【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】	2021年8月24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】	ダイワライフスタイル５０
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ダイワライフスタイル５０

(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、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2021年8月25日から2022年2月21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】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　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】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国　内	株　式	インデックス型
追加型投信	海　外	債　券	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※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

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	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
投資対象地域	国内	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、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、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
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を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
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＭＦ
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＲＦ
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第１号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	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
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信		目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの
	その他資産		目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの
	資産複合		目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
	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
	資産複合　資産配分変更型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
決算頻度	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
	年2回		目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
	年4回		目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
	年6回（隔月）		目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
	年12回（毎月）		目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
	日々		目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
	その他		上記属性にあてはまらないすべてのもの

投資対象地域	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
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東（中東）	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	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
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	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
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	ＴＯＰＩＸ	目論見書等において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

※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。

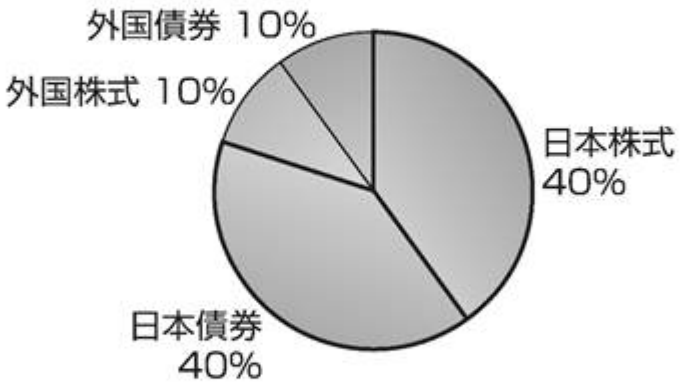
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜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	40%	10%	50%
債券	40%	10%	50%
合計	80%	20%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

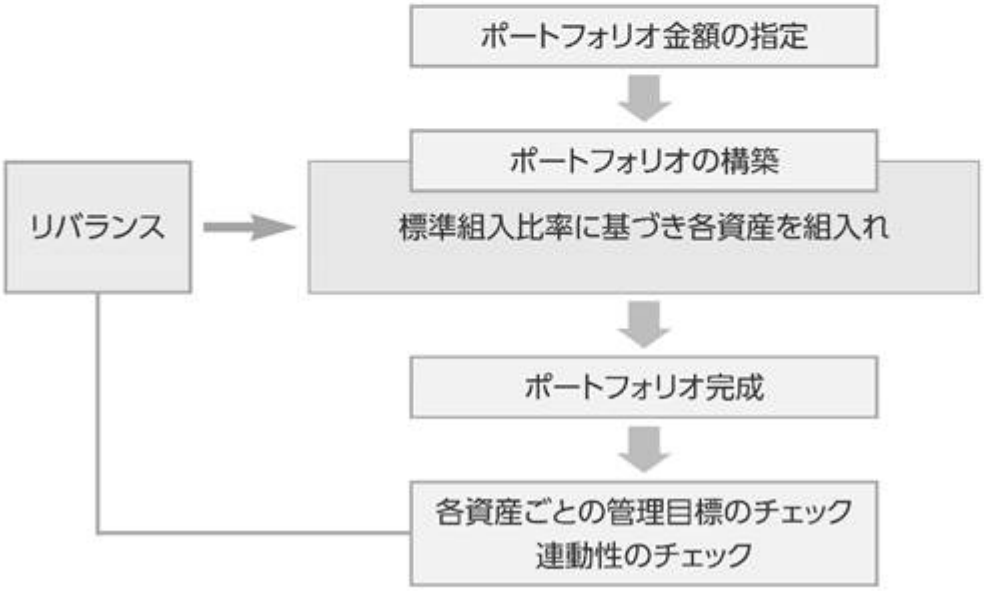
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

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

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

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

〈分配方針〉

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

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

各マザーファンドの運用プロセス

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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

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

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

2．日本債券インデックスマザーファンド

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

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

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数とは

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

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

3. 外国株式インデックスマザーファンド

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

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

ＭＳＣＩコクサイ指数とは

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

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

4. 外国債券インデックスマザーファンド

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

(2)【ファンドの沿革】

2000年 4月28日	信託契約締結、当初設定、運用開始
2000年12月 1日	ファンドの名称の変更（従来は「ライフスタイル５０」）

(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。）、 わが国の公社債、外国の株式(預託証書を含みます。)、 外国の公社債　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

＜委託会社の概況（2021年5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

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

②　投資態度

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

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

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の40%

日本債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の40%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の10%
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．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

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

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

(2)【投資対象】

①　委託会社は、信託金を、主として、大和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25．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

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

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

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

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

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

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

21．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

25．外国の者に対する権利で前24.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

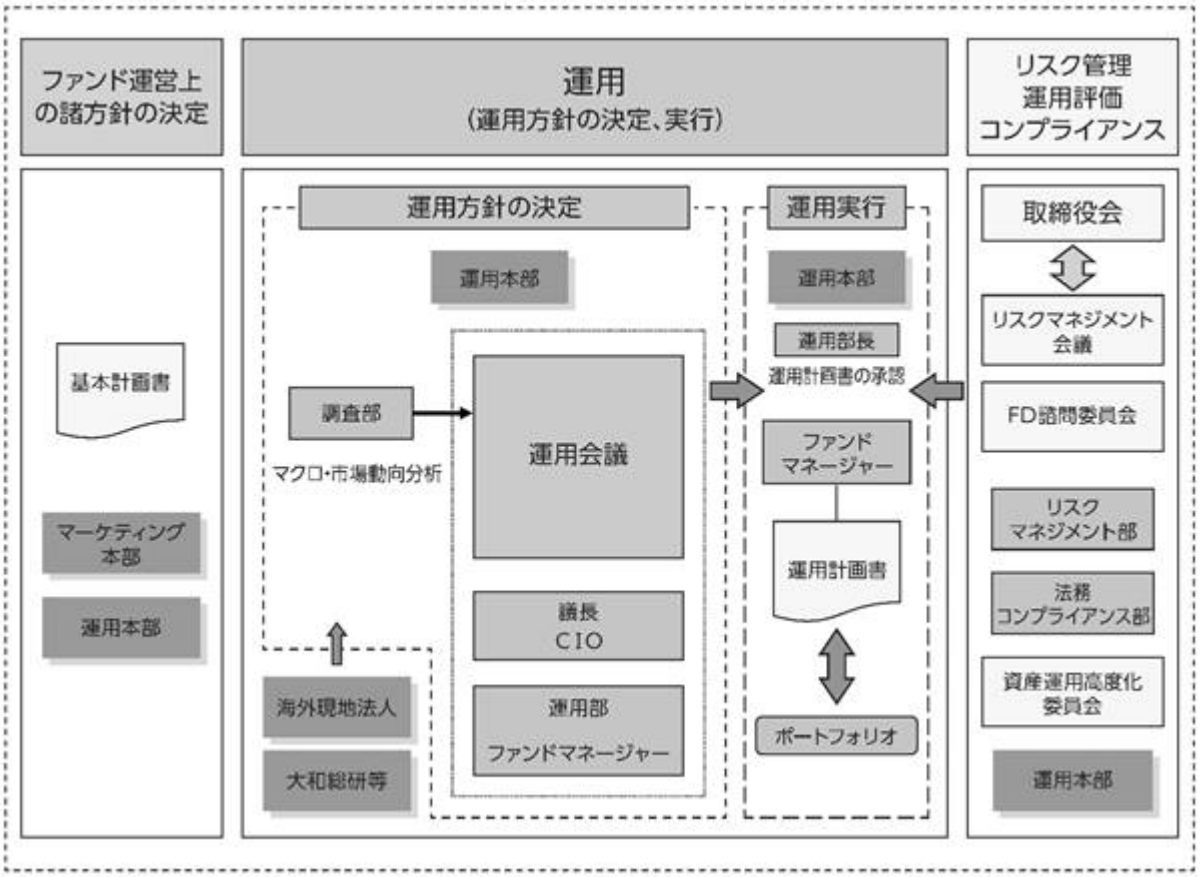
③ 前①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前② 1.から4.の金融商品により運用することの指図ができます。

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

(3)【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を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）（3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　リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は40～50名程度です。

イ．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。

ロ．FD諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役会に意見を述べます。

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、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2021年5月31日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

②　原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する株式、新株引受権証券、新株予約権証券および株式を組入可能な投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式、新株引受権証券、新株予約権証券および株式を組入可能な投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の70以上となる投資の指図をしません。

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

② 新株引受権証券等（信託約款）

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

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

③ 投資信託証券（信託約款）

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

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

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑥ 信用取引（信託約款）

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

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

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

⑦　先物取引等（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

⑧　スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑨　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

⑩　デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑪　同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

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

⑫　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

⑬　外貨建資産（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

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

⑭　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑮　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑯　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑰　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

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

（注）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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

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

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

2．日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

(2) 投資対象

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

（注）ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数とは

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

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

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

19．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
20．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1．預金
2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3．コール・ローン
4．手形割引市場において売買される手形
5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限
① 株式への投資割合には、制限を設けません。
② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針
① 主要投資対象
外国の公社債を主要投資対象とします。
② 投資態度
イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

