,210,716.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,215,678.620	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,751,351.910	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	1,995,643.260	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,350,814.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,560,847.770	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,587,863.280	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,405,000.000	2,389,862.850	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	5,997,530.210	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,407,710.500	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,439,000.000	2,815,058.140	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,874,000.000	4,902,785.340	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,743,019.020	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,464,765.550	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,807,000.000	1,882,622.950	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,331,944.560	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,508,000.000	3,955,391.880	

		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,722,780.480	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,491,300.600	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,931,471.000	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,734,019.560	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,698,664.590	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	4,314,636.660	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,727,911.940	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,647,179.820	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,307,824.720	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,310,801.900	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,512,116.480	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,501,312.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	6,200,000.000	6,521,346.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,465,807.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,750,000.000	2,275,980.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,042,082.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,400,000.000	4,647,632.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,324,938.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	1,900,000.000	1,963,555.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,050,000.000	993,520.500	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,050,000.000	1,083,442.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	700,000.000	708,904.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	500,000.000	516,985.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210611	100,000.000	100,595.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210910	500,000.000	503,635.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211210	800,000.000	807,432.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220311	300,000.000	303,231.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,411,046.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,173,177.600	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,130,681.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,831,650.200	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,940,508.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,965,043.200	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,744,455.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,467,824.000	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,503,779.750	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,072,164.250	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,979,415.810	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	4,944,112.780	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,393,306.160	

		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,514,000.000	2,985,471.740	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	3,868,195.600	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,765,384.580	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,764,000.000	6,715,540.600	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,287,000.000	2,663,111.880	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,859,607.180	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,366,049.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,871,721.700	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,699,000.000	4,512,299.130	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,873,608.980	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,133,553.600	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,573,524.960	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,424,040.440	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	4,387,000.000	5,478,441.730	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,899,000.000	4,286,833.530	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,653,330.400	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	3,101,000.000	3,333,668.030	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,420,000.000	5,110,492.400	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,287,000.000	3,448,556.050	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,969,000.000	3,376,792.150	

		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,087,000.000	1,458,754.000	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,892,736.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,041,120.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,170,000.000	2,675,610.000	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,688,932.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,300,000.000	3,040,462.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,434,536.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	3,400,000.000	3,642,250.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,483,329.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	3,150,000.000	3,377,745.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,463,444.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,412,446.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,500,000.000	2,997,350.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,250,000.000	5,515,125.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,130,000.000	3,193,319.900	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,300,000.000	2,303,312.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,433,192.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,370,000.000	1,352,601.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,052,860.000	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	664,559.600	

		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,647,996.320	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,485,000.000	2,455,640.550	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	880,984.160	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,779,000.000	3,144,791.670	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,524,446.000	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,524,351.900	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,546,992.640	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,485,080.100	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,579,000.000	2,621,503.170	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,673,197.100	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,339,735.250	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,638,000.000	1,729,990.080	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,210,944.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,294,500.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,428,378.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,247,186.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,250,616.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	600,000.000	643,842.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,100,000.000	1,116,665.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,424,384.220	

		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,536,351.000	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,281,226.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,954,476.160	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,784,135.970	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,663,534.800	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,742,536.040	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,777,796.250	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,003,495.590	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,545,224.640	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,742,358.100	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,382,238.900	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,852,724.960	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,679,875.740	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	1,324,000.000	1,389,604.200	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,083,603.480	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,562,012.500	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,362,440.660	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,038,993.120	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,628,805.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,619,233.400	

		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,363,362.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,272,600.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,263,937.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,700,000.000	1,806,216.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,724,905.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,652,512.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,477,398.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,223,543.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,931,977.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,339,234.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,738,185.500	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	1,400,000.000	1,492,526.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,680,835.500	
		2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	1,200,000.000	1,235,316.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,512,531.900	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,635,287.500	
		1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,550,000.000	1,576,148.500	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,169,553.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,297,548.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,600,000.000	1,704,032.000	

		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	850,000.000	984,079.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,891,374.000	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	735,641.400	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,100,000.000	1,080,277.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,317,805.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,200,000.000	1,225,104.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,419,840.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,013,100.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,410,676.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	1,500,000.000	1,433,280.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,688,762.680	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,107,032.930	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,629,325.450	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,197,299.320	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,513,365.000	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,848,308.540	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,977,147.320	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,558,374.050	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,532,090.180	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,985,538.050	