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

(3) 主な投資制限

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

（注）FTSE世界国債インデックスとは

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

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

④ その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3)その他の留意点

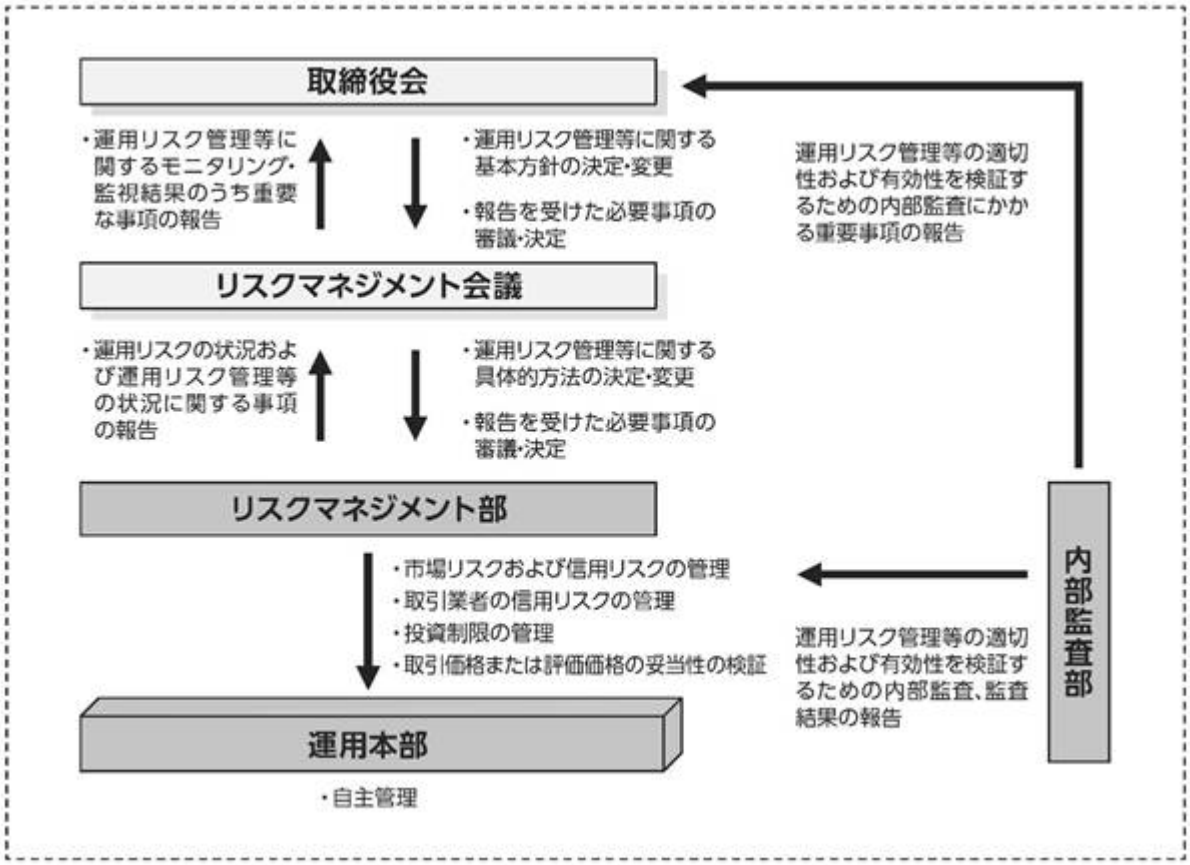
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

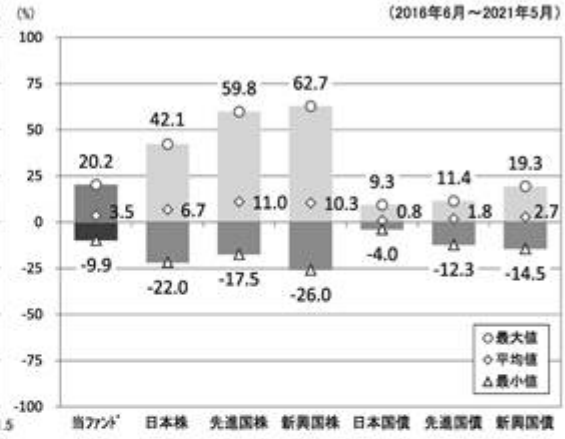
当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(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0.88%（税抜0.80%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.31% （税抜）	年率0.41% （税抜）	年率0.08% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

②　法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

＜注1＞個別元本について

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

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

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。

④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜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、2021年5月31日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】(2021年5月31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		1,972,599,991	99.72
	内 日本	1,972,599,991	99.72
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,545,123	0.28
純資産総額		1,978,145,114	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】(2021年5月31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	609,287,535	1.1698 712,770,340	1.2969 790,185,004	39.95
2	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	551,510,513	1.4181 782,121,177	1.4165 781,214,641	39.49
3	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	54,882,248	3.0015 164,729,098	3.6946 202,767,953	10.25
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	63,786,169	3.0123 192,148,116	3.1109 198,432,393	10.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.72%
合計	99.72%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第12計算期間末 (2011年11月30日)	603,075,596	603,075,596	0.8574	0.8574
第13計算期間末 (2012年11月30日)	719,167,462	719,167,462	0.9273	0.9273
第14計算期間末 (2013年12月2日)	1,007,693,413	1,007,693,413	1.2211	1.2211
第15計算期間末 (2014年12月1日)	1,228,167,574	1,228,167,574	1.3537	1.3537
第16計算期間末 (2015年11月30日)	1,404,196,917	1,404,196,917	1.4245	1.4245
第17計算期間末 (2016年11月30日)	1,465,951,744	1,465,951,744	1.3924	1.3924
第18計算期間末 (2017年11月30日)	1,713,186,417	1,713,186,417	1.5492	1.5492
第19計算期間末 (2018年11月30日)	1,723,934,458	1,723,934,458	1.5105	1.5105
第20計算期間末 (2019年12月2日)	1,808,612,513	1,808,612,513	1.5753	1.5753
2020年5月末日	1,747,701,028	－	1.5291	－
6月末日	1,757,633,837	－	1.5322	－
7月末日	1,745,524,221	－	1.5153	－
8月末日	1,797,405,887	－	1.5706	－

9月末日	1,793,143,449	－	1.5738	－
10月末日	1,764,795,186	－	1.5472	－
第21計算期間末 (2020年11月30日)	1,858,076,876	1,858,076,876	1.6341	1.6341
12月末日	1,890,174,661	－	1.6590	－
2021年1月末日	1,884,919,954	－	1.6613	－
2月末日	1,907,583,150	－	1.6806	－
3月末日	1,991,813,740	－	1.7383	－
4月末日	1,973,106,244	－	1.7267	－
5月末日	1,978,145,114	－	1.7402	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
2020年12月1日～ 2021年5月31日	－

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第12計算期間	△6.3
第13計算期間	8.2
第14計算期間	31.7
第15計算期間	10.9
第16計算期間	5.2
第17計算期間	△2.3
第18計算期間	11.3
第19計算期間	△2.5
第20計算期間	4.3
第21計算期間	3.7

2020年12月1日～ 2021年5月31日	6.5

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第12計算期間	121,282,471	38,179,409
第13計算期間	126,686,927	54,512,822
第14計算期間	149,054,501	99,400,765
第15計算期間	142,370,340	60,344,778
第16計算期間	154,905,052	76,406,144
第17計算期間	130,986,774	63,922,560
第18計算期間	140,075,352	87,065,061
第19計算期間	109,771,678	74,257,489
第20計算期間	103,111,720	96,316,220
第21計算期間	112,668,526	123,740,439
2020年12月1日～ 2021年5月31日	56,744,460	57,038,459

（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（2021年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		170,475,397,590	97.18
	内 日本	170,475,397,590	97.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		4,943,816,984	2.82
純資産総額		175,419,214,574	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		4,956,245,000	2.83
	内 日本	4,956,245,000	2.83

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

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

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

(2) 投資資産（2021年5月31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	654,500	7,099.10 4,646,361,823	9,115.00 5,965,767,500	3.40
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	404,900	8,279.74 3,352,468,223	10,785.00 4,366,846,500	2.49
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	503,200	6,445.49 3,243,373,236	8,256.00 4,154,419,200	2.37
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	63,400	47,371.25 3,003,337,459	53,870.00 3,415,358,000	1.95
5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,358,100	441.69 1,924,935,636	620.00 2,702,022,000	1.54
6	任天堂	日本	株式	その他製品	37,000	60,456.05 2,236,874,185	67,700.00 2,504,900,000	1.43
7	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	442,300	4,308.51 1,905,654,509	5,555.00 2,456,976,500	1.40
8	信越化学	日本	株式	化学	117,000	14,464.89 1,692,393,019	18,855.00 2,206,035,000	1.26
9	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	741,500	2,247.72 1,666,691,835	2,931.50 2,173,707,250	1.24
10	武田薬品	日本	株式	医薬品	537,600	3,921.23 2,108,057,847	3,719.00 1,999,334,400	1.14
11	日本電産	日本	株式	電気機器	155,500	9,811.66 1,525,714,040	12,530.00 1,948,415,000	1.11
12	KDDI	日本	株式	情報・通信業	508,500	2,810.08 1,428,926,023	3,717.00 1,890,094,500	1.08
13	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	37,900	27,215.41 1,031,464,361	48,660.00 1,844,214,000	1.05
14	HOYA	日本	株式	精密機器	127,200	11,724.11 1,491,306,847	14,350.00 1,825,320,000	1.04
15	日立	日本	株式	電気機器	310,600	3,716.83 1,154,449,618	5,736.00 1,781,601,600	1.02
16	ダイキン工業	日本	株式	機械	82,300	19,605.27 1,613,514,015	21,605.00 1,778,091,500	1.01

17	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	440,900	3,084.40 1,359,915,395	3,951.00 1,741,995,900	0.99
18	本田技研	日本	株式	輸送用機器	508,700	2,552.90 1,298,663,973	3,353.00 1,705,671,100	0.97
19	村田製作所	日本	株式	電気機器	189,800	6,898.36 1,309,309,238	8,279.00 1,571,354,200	0.90
20	ファナック	日本	株式	電気機器	56,700	20,510.31 1,162,935,059	26,300.00 1,491,210,000	0.85
21	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	865,600	1,387.49 1,201,017,660	1,673.00 1,448,148,800	0.83
22	伊藤忠	日本	株式	卸売業	445,100	2,774.55 1,234,954,216	3,249.00 1,446,129,900	0.82
23	第一三共	日本	株式	医薬品	506,400	3,254.38 1,648,021,719	2,530.00 1,281,192,000	0.73
24	三井物産	日本	株式	卸売業	516,800	1,892.31 977,948,373	2,414.00 1,247,555,200	0.71
25	SMC	日本	株式	機械	18,900	58,247.88 1,100,885,063	65,520.00 1,238,328,000	0.71
26	セブン&アイ･HLDGS	日本	株式	小売業	248,900	3,388.78 843,468,941	4,736.00 1,178,790,400	0.67
27	三菱商事	日本	株式	卸売業	387,600	2,627.13 1,018,276,263	2,984.00 1,156,598,400	0.66
28	東京海上HD	日本	株式	保険業	211,200	4,858.87 1,026,194,829	5,179.00 1,093,804,800	0.62
29	三菱電機	日本	株式	電気機器	645,200	1,474.95 951,644,197	1,692.00 1,091,678,400	0.62
30	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	65,800	15,166.71 997,970,072	16,310.00 1,073,198,000	0.61

(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	97.18%
合計	97.18%

(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	0.08%

鉱業	0.17%
建設業	2.25%
食料品	3.29%
繊維製品	0.47%
パルプ・紙	0.23%
化学	7.18%
医薬品	4.94%
石油・石炭製品	0.40%
ゴム製品	0.65%
ガラス・土石製品	0.77%
鉄鋼	0.82%
非鉄金属	0.74%
金属製品	0.60%
機械	5.47%
電気機器	17.29%
輸送用機器	7.43%
精密機器	2.63%
その他製品	2.47%
電気・ガス業	1.19%
陸運業	3.23%
海運業	0.27%
空運業	0.46%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	8.77%
卸売業	4.60%
小売業	4.40%
銀行業	5.03%
証券、商品先物取引業	0.79%
保険業	1.90%
その他金融業	1.09%
不動産業	1.93%
サービス業	5.44%
合計	97.18%

(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　０３０６月	買建	257	4,975,865,050	4,956,245,000	2.83%

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

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2021年5月31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		80,513,188,400	88.78
	内 日本	80,513,188,400	88.78
地方債証券		3,812,142,600	4.20
	内 日本	3,812,142,600	4.20
特殊債券		2,885,269,100	3.18
	内 日本	2,885,269,100	3.18
社債券		2,680,207,800	2.96
	内 日本	2,680,207,800	2.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		795,690,224	0.88
純資産総額		90,686,498,124	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（2021年5月31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	135 5年国債	日本	国債証券	1,550,000,000	100.54 1,558,463,000	100.42 1,556,572,000	0.100000 2023/03/20	1.72
2	138 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	100.75 1,209,010,000	100.60 1,207,224,000	0.100000 2023/12/20	1.33
3	349 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	101.38 1,064,532,000	101.05 1,061,046,000	0.100000 2027/12/20	1.17
4	342 10年国債	日本	国債証券	1,030,000,000	101.06 1,040,967,500	100.96 1,039,929,200	0.100000 2026/03/20	1.15
5	359 10年国債	日本	国債証券	980,000,000	100.85 988,387,440	100.54 985,301,800	0.100000 2030/06/20	1.09
6	360 10年国債	日本	国債証券	980,000,000	100.63 986,240,400	100.46 984,537,400	0.100000 2030/09/20	1.09
7	136 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.60 955,709,500	100.48 954,588,500	0.100000 2023/06/20	1.05
8	134 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.49 954,681,100	100.35 953,401,000	0.100000 2022/12/20	1.05
9	141 5年国債	日本	国債証券	920,000,000	100.91 928,436,400	100.74 926,863,200	0.100000 2024/09/20	1.02
10	334 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	102.60 923,436,000	102.23 920,124,000	0.600000 2024/06/20	1.01
11	139 5年国債	日本	国債証券	900,000,000	100.78 907,109,500	100.66 905,940,000	0.100000 2024/03/20	1.00
12	132 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.34 883,071,200	100.23 882,032,800	0.100000 2022/06/20	0.97
13	145 5年国債	日本	国債証券	870,000,000	100.97 878,506,600	100.95 878,273,700	0.100000 2025/09/20	0.97
14	142 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	100.88 857,493,700	100.80 856,825,500	0.100000 2024/12/20	0.94
15	345 10年国債	日本	国債証券	830,000,000	101.18 839,852,900	101.00 838,333,200	0.100000 2026/12/20	0.92
16	344 10年国債	日本	国債証券	820,000,000	101.16 829,569,400	100.98 828,077,000	0.100000 2026/09/20	0.91
17	351 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	101.36 810,936,000	101.02 808,200,000	0.100000 2028/06/20	0.89
18	137 5年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.66 805,293,600	100.54 804,344,000	0.100000 2023/09/20	0.89
19	343 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.08 788,437,800	100.96 787,519,200	0.100000 2026/06/20	0.87
20	340 10年国債	日本	国債証券	760,000,000	102.46 778,711,200	102.24 777,092,400	0.400000 2025/09/20	0.86

21	352 10年国債	日本	国債証券	750,000,000	101.33 759,997,500	100.98 757,410,000	0.100000 2028/09/20	0.84
22	415 2年国債	日本	国債証券	750,000,000	100.40 753,067,500	100.27 752,055,000	0.100000 2022/08/01	0.83
23	333 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	102.43 717,045,000	102.06 714,455,000	0.600000 2024/03/20	0.79
24	346 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.26 708,869,000	101.01 707,133,000	0.100000 2027/03/20	0.78
25	144 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.00 707,007,500	100.91 706,412,000	0.100000 2025/06/20	0.78
26	143 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.98 706,878,000	100.85 706,013,000	0.100000 2025/03/20	0.78
27	140 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.85 705,968,000	100.70 704,928,000	0.100000 2024/06/20	0.78
28	335 10年国債	日本	国債証券	690,000,000	102.40 706,608,300	102.07 704,303,700	0.500000 2024/09/20	0.78
29	355 10年国債	日本	国債証券	690,000,000	101.20 698,286,900	100.84 695,830,500	0.100000 2029/06/20	0.77
30	358 10年国債	日本	国債証券	660,000,000	100.88 665,838,400	100.65 664,342,800	0.100000 2030/03/20	0.73

(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	88.78%
地方債証券	4.20%
特殊債券	3.18%
社債券	2.96%
合計	99.12%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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（2021年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		198,641,609,057	92.78
	内 香港	2,238,174,804	1.05
	内 シンガポール	677,721,263	0.32
	内 イスラエル	413,772,532	0.19
	内 ノルウェー	444,583,513	0.21
	内 スウェーデン	2,624,313,489	1.23
	内 デンマーク	1,758,224,779	0.82
	内 イギリス	9,445,632,737	4.41
	内 アイルランド	457,997,846	0.21
	内 オランダ	2,776,782,199	1.30
	内 ベルギー	623,121,560	0.29
	内 フランス	7,430,206,927	3.47
	内 ドイツ	6,143,989,874	2.87
	内 スイス	6,150,735,462	2.87
	内 ポルトガル	128,615,089	0.06
	内 スペイン	1,671,124,988	0.78
	内 イタリア	1,631,148,159	0.76
	内 フィンランド	677,280,023	0.32
	内 オーストリア	132,057,752	0.06
	内 カナダ	7,366,129,263	3.44
	内 アメリカ	141,563,324,415	66.12
	内 オーストラリア	4,123,436,341	1.93
	内 ニュージーランド	163,236,042	0.08
投資証券		4,785,831,584	2.24
	内 香港	94,418,083	0.04
	内 シンガポール	90,292,273	0.04
	内 イギリス	115,152,400	0.05
	内 フランス	113,386,043	0.05
	内 カナダ	23,623,314	0.01
	内 アメリカ	3,879,116,633	1.81