		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,479,446.000	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,410,674.850	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,180,062.360	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,850,918.710	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,203,608.400	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,064,580.100	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,119,423.880	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,613,000.000	2,345,140.700	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,510,901.360	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,479,536.550	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,838,000.000	3,370,891.260	
		2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,641,443.130	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,458,107.160	
		5% Belgium Government Bond 20350328	2,104,000.000	3,515,573.600	
		4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	948,887.690	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,732,285.680	
		4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,535,941.200	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,280,959.680	
		4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,461,918.080	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,129,323.000	

		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,449,937.080	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,431,970.380	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,690,145.100	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,024,689.780	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,309,668.990	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	698,611.680	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	692,835.870	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,169,796.470	
		0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	527,372.640	
		2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	1,007,201.030	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,145,395.310	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	650,171.500	
		IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	353,286.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	855,016.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	550,000.000	613,833.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	223,304.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	1,200,000.000	1,304,796.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	400,000.000	464,924.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	250,000.000	246,680.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	812,944.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,207,824.750	
		3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,405,695.060	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	2,098,616.880	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,141,148.750	
		3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	859,963.000	
		3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	957,482.160	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	745,246.060	

		3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,026,922.050	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,033,063.570	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,012,261.320	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,019,682.560	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	819,149.370	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	481,904.870	
		1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	327,665.520	
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	472,189.120	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	611,537.850	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	580,894.900	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,478,819.680	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,214,326.000	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,347,118.640	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,449,844.960	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,929,678.170	
		0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,770,671.850	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,652,000.000	2,245,266.240	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	950,000.000	1,526,080.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,030,000.000	2,187,345.300	
		0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,109,931.200	

		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,075,066.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,700,000.000	2,042,958.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,231,732.500	
		0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,629,712.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,900,000.000	2,064,787.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,720,433.000	
		0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	1,400,000.000	1,426,152.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,067,314.000	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,700,000.000	1,710,217.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,900,000.000	2,075,503.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,200,000.000	1,366,116.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,338,985.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	1,900,000.000	1,930,305.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,363,536.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,478,007.200	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	500,000.000	501,980.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,200,000.000	1,090,632.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,500,176.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,105,784.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,165,806.300	

		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,854,000.000	2,794,200.480	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,642,574.520	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,990,815.200	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	3,133,510.270	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,720,357.860	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,667,664.350	
		5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,181,338.400	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,253,423.040	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,202,403.550	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,475,221.100	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,363,647.410	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,277,221.500	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,363,612.580	
	ユーロ　小計			ユーロ 627,947,721.750 (77,645,735,795)	
国債証券　合計				193,703,890,662 [193,703,890,662]	
合計				193,703,890,662 [193,703,890,662]	

（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%	45.4%
イギリス・ポンド	国債証券	45銘柄	100%	6.7%
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	24銘柄	100%	2.2%
カナダ・ドル	国債証券	33銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券	20銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7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	15銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リンギット	国債証券	36銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	320銘柄	100%	40.1%

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。

２ 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	7,590,560,112円
Ⅱ	負債総額	12,157,824円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,578,402,288円
Ⅳ	発行済数量	3,852,549,392口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9671円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	167,520,023,701円
Ⅱ	負債総額	21,231,287,526円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	146,288,736,175円
Ⅳ	発行済数量	142,060,889,074口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0298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

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	21,631,476,063円
Ⅱ	負債総額	93,730,621円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,537,745,442円
Ⅳ	発行済数量	16,701,848,460口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2895円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	132,359,198,705円
Ⅱ	負債総額	152,248,171円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	132,206,950,534円
Ⅳ	発行済数量	51,053,723,244口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5896円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	198,419,722,878円
Ⅱ	負債総額	852,839,338円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	197,566,883,540円
Ⅳ	発行済数量	66,198,223,430口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9845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

2020年6月末日現在

資本金の額	151億7,427万2,500円
発行可能株式総数	799万9,980株
発行済株式総数	260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を決定します。

ロ．商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年6月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	51	85,644
追加型株式投資信託	697	16,490,066
株式投資信託　　合計	748	16,575,710
単位型公社債投資信託	28	93,923
追加型公社債投資信託	14	1,453,222
公社債投資信託　合計	42	1,547,145
総合計	790	18,122,855