	内 オーストラリア	449,158,846	0.21
	内 その他	20,683,992	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,682,481,137	4.99
純資産総額		214,109,921,778	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		10,990,945,523	5.13
	内 イギリス	524,571,168	0.25
	内 ドイツ	1,869,793,961	0.87
	内 カナダ	453,029,296	0.21
	内 アメリカ	7,749,091,123	3.62
	内 オーストラリア	394,459,975	0.18
為替予約取引（買建）		11,263,127,671	5.26
	内 日本	11,263,127,671	5.26

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

(注2) 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（2021年5月31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	584,700	12,844.88 7,510,408,015	13,677.19 7,997,055,098	3.74
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	249,500	23,820.88 5,943,333,104	27,404.87 6,837,516,762	3.19
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	14,900	350,796.03 5,226,861,785	353,764.16 5,271,086,032	2.46

4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	83,600	30,675.83 2,564,502,008	36,081.40 3,016,405,441	1.41
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	10,237	199,100.57 2,038,193,252	264,692.82 2,709,660,456	1.27
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	10,450	199,108.26 2,080,681,926	258,687.85 2,703,288,095	1.26
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	105,870	13,530.22 1,432,452,230	18,026.98 1,908,516,627	0.89
8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	26,670	65,011.06 1,733,846,253	68,624.14 1,830,206,006	0.85
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	91,200	15,926.61 1,452,510,826	18,576.88 1,694,211,456	0.79
10	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	21,470	58,582.31 1,257,762,374	71,319.85 1,531,237,240	0.72
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	47,550	25,627.97 1,218,611,662	31,768.93 1,510,612,831	0.71
12	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	32,916	37,328.16 1,228,695,098	45,212.33 1,488,209,357	0.70
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	58,900	23,229.16 1,368,199,340	24,948.44 1,469,463,587	0.69
14	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	98,900	12,481.87 1,234,463,135	13,546.63 1,339,762,617	0.63
15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	37,400	30,454.22 1,138,988,850	35,003.56 1,309,133,204	0.61
16	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	85,467	15,175.52 1,297,013,161	14,801.13 1,265,008,691	0.59
17	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	269,301	3,241.65 873,003,599	4,652.72 1,252,983,872	0.59

18	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	62,862	16,389.91 1,030,309,004	19,608.62 1,232,637,322	0.58
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	30,750	37,366.69 1,149,028,158	39,577.26 1,217,000,770	0.57
20	PAYPAL HOLDINGS INC	アメリカ	株式	情報技術	38,600	23,500.49 907,121,014	28,539.79 1,101,636,095	0.51
21	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	14,410	49,748.73 716,881,017	73,864.60 1,064,388,915	0.50
22	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	158,690	5,701.92 904,843,933	6,293.63 998,737,478	0.47
23	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	146,705	4,512.78 662,052,887	6,406.69 939,893,632	0.44
24	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	24,130	36,898.25 890,356,123	38,474.79 928,396,827	0.43
25	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	16,620	52,443.43 871,611,196	55,382.70 920,460,487	0.43
26	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	143,504	6,624.12 950,600,882	6,200.34 889,773,936	0.42
27	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	141,200	5,233.24 738,935,711	6,269.49 885,252,157	0.41
28	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	141,900	5,786.65 821,130,475	6,068.63 861,138,654	0.40
29	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	146,250	4,732.74 692,165,988	5,806.30 849,171,960	0.40
30	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	54,450	16,458.51 896,168,997	15,589.21 848,832,637	0.40

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.78%
投資証券	2.24%
合計	95.01%

(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	3.12%
素材	4.37%
資本財・サービス	9.57%
一般消費財・サービス	10.81%
生活必需品	6.82%
ヘルスケア	11.94%
金融	13.85%
情報技術	20.44%
コミュニケーション・サービス	8.58%
公益事業	2.86%
不動産	0.42%
合計	92.78%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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 EMINI FUT 202106	買建	336	7,651,308,903	7,749,091,123	3.62%
	イギリス	FTSE 100 IDX FUT 202106	買建	48	521,795,575	524,571,168	0.25%
	オーストラリア	SPI 200 FUTURES 202106	買建	26	381,916,084	394,459,975	0.18%
	カナダ	S&P/TSX 60 IX FUT 202106	買建	21	441,227,129	453,029,296	0.21%
	ドイツ	SWISS MKT IX FUTR 202106	買建	30	406,194,062	417,883,098	0.20%
		EURO STOXX 50 202106	買建	267	1,413,944,016	1,451,910,863	0.68%
為替予約取引	日本	スイス・フラン買/円売 2021年6月	買建	2,330,000	282,796,192	284,093,871	0.13%
		豪ドル買/円売 2021年6月	買建	2,820,000	238,521,931	238,515,600	0.11%

		米ドル買/円売 2021年6月	買建	83,390,000	9,127,342,890	9,152,657,027	4.27%
		英ポンド買/円売 2021年6月	買建	2,770,000	429,314,186	431,002,661	0.20%
		ユーロ買/円売 2021年6月	買建	6,470,000	859,964,512	865,373,499	0.40%
		カナダ・ドル買/円売 2021年6月	買建	3,210,000	289,759,784	291,485,013	0.14%

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

(注2) 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（2021年5月31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		221,706,401,058	98.82
	内 ユーロ	90,956,369,227	40.54
	内 シンガポール	924,396,011	0.41
	内 マレーシア	1,061,833,109	0.47
	内 イスラエル	988,854,397	0.44
	内 ノルウェー	552,922,706	0.25
	内 スウェーデン	784,676,071	0.35
	内 デンマーク	1,090,784,452	0.49
	内 イギリス	14,581,676,553	6.50
	内 ポーランド	1,399,740,095	0.62
	内 カナダ	4,541,272,415	2.02
	内 アメリカ	98,215,325,770	43.78
	内 メキシコ	1,775,745,502	0.79
	内 オーストラリア	4,832,804,750	2.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,649,023,182	1.18
純資産総額		224,355,424,240	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		1,076,503,767	0.48
	内 日本	1,076,503,767	0.48

(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（2021年5月31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	10,700,000	95.68 1,123,724,732	95.96 1,127,078,901	1.125000 2031/02/15	0.50
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,000,000	98.10 1,076,756,576	92.22 1,012,228,672	0.625000 2030/08/15	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	99.33 1,068,512,496	94.08 1,012,023,420	0.875000 2030/11/15	0.45
4	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,864,000	189.46 979,080,282	172.52 891,570,124	4.500000 2041/04/25	0.40
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	105.20 892,479,948	104.08 882,989,526	1.625000 2026/05/15	0.39
6	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	128.09 871,475,605	122.44 833,050,262	2.500000 2030/05/25	0.37
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	116.60 857,474,425	111.11 817,145,528	2.875000 2028/08/15	0.36
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,500,000	99.60 819,981,288	98.73 812,811,216	0.250000 2025/06/30	0.36
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,800,000	98.33 841,873,468	92.56 792,483,444	0.625000 2030/05/15	0.35
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	115.31 835,338,577	109.36 792,243,070	2.625000 2029/02/15	0.35
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	116.28 829,652,241	110.96 791,633,024	2.875000 2028/05/15	0.35
12	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,730,000	101.88 780,790,850	101.31 776,369,125	－ 2023/04/14	0.35

13	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	3,571,000	173.86 830,363,650	161.46 771,138,268	4.000000 2037/01/04	0.34
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,350,000	114.92 801,025,199	110.19 768,060,582	2.750000 2028/02/15	0.34
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,400,000	111.71 784,722,534	107.83 757,480,980	2.375000 2027/05/15	0.34
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	4,920,000	119.56 786,738,656	113.85 749,179,970	1.500000 2031/05/25	0.33
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,668,000	102.86 752,833,395	102.21 748,054,220	1.625000 2022/11/15	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	7,000,000	96.94 744,811,637	97.22 747,006,803	0.750000 2028/01/31	0.33
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	5,086,000	110.45 751,316,721	108.58 738,576,544	2.250000 2024/05/25	0.33
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	5,101,000	108.38 739,431,325	106.64 727,533,622	1.000000 2025/11/25	0.32
21	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	3,448,000	163.79 755,316,924	156.40 721,229,787	5.500000 2031/01/04	0.32
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,162,000	107.84 729,386,554	106.48 720,222,131	2.375000 2024/08/15	0.32
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	4,499,000	123.39 742,445,049	119.60 719,682,879	2.750000 2027/10/25	0.32
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,287,000	103.67 715,448,468	102.85 709,789,967	2.000000 2022/11/30	0.32
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	4,899,000	109.92 720,239,747	108.13 708,505,254	1.750000 2024/11/25	0.32
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	4,950,000	110.17 729,372,822	106.69 706,301,669	0.750000 2028/11/25	0.31
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,500,000	99.51 709,979,816	98.39 701,953,616	0.250000 2025/09/30	0.31
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	5,900,000	111.12 719,627,720	107.09 693,543,036	2.250000 2027/08/15	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	5,921,000	107.71 700,047,389	106.28 690,708,485	2.250000 2024/11/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	5,840,000	109.21 700,085,632	107.00 685,868,288	2.250000 2025/11/15	0.31

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率

国債証券	98.82%
合計	98.82%

(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	デンマーク・クローネ買/円売 2021年7月	買建	361,000	6,502,158	6,494,390	0.00%
		米ドル買/円売 2021年7月	買建	2,667,000	293,092,632	292,671,246	0.13%
		英ポンド買/円売 2021年6月	買建	108,000	16,804,713	16,804,659	0.01%
		マレーシア・リンギット買/円売 2021年6月	買建	200,000	5,295,800	5,296,360	0.00%
		ユーロ買/円売 2021年6月	買建	973,000	130,187,159	130,131,878	0.06%
		ユーロ買/円売 2021年7月	買建	3,236,000	433,497,537	432,953,177	0.19%
		豪ドル買/円売 2021年7月	買建	237,000	20,163,888	20,045,460	0.01%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2021年7月	買建	1,680,000	22,289,608	22,176,000	0.01%
		米ドル買/円売 2021年6月	買建	1,366,000	150,003,654	149,930,597	0.07%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワライフスタイル50

2021年5月31日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	17,402円
純資産総額	19億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.8%
3カ月間	3.5%
6カ月間	6.5%
1年間	13.8%
3年間	13.5%
5年間	27.8%
設定来	74.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第10期 09年11月	第11期 10年11月	第12期 11年11月	第13期 12年11月	第14期 13年12月	第15期 14年12月	第16期 15年11月	第17期 16年11月	第18期 17年11月	第19期 18年11月	第20期 19年12月	第21期 20年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式・先物	2,135	39.9%
国内債券	341	39.1%
外国株式・先物	1,236	10.0%
外国債券	831	9.9%
外国リート	58	0.2%
外国投資証券	6	0.0%
コール・ローン、その他		2.4%
合計	4,607	－

通貨別構成	比率
日本円	79.7%
米ドル	11.8%
ユーロ	5.2%
英ポンド	1.1%
カナダ・ドル	0.6%
豪ドル	0.5%
スイス・フラン	0.3%
スウェーデン・クローネ	0.2%
デンマーク・クローネ	0.1%
その他	0.5%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.0
最終利回り(%)	0.2
修正デュレーション	9.1
残存年数	10.1

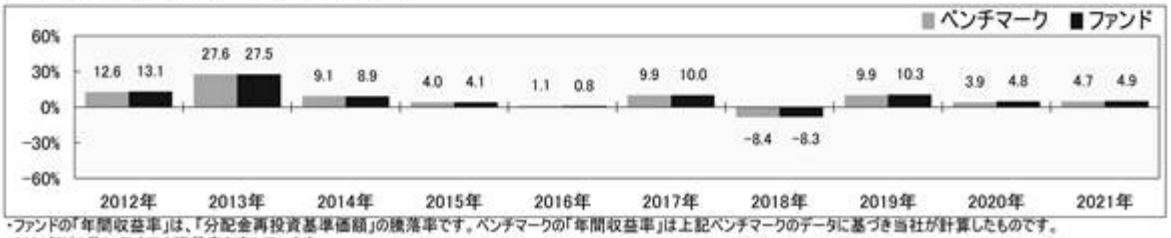
債券格付別構成	比率
AAA	89.5%
AA	4.8%
A	4.2%
BBB	－
BB以下・無格付	1.6%
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
トヨタ自動車	日本	1.4%
TOPIX先物　0306月	日本	1.1%
ソニーグループ	日本	1.0%
ソフトバンクグループ	日本	0.9%
キーエンス	日本	0.8%
三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.6%
任天堂	日本	0.6%
リクルートホールディングス	日本	0.6%
信越化学	日本	0.5%
日本電信電話	日本	0.5%
合計		7.9%

※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1.6%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。
・2021年は5月31日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

２【換金（解約）手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	https://www.daiwa-am.co.jp/

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

・公社債等：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

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

④ 運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤　公告

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

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

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

⑥　関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

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。

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21期計算期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワライフスタイル５０

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 2019年12月2日現在	第21期 2020年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	15,222,744	14,030,575
親投資信託受益証券	1,803,403,861	1,852,711,557
未収入金	718,000	232,000
流動資産合計	1,819,344,605	1,866,974,132
資産合計	1,819,344,605	1,866,974,132
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,034,078	1,031,270
未払受託者報酬	762,540	779,260
未払委託者報酬	6,863,227	7,013,759
その他未払費用	72,247	72,967
流動負債合計	10,732,092	8,897,256
負債合計	10,732,092	8,897,256
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,148,127,482	※1 1,137,055,569
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	660,485,031	721,021,307
（分配準備積立金）	401,699,602	430,504,109
元本等合計	1,808,612,513	1,858,076,876
純資産合計	1,808,612,513	1,858,076,876
負債純資産合計	1,819,344,605	1,866,974,132

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期 自　2018年12月1日 至　2019年12月2日	第21期 自　2019年12月3日 至　2020年11月30日
営業収益		
受取利息	12	36
有価証券売買等損益	89,254,989	80,654,696
営業収益合計	89,255,001	80,654,732
営業費用		
支払利息	5,266	3,407
受託者報酬	1,497,138	1,543,634
委託者報酬	13,475,011	13,893,512
その他費用	141,315	144,635
営業費用合計	15,118,730	15,585,188
営業利益	74,136,271	65,069,544
経常利益	74,136,271	65,069,544
当期純利益	74,136,271	65,069,544
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 709,724	△ 4,920,754
期首剰余金又は期首欠損金（△）	582,602,476	660,485,031
剰余金増加額又は欠損金減少額	52,125,566	61,528,477
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	52,125,566	61,528,477
剰余金減少額又は欠損金増加額	49,089,006	70,982,499
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	49,089,006	70,982,499
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	660,485,031	721,021,307

(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21期 自　2019年12月3日 至　2020年11月30日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第20期 2019年12月2日現在	第21期 2020年11月30日現在
1．※1　期首元本額	1,141,331,982円	1,148,127,482円
期中追加設定元本額	103,111,720円	112,668,526円
期中一部解約元本額	96,316,220円	123,740,439円
2．計算期間末日における受益権の総数	1,148,127,482口	1,137,055,569口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第20期 自　2018年12月1日 至　2019年12月2日	第21期 自　2019年12月3日 至　2020年11月30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（35,470,249円）、投資信託約款に規定される収益調整金（492,038,278円）及び分配準備積立金（366,229,353円）より分配対象額は893,737,880円（1万口当たり7,784.31円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（69,988,997円）、投資信託約款に規定される収益調整金（524,603,988円）及び分配準備積立金（360,515,112円）より分配対象額は955,108,097円（1万口当たり8,399.84円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第21期 自　2019年12月3日 至　2020年11月30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21期 2020年11月30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20期 2019年12月2日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第21期 2020年11月30日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	88,548,250	81,712,300
合計	88,548,250	81,712,300

（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20期 2019年12月2日現在	第21期 2020年11月30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21期 自　2019年12月3日 至　2020年11月30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20期 2019年12月2日現在	第21期 2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.5753円	1.6341円

（1万口当たり純資産額）	(15,753円)	(16,341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	655,627,347	766,952,870	
	日本債券インデックスマザーファンド	504,172,138	715,168,177	
	外国株式インデックスマザーファンド	63,519,419	190,653,536	
	外国債券インデックスマザーファンド	59,767,812	179,936,974	
親投資信託受益証券　合計			1,852,711,557	
合計			1,852,711,557	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在

		金　額（円）	金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		15,866,424,459	12,212,008,294
株式	※2※3	162,602,439,840	163,479,342,460
派生商品評価勘定		76,885,750	89,140,900
未収入金		44,835,510	－
未収配当金		717,704,956	1,010,955,223
未収利息		1,374,718	814,653
その他未収収益	※4	32,184,457	33,720,594
差入委託証拠金		39,360,000	－
流動資産合計		179,381,209,690	176,825,982,124
資産合計		179,381,209,690	176,825,982,124
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		－	23,231,250
前受金		86,417,200	102,752,600
未払金		1,370,527,390	－
未払解約金		123,739,000	189,585,900
受入担保金		13,103,577,689	9,568,784,085
その他未払費用		10,575	－
流動負債合計		14,684,271,854	9,884,353,835
負債合計		14,684,271,854	9,884,353,835
純資産の部			
元本等			
元本	※1	147,704,616,967	142,709,508,970
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		16,992,320,869	24,232,119,319
元本等合計		164,696,937,836	166,941,628,289
純資産合計		164,696,937,836	166,941,628,289
負債純資産合計		179,381,209,690	176,825,982,124