3 【委託会社等の経理状況】

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当事業年度（2019年４月１日から2020年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

3．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （2019年３月31日）		当事業年度 （2020年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		28,489		2,741
有価証券		554		22,167
前払費用		214		205
未収委託者報酬		11,468		10,847
未収収益		98		63
その他		56		62
流動資産計		40,882		36,088
固定資産				
有形固定資産	※1	206	※1	217
建物		10		7
器具備品		195		209
無形固定資産		2,821		2,362
ソフトウェア		2,804		2,028
ソフトウェア仮勘定		17		333
投資その他の資産		12,799		15,844
投資有価証券		8,493		9,153
関係会社株式		1,836		3,972
出資金		183		183
長期差入保証金		1,070		1,069
繰延税金資産		1,183		1,431
その他		31		33
固定資産計		15,827		18,424

資産合計	56,709	54,512

（単位:百万円）

	前事業年度 （2019年３月31日）		当事業年度 （2020年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		75		69
未払金		8,548		7,573
未払収益分配金		15		14
未払償還金		40		39
未払手数料		4,610		3,988
その他未払金	※2	3,882	※2	3,530
未払費用		3,735		3,830
未払法人税等		726		656
未払消費税等		255		590
賞与引当金		725		688
その他		2		5
流動負債計		14,070		13,414
固定負債				
退職給付引当金		2,389		2,574
役員退職慰労引当金		103		88
その他		2		5
固定負債計		2,496		2,667
負債合計		16,567		16,082
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		13,052		11,749
利益剰余金合計		13,426		12,123
株主資本合計		40,096		38,793

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	46	△363
評価・換算差額等合計	46	△363
純資産合計	40,142	38,430
負債・純資産合計	56,709	54,512

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	76,052	69,550
その他営業収益	673	583
営業収益計	76,725	70,134
営業費用		
支払手数料	35,789	31,120
広告宣伝費	694	745
調査費	9,066	8,858
調査費	1,057	1,188
委託調査費	8,009	7,670
委託計算費	1,351	1,410
営業雑経費	1,557	1,770
通信費	228	240
印刷費	513	524
協会費	55	56
諸会費	13	13
その他営業雑経費	746	936
営業費用計	48,459	43,906
一般管理費		
給料	5,755	5,793
役員報酬	373	374
給料・手当	4,145	4,335
賞与	510	395
賞与引当金繰入額	725	688
福利厚生費	796	838
交際費	64	62
旅費交通費	178	154
租税公課	472	451
不動産賃借料	1,291	1,299

退職給付費用	374	368
役員退職慰労引当金繰入額	34	37
固定資産減価償却費	907	925
諸経費	1,819	1,770
一般管理費計	11,693	11,702
営業利益	16,572	14,525

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
営業外収益		
受取配当金	38	912
投資有価証券売却益	215	214
有価証券償還益	133	24
その他	134	78
営業外収益計	521	1,230
営業外費用		
有価証券償還損	32	71
投資有価証券売却損	40	1
その他	60	54
営業外費用計	132	127
経常利益	16,961	15,629
特別損失		
システム刷新関連費用	-	537
投資有価証券評価損	-	48
関係会社整理損失	29	-
特別損失計	29	585
税引前当期純利益	16,931	15,043
法人税、住民税及び事業税	5,076	4,555
法人税等調整額	△15	△78
法人税等合計	5,060	4,477
当期純利益	11,870	10,566

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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
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
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

当事業年度（自　2019年４月１日 至　2020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	13,052	13,426	40,096
当期変動額						

剰余金の配当	-	-	-	△11,868	△11,868	△11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,302	△1,302	△1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△410	△410	△410
当期変動額合計	△410	△410	△410
当期末残高	△363	△363	38,430

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
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　　８～18年

器具備品　　４～17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。

６．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和２年法律第８号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年３月31日）第３項の取扱いにより、「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　2018年２月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

（未適用の会計基準等）

１．収益認識に関する会計基準等

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018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 2018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
2022年３月期の期首より適用予定であります。

(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。

２．時価の算定に関する会計基準等
- **「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年７月４日）**
- **「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年７月４日）**
- **「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年７月４日）**

(1) 概要
国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- **「金融商品に関する会計基準」における金融商品**

(2) 適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

(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）
（損益計算書）
前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の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、「営業外収益」の「その他」に表示していた172百万円は、「受取配当金」38百万円、「その他」134百万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 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
建物	31百万円	34百万円
器具備品	264百万円	276百万円