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12月3日 至　2020年11月30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12月2日現在	2020年11月30日現在
1．※1　期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	134,890,694,102円	147,704,616,967円
期中追加設定元本額	33,001,020,844円	28,551,522,466円
期中一部解約元本額	20,187,097,979円	33,546,630,463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	3,765,431,907円	3,193,110,083円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	7,517,011,572円	6,674,458,363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	5,764,295円	930,834円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	59,609,321円	32,952,471円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	777,014,581円	668,546,231円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	46,976,403円	35,731,278円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,145,153,691円	908,394,726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）	46,927,453円	126,217,518円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	50,758,188円	38,327,788円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	16,362,055円	10,549,517円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	7,650,621円	23,213,652円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	1,290,732,581円	2,041,017,760円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,996,082,570円	2,619,294,575円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	64,246,554円	125,857,474円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	65,235,675,867円	64,944,239,094円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,856,480,263円	2,972,314,135円
ダイワ・ライフ・バランス５０	3,215,288,075円	3,751,798,888円
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,971,577,942円	3,333,100,735円
年金ダイワ日本株式インデックス	4,856,558,312円	5,191,048,366円

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	13,563,401円	11,676,676円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	55,375,861円	46,996,347円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	24,888,377円	34,721,962円
ダイワつみたてインデックス日本株式	266,294,654円	817,787,252円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	431,467円	10,918,252円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	315,899円	7,976,371円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	2,320,710円	11,268,546円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	150,205,619円	141,666,674円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	158,266,050円	149,563,586円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	8,647,121,514円	7,748,159,579円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	730,190,060円	659,469,668円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	124,454,938円	99,902,437円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	216,391,069円	178,714,272円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	152,878,769円	149,232,217円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	10,075,963,979円	10,242,225,102円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	13,126,419,796円	9,426,768,765円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	2,555,624,273円	2,261,893,318円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,351,353,152円	1,247,128,871円
ダイワライフスタイル２５	182,799,162円	180,844,569円
ダイワライフスタイル５０	662,351,711円	655,627,347円

	ダイワライフスタイル７５	530,142,751円	519,251,046円
	ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	12,751,961,504円	11,416,612,625円
	計	147,704,616,967円	142,709,508,970円
2.	期末日における受益権の総数	147,704,616,967口	142,709,508,970口
3.	※2　貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　12,524,034,910円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　9,033,368,760円
4.	※3　差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　565,900,000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　740,845,000円
5.	※4　その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分29,453,875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32,214,780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12月3日 至　2020年11月30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11月30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12月2日現在	2020年11月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	8,993,918,872	9,890,799,472
合計	8,993,918,872	9,890,799,472

（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（2019年9月20日から2019年12月2日まで、及び2020年9月24日から2020年11月30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12月2日 現在				2020年11月30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								
株価指数先物取引								
買　建	2,308,972,800	－	2,385,935,000	76,962,200	2,900,792,400	－	2,966,795,000	66,002,600
合計	2,308,972,800	－	2,385,935,000	76,962,200	2,900,792,400	－	2,966,795,000	66,002,600

（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12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1150円	1.1698円
（1万口当たり純資産額）	(11,150円)	(11,698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	2,795.00	9,223,500	
日本水産	91,600	401.00	36,731,600	
マルハニチロ	13,300	2,124.00	28,249,200	
ホウスイ	500	965.00	482,500	
カネコ種苗	2,800	1,543.00	4,320,400	
サカタのタネ	11,000	3,365.00	37,015,000	

ホクト	7,100	2,060.00	14,626,000	貸付株式数	2,800株
ホクリヨウ	1,600	693.00	1,108,800		
ヒノキヤグループ	2,300	2,175.00	5,002,500		
ショーボンドＨＤ	14,300	5,200.00	74,360,000		
ミライト・ホールディングス	27,100	1,565.00	42,411,500		
タマホーム	5,000	1,439.00	7,195,000	貸付株式数	1,900株
サンヨーホームズ	500	697.00	348,500	貸付株式数	300株
日本アクア	3,800	635.00	2,413,000	貸付株式数	1,400株
ファーストコーポレーション	3,000	695.00	2,085,000	貸付株式数	600株 (600株)
ベステラ	1,600	1,533.00	2,452,800	貸付株式数	600株
キャンディル	1,400	508.00	711,200		
スペースバリューＨＤ	11,100	611.00	6,782,100		
住石ホールディングス	18,400	117.00	2,152,800		
日鉄鉱業	2,100	5,290.00	11,109,000		
三井松島ＨＬＤＧＳ	3,400	738.00	2,509,200		
国際石油開発帝石	336,200	584.00	196,340,800		
石油資源開発	12,100	1,758.00	21,271,800	貸付株式数	500株
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,500	1,460.00	6,570,000		
ダイセキ環境ソリューション	1,800	682.00	1,227,600		
第一カッター興業	1,100	2,218.00	2,439,800		
明豊ファシリティワークス	2,700	621.00	1,676,700		
安藤・間	54,700	688.00	37,633,600		
東急建設	27,100	469.00	12,709,900		
コムシスホールディングス	32,500	3,090.00	100,425,000		
ビーアールホールディングス	9,900	710.00	7,029,000	貸付株式数	3,900株 (3,900株)
高松コンストラクショングループ	5,600	2,037.00	11,407,200	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,800	8,090.00	22,652,000	貸付株式数	600株
ソネック	900	866.00	779,400		
ヤマウラ	4,000	906.00	3,624,000	貸付株式数	1,500株
大成建設	70,300	3,690.00	259,407,000		
大　林　組	210,600	920.00	193,752,000		
清水建設	213,700	793.00	169,464,100		
飛島建設	5,900	1,077.00	6,354,300	貸付株式数	1,900株
長谷工コーポレーシヨン	81,600	1,129.00	92,126,400		
松井建設	8,300	733.00	6,083,900		

錢　高　組	900	4,595.00	4,135,500		
鹿島建設	165,400	1,373.00	227,094,200		
不動テトラ	5,500	1,678.00	9,229,000		
大末建設	2,300	893.00	2,053,900		
鉄建建設	4,600	1,803.00	8,293,800		
西松建設	16,400	1,940.00	31,816,000	貸付株式数	6,500株
三井住友建設	51,400	429.00	22,050,600	貸付株式数	1,000株
大豊建設	4,800	3,470.00	16,656,000	貸付株式数	1,900株
前田建設	52,700	818.00	43,108,600		
佐田建設	4,500	447.00	2,011,500	貸付株式数	800株
ナカノフドー建設	5,700	409.00	2,331,300	貸付株式数	1,300株
奥　村　組	9,900	2,441.00	24,165,900		
東鉄工業	9,000	2,800.00	25,200,000		
イチケン	1,500	1,755.00	2,632,500		
富士ピー・エス	3,000	606.00	1,818,000	貸付株式数	1,000株
淺沼組	2,400	3,975.00	9,540,000		
戸田建設	87,500	613.00	53,637,500	貸付株式数	35,000株
熊　谷　組	9,800	2,362.00	23,147,600		
北野建設	1,300	2,725.00	3,542,500	貸付株式数	400株
植　木　組	900	2,745.00	2,470,500	貸付株式数	300株
矢作建設	9,300	902.00	8,388,600		
ピーエス三菱	7,000	568.00	3,976,000	貸付株式数	2,700株
日本ハウスＨＬＤＧＳ	14,200	238.00	3,379,600	貸付株式数	1,400株
大東建託	23,000	10,240.00	235,520,000		
新日本建設	8,900	850.00	7,565,000		
ＮＩＰＰＯ	17,400	2,727.00	47,449,800		
東亜道路	1,300	3,695.00	4,803,500		
前田道路	18,700	1,677.00	31,359,900		
日本道路	2,000	7,390.00	14,780,000		
東亜建設	6,700	1,990.00	13,333,000	貸付株式数	2,600株
日本国土開発	20,700	545.00	11,281,500	貸付株式数	8,200株
若築建設	3,700	1,151.00	4,258,700		
東洋建設	23,900	397.00	9,488,300		
五洋建設	83,800	777.00	65,112,600	貸付株式数	15,600株
世紀東急	10,200	807.00	8,231,400		
福　田　組	2,500	5,290.00	13,225,000	貸付株式数	900株
日本ドライケミカル	1,700	1,547.00	2,629,900	貸付株式数	600株
住友林業	53,500	1,901.00	101,703,500		
日本基礎技術	7,300	492.00	3,591,600	貸付株式数	800株
巴コーポレーション	9,200	424.00	3,900,800		