※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 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
未払金	3,788百万円	3,397百万円

３　保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2020年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万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　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

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020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
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

（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

2020年６月23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	10,564百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ １株当たり配当額	4,050円
④ 基準日	2020年３月31日
⑤ 効力発生日	2020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、子会社株式並びに関連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、子会社株式及び関連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（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。

当事業年度（2020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	2,741	2,741	－
（２）未収委託者報酬	10,847	10,847	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
有価証券	21,900	21,900	－
その他有価証券	8,754	8,754	－
資産計	44,243	44,243	－
（１）未払手数料	(3,988)	(3,988)	－
（２）その他未払金	(3,530)	(3,530)	－
（３）未払費用（*2）	(2,889)	(2,889)	－
負債計	(10,408)	(10,408)	－

(*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 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
（１）その他有価証券		
非上場株式	666	666
（２）子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	1,836	3,972
（３）長期差入保証金	1,070	1,069

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（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

当事業年度（2020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	2,741	-	-	-
未収委託者報酬	10,847	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
有価証券	21,900	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	267	3,463	1,184	-
合計	35,756	3,463	1,184	-

（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（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。

当事業年度（2020年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,944百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）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（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	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	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。

当事業年度（2020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	60	55	5
（２）その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	△764
小計	27,589	28,354	△764
合計	30,654	31,181	△526

（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　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

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020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	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

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、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

（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　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,350百万円	2,389百万円
勤務費用	158	159
退職給付の支払額	△171	△183
その他	52	207
退職給付債務の期末残高	2,389	2,574

(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　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,389百万円	2,574百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574
退職給付引当金	2,389	2,574
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
勤務費用	158百万円	159百万円
その他	41	27
確定給付制度に係る退職給付費用	199	187

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174百万円、当事業年度181百万円であります。

（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 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	731	788
システム関連費用	170	198
賞与引当金	182	177
未払事業税	141	129
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	32	47
その他	240	399
繰延税金資産小計	1,592	1,835
評価性引当額	△164	△173
繰延税金資産合計	1,428	1,661
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	△85	△71
繰延税金負債合計	△244	△230
繰延税金資産の純額	1,183	1,431

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（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。

当事業年度（2020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　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020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　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。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020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）	1,603	－	－

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。

（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　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。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020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）	16,953	未払手数料	2,984
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）	1,031	未払費用	224
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）	1,061	長期差入保証金	1,054

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　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
１株当たり純資産額　15,389.06円	１株当たり純資産額　14,732.52円
１株当たり当期純利益　4,550.81円	１株当たり当期純利益　4,050.66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)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　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
当期純利益（百万円）	11,870	10,566
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

① 2020年2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

② 2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第２　【その他の関係法人の概況】

１　【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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（2020年3月末日現在）

③　事業の内容

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

(2) 販売会社

① 名　称	② 資本金の額 単位：百万円 （2020年3月 末日現在）	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	
岡三オンライン証券株式会社	2,500	
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める
きらぼしライフデザイン証券株式会社	3,000	第一種金融商品取引業を
第四北越証券株式会社	600	営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
楽天証券株式会社	7,495	
ワイエム証券株式会社	1,270	
株式会社北九州銀行	10,000	
株式会社きらぼし銀行	43,734	
株式会社高知銀行	19,544	
株式会社清水銀行	10,816	銀行法に基づき銀行業を
株式会社東北銀行	13,233	営んでいます。
株式会社富山銀行	6,730	
日本生命保険相互会社	1,400,000	（注1）
三井住友信託銀行株式会社	342,037	（注2）
株式会社宮崎太陽銀行	12,252	
株式会社武蔵野銀行	45,743	銀行法に基づき銀行業を
株式会社もみじ銀行	10,000	営んでいます。

株式会社山口銀行	10,005	
株式会社りそな銀行	279,928	（注2）

（注1）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注2）銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。
販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

＜再信託受託会社の概要＞
名称：株式会社日本カストディ銀行
資本金の額：51,000百万円（2020年7月27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。

(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

2020年５月22日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

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アセットマネジメント株式会社（旧社名 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。

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、大和アセットマネジメント株式会社（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2020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全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。**

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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7月10日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス７０の2019年6月6日から2020年6月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス７０の2020年6月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記は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。