大和ハウス	208,700	3,200.00	667,840,000		
ライト工業	12,200	1,675.00	20,435,000		
積水ハウス	228,600	1,878.00	429,310,800		
日特建設	5,500	801.00	4,405,500		
北陸電気工事	3,700	1,195.00	4,421,500		
ユアテック	11,700	665.00	7,780,500	貸付株式数	1,200株
日本リーテック	4,500	2,489.00	11,200,500	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
四電工	1,100	2,587.00	2,845,700		
中電工	8,200	2,132.00	17,482,400		
関　電　工	29,800	798.00	23,780,400		
きんでん	50,000	1,673.00	83,650,000		
東京エネシス	7,000	890.00	6,230,000	貸付株式数	1,300株
トーエネック	2,000	3,710.00	7,420,000		
住友電設	5,900	2,594.00	15,304,600	貸付株式数	500株
日本電設工業	11,500	2,157.00	24,805,500		
協和エクシオ	32,000	2,687.00	85,984,000		
新日本空調	5,600	2,239.00	12,538,400	貸付株式数	2,200株
日本工営	4,400	2,835.00	12,474,000		
九電工	14,800	2,985.00	44,178,000	貸付株式数	800株
三機工業	15,200	1,149.00	17,464,800		
日揮ホールディングス	64,900	935.00	60,681,500	貸付株式数	4,100株
中外炉工業	2,300	1,612.00	3,707,600		
ヤマト	6,800	741.00	5,038,800		
太平電業	5,100	2,411.00	12,296,100	貸付株式数	100株
高砂熱学	16,200	1,433.00	23,214,600		
三晃金属	800	2,632.00	2,105,600		
ＮＥＣネッツエスアイ	18,900	1,837.00	34,719,300	貸付株式数	7,500株
朝日工業社	1,400	3,220.00	4,508,000		
明星工業	13,600	777.00	10,567,200		
大　氣　社	10,200	2,777.00	28,325,400	貸付株式数	1,900株
ダイダン	5,000	2,782.00	13,910,000	貸付株式数	100株
日比谷総合設備	6,900	1,833.00	12,647,700	貸付株式数	100株
日本製粉	20,000	1,627.00	32,540,000	貸付株式数	7,900株
日清製粉Ｇ本社	76,400	1,697.00	129,650,800		
日東富士製粉	500	6,550.00	3,275,000		
昭和産業	6,300	3,160.00	19,908,000		
鳥越製粉	6,000	1,051.00	6,306,000	貸付株式数	2,400株
中部飼料	8,400	1,397.00	11,734,800		
フィード・ワン	9,100	885.00	8,053,500		

東洋精糖	1,200	1,211.00	1,453,200		
日本甜菜糖	3,500	1,596.00	5,586,000		
三井製糖	6,000	1,789.00	10,734,000	貸付株式数	2,200株
塩水港精糖	6,900	224.00	1,545,600	貸付株式数	2,100株
日新製糖	3,100	1,850.00	5,735,000	貸付株式数	700株
ＬＩＦＵＬＬ	22,600	391.00	8,836,600		
ミクシィ	12,400	2,851.00	35,352,400		
ジェイエイシーリクルートメント	4,300	1,854.00	7,972,200	貸付株式数	1,700株
日本M&Aセンター	49,300	7,300.00	359,890,000		
メンバーズ	1,900	2,290.00	4,351,000		
中広	600	385.00	231,000	貸付株式数	200株
ＵＴグループ	10,200	3,295.00	33,609,000	貸付株式数	4,000株 (800株)
アイティメディア	2,600	2,560.00	6,656,000	貸付株式数	1,000株
タケエイ	6,200	1,303.00	8,078,600		
Ｅ・Ｊホールディングス	2,400	1,034.00	2,481,600	貸付株式数	400株
ビーネックスグループ	8,100	1,140.00	9,234,000		
コシダカホールディングス	15,500	397.00	6,153,500	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,800	896.00	1,612,800		
パソナグループ	7,000	1,804.00	12,628,000	貸付株式数	2,500株
ＣＤＳ	1,600	1,290.00	2,064,000	貸付株式数	400株
リンクアンドモチベーション	12,300	558.00	6,863,400	貸付株式数	5,600株
ＧＣＡ	7,800	711.00	5,545,800		
エス・エム・エス	20,100	3,785.00	76,078,500	貸付株式数	8,000株
サニーサイドアップG	2,100	653.00	1,371,300	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	64,400	1,912.00	123,132,800		
リニカル	3,200	706.00	2,259,200	貸付株式数	1,200株
クックパッド	22,400	320.00	7,168,000	貸付株式数	8,600株
エスクリ	2,000	310.00	620,000	貸付株式数	200株
アイ・ケイ・ケイ	3,100	617.00	1,912,700		
森永製菓	15,900	3,810.00	60,579,000		
中　村　屋	1,800	4,045.00	7,281,000		
江崎グリコ	18,700	4,345.00	81,251,500		
名糖産業	3,300	1,470.00	4,851,000	貸付株式数	1,300株
井村屋グループ	3,800	2,568.00	9,758,400		
不　二　家	3,800	2,364.00	8,983,200	貸付株式数	1,500株
山崎製パン	50,800	1,732.00	87,985,600	貸付株式数	19,800株
第一屋製パン	1,300	997.00	1,296,100	貸付株式数	500株

モロゾフ	1,100	6,210.00	6,831,000		
亀田製菓	3,900	4,915.00	19,168,500		
寿スピリッツ	6,500	5,340.00	34,710,000	貸付株式数	2,600株
カルビー	31,000	3,085.00	95,635,000		
森永乳業	12,600	5,070.00	63,882,000		
六甲バター	4,500	1,887.00	8,491,500	貸付株式数	400株
ヤクルト	46,500	4,975.00	231,337,500		
明治ホールディングス	44,700	7,380.00	329,886,000		
雪印メグミルク	16,300	2,237.00	36,463,100	貸付株式数	4,900株
プリマハム	10,700	2,887.00	30,890,900		
日本ハム	25,800	4,455.00	114,939,000		
林兼産業	2,300	604.00	1,389,200		
丸大食品	7,300	1,657.00	12,096,100	貸付株式数	1,500株
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5,500	3,140.00	17,270,000		
柿安本店	2,300	2,510.00	5,773,000	貸付株式数	400株 (400株)
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	43,400	654.00	28,383,600		
学情	2,400	1,088.00	2,611,200		
スタジオアリス	3,200	1,883.00	6,025,600	貸付株式数	1,200株
クロスキャット	1,800	1,380.00	2,484,000	貸付株式数	700株
シミックホールディングス	3,300	1,371.00	4,524,300	貸付株式数	400株
エプコ	1,300	1,010.00	1,313,000		
システナ	23,700	2,150.00	50,955,000	貸付株式数	5,300株
ＮＪＳ	1,400	1,951.00	2,731,400	貸付株式数	400株
デジタルアーツ	3,300	8,930.00	29,469,000	貸付株式数	1,100株
日鉄ソリューションズ	9,800	3,085.00	30,233,000		
綜合警備保障	25,500	5,590.00	142,545,000		
キューブシステム	3,500	1,446.00	5,061,000	貸付株式数	1,400株
いちご	84,900	330.00	28,017,000		
エイジア	1,400	2,074.00	2,903,600	貸付株式数	300株
日本駐車場開発	66,200	127.00	8,407,400		
コア	2,800	1,395.00	3,906,000		
カカクコム	47,800	2,929.00	140,006,200	貸付株式数	19,100株
アイロムグループ	2,400	1,815.00	4,356,000	貸付株式数	900株 (100株)
セントケア・ホールディング	4,000	899.00	3,596,000	貸付株式数	1,500株
サイネックス	1,100	738.00	811,800		
ルネサンス	3,500	865.00	3,027,500		
ディップ	9,100	2,434.00	22,149,400	貸付株式数	3,600株

ＳＢＳホールディングス	5,100	2,518.00	12,841,800		
デジタルホールディングス	3,800	1,867.00	7,094,600		
新日本科学	7,100	677.00	4,806,700	貸付株式数	2,700株
ツクイホールディングス	15,200	578.00	8,785,600		
キャリアデザインセンター	1,700	987.00	1,677,900		
ベネフィット・ワン	23,500	3,370.00	79,195,000	貸付株式数	9,400株
エムスリー	142,000	9,622.00	1,366,324,000		
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	4,000	256.00	1,024,000	貸付株式数	1,600株
ブラス	700	400.00	280,000		
アウトソーシング	37,000	1,434.00	53,058,000	貸付株式数	14,800株
ウェルネット	6,600	491.00	3,240,600	貸付株式数	2,600株
ワールドホールディングス	2,300	2,034.00	4,678,200	貸付株式数	100株 (100株)
ディー・エヌ・エー	27,500	1,830.00	50,325,000		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	89,200	1,510.00	134,692,000	貸付株式数	6,900株
ぐるなび	11,300	517.00	5,842,100	貸付株式数	2,000株
タカミヤ	6,700	547.00	3,664,900		
ジャパンベストレスキューＳ	5,000	960.00	4,800,000	貸付株式数	2,000株
ファンコミュニケーションズ	17,800	418.00	7,440,400		
ライク	2,200	2,093.00	4,604,600	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	3,200	421.00	1,347,200	貸付株式数	700株
エスプール	16,600	761.00	12,632,600	貸付株式数	6,600株
ＷＤＢホールディングス	3,000	2,840.00	8,520,000		
手間いらず	400	5,320.00	2,128,000	貸付株式数	100株
ティア	3,600	413.00	1,486,800		
ＣＤＧ	700	1,498.00	1,048,600	貸付株式数	200株 (200株)
バリューコマース	4,100	3,480.00	14,268,000	貸付株式数	100株
インフォマート	65,200	1,071.00	69,829,200	貸付株式数	27,600株
サッポロホールディングス	23,200	1,950.00	45,240,000		
アサヒグループホールディン	147,600	4,037.00	595,861,200	貸付株式数	55,400株
キリンＨＤ	286,400	2,273.50	651,130,400		
宝ホールディングス	50,200	1,199.00	60,189,800	貸付株式数	3,500株
オエノンホールディングス	18,000	411.00	7,398,000		
養　命　酒	2,100	1,879.00	3,945,900	貸付株式数	800株

コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	51,300	1,606.00	82,387,800		
サントリー食品インター	45,200	3,815.00	172,438,000		
ダイドーグループＨＤ	3,500	5,580.00	19,530,000	貸付株式数	1,300株
伊　藤　園	20,600	8,060.00	166,036,000	貸付株式数	8,100株
キーコーヒー	6,700	2,108.00	14,123,600	貸付株式数	2,600株
ユニカフェ	1,600	1,145.00	1,832,000	貸付株式数	600株
ジャパンフーズ	900	1,251.00	1,125,900		
日清オイリオグループ	8,800	2,906.00	25,572,800		
不二製油グループ	16,600	2,796.00	46,413,600	貸付株式数	6,600株
かどや製油	800	3,880.00	3,104,000		
Ｊ－オイルミルズ	3,600	3,560.00	12,816,000		
ローソン	16,800	4,730.00	79,464,000		
サンエー	5,500	4,035.00	22,192,500	貸付株式数	400株
カワチ薬品	5,200	2,998.00	15,589,600	貸付株式数	1,600株
エービーシー・マート	10,300	5,440.00	56,032,000		
ハードオフコーポレーション	2,500	674.00	1,685,000		
高千穂交易	2,500	1,091.00	2,727,500	貸付株式数	300株
アスクル	7,000	4,175.00	29,225,000	貸付株式数	2,600株
ゲオホールディングス	11,900	1,269.00	15,101,100		
アダストリア	9,300	1,700.00	15,810,000		
ジーフット	4,400	436.00	1,918,400	貸付株式数	1,600株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,000	423.00	423,000	貸付株式数	300株
カワニシホールディングス	700	1,424.00	996,800		
伊藤忠食品	1,600	5,620.00	8,992,000		
くら寿司	3,700	5,650.00	20,905,000		
キャンドゥ	3,200	1,842.00	5,894,400	貸付株式数	1,200株
エレマテック	6,200	958.00	5,939,600		
パルグループＨＬＤＧＳ	6,900	1,140.00	7,866,000		
ＪＡＬＵＸ	1,800	1,345.00	2,421,000	貸付株式数	700株
エディオン	30,400	975.00	29,640,000	貸付株式数	12,300株 (400株)
あらた	5,300	4,960.00	26,288,000		
サーラコーポレーション	13,400	564.00	7,557,600	貸付株式数	5,300株
ワッツ	2,800	818.00	2,290,400		
トーメンデバイス	1,000	3,335.00	3,335,000		
ハローズ	2,500	3,460.00	8,650,000	貸付株式数	900株
ＪＰホールディングス	20,200	281.00	5,676,200	貸付株式数	7,800株

フジオフードＧ本社	5,600	1,422.00	7,963,200	貸付株式数	2,200株
あみやき亭	1,400	2,852.00	3,992,800	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,400	3,130.00	7,512,000		
ひらまつ	11,800	184.00	2,171,200	貸付株式数	300株
フィールズ	4,900	372.00	1,822,800		
双日	366,900	229.00	84,020,100		
アルフレッサホールディングス	73,600	2,090.00	153,824,000		
大黒天物産	1,600	5,740.00	9,184,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,800	955.00	5,539,000	貸付株式数	2,200株
ファーマライズＨＤ	1,500	780.00	1,170,000	貸付株式数	600株
キッコーマン	48,600	6,490.00	315,414,000		
味　の　素	149,200	2,180.50	325,330,600		
キユーピー	37,700	2,174.00	81,959,800	貸付株式数	200株
ハウス食品Ｇ本社	25,300	3,600.00	91,080,000		
カ　ゴ　メ	27,500	3,810.00	104,775,000	貸付株式数	1,600株
焼津水産化工	3,200	991.00	3,171,200		
アリアケジャパン	6,200	6,910.00	42,842,000	貸付株式数	1,000株
ピエトロ	800	1,705.00	1,364,000	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,700	2,380.00	4,046,000	貸付株式数	500株
やまみ	600	2,033.00	1,219,800		
ニチレイ	32,300	2,834.00	91,538,200		
横浜冷凍	17,500	850.00	14,875,000		
東洋水産	34,900	5,130.00	179,037,000	貸付株式数	5,100株
イートアンドＨＬＤＧＳ	2,300	1,820.00	4,186,000	貸付株式数	800株
大冷	800	1,982.00	1,585,600		
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	3,800	868.00	3,298,400	貸付株式数	1,300株 (800株)
日清食品ＨＤ	28,800	8,620.00	248,256,000		
永谷園ホールディングス	3,400	2,250.00	7,650,000		
一正蒲鉾	2,600	1,153.00	2,997,800		
フジッコ	7,400	1,959.00	14,496,600		
ロックフィールド	7,300	1,457.00	10,636,100	貸付株式数	500株
日本たばこ産業	361,800	2,120.00	767,016,000	貸付株式数	150,400株
ケンコーマヨネーズ	3,800	1,786.00	6,786,800	貸付株式数	1,300株
わらべや日洋ＨＤ	4,400	1,392.00	6,124,800		
なとり	3,900	1,990.00	7,761,000		
イフジ産業	1,000	826.00	826,000	貸付株式数	100株
ピックルスコーポレーション	1,500	2,924.00	4,386,000		

北の達人コーポ	23,800	509.00	12,114,200	貸付株式数	9,500株
ユーグレナ	29,400	821.00	24,137,400	貸付株式数	11,700株
スター・マイカ・ＨＬＤＧＳ	3,300	1,380.00	4,554,000	貸付株式数	1,300株
ＡＤワークスグループ	14,300	155.00	2,216,500		
片倉工業	8,900	1,368.00	12,175,200	貸付株式数	3,500株
グ　ン　ゼ	4,800	3,600.00	17,280,000		
ヒューリック	140,400	1,057.00	148,402,800	貸付株式数	56,600株
神　栄	1,000	691.00	691,000	貸付株式数	100株
ラサ商事	3,400	902.00	3,066,800		
アルペン	5,100	2,185.00	11,143,500	貸付株式数	2,000株
ハブ	1,900	593.00	1,126,700	貸付株式数	700株
ラクーンホールディングス	3,200	2,175.00	6,960,000	貸付株式数	1,200株
クオールホールディングス	9,800	1,042.00	10,211,600	貸付株式数	3,700株
アルコニックス	7,100	1,379.00	9,790,900		
神戸物産	45,900	3,640.00	167,076,000	貸付株式数	18,400株
ソリトンシステムズ	3,100	2,153.00	6,674,300		
ジンズホールディングス	3,500	7,110.00	24,885,000	貸付株式数	1,400株
ビックカメラ	39,400	1,121.00	44,167,400	貸付株式数	6,900株
ＤＣＭホールディングス	39,800	1,186.00	47,202,800		
ペッパーフードサービス	5,700	282.00	1,607,400	貸付株式数	2,200株 (300株)
ハイパー	900	584.00	525,600		
ＭｏｎｏｔａＲＯ	47,200	6,370.00	300,664,000		
東京一番フーズ	1,500	555.00	832,500	貸付株式数	600株 (600株)
ＤＤホールディングス	2,700	619.00	1,671,300	貸付株式数	1,000株
あい　ホールディングス	9,500	1,947.00	18,496,500	貸付株式数	800株
ディーブイエックス	2,300	1,028.00	2,364,400		
きちりホールディングス	1,700	651.00	1,106,700	貸付株式数	600株
アークランドサービスＨＤ	4,900	2,061.00	10,098,900	貸付株式数	1,900株
Ｊ．　フロント　リテイリング	79,300	837.00	66,374,100	貸付株式数	32,000株
ドトール・日レスＨＤ	9,700	1,443.00	13,997,100	貸付株式数	4,000株
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	27,400	4,885.00	133,849,000		
ブロンコビリー	3,500	2,301.00	8,053,500	貸付株式数	1,400株
ＺＯＺＯ	45,700	2,604.00	119,002,800	貸付株式数	15,100株
トレジャー・ファクトリー	2,000	693.00	1,386,000	貸付株式数	400株
物語コーポレーション	1,800	11,530.00	20,754,000	貸付株式数	700株 (100株)

ココカラファイン	6,900	7,590.00	52,371,000		
三越伊勢丹ＨＤ	116,400	561.00	65,300,400	貸付株式数	42,000株
東洋紡	26,200	1,305.00	34,191,000		
ユニチカ	19,800	378.00	7,484,400	貸付株式数	7,900株
富士紡ホールディングス	3,200	3,605.00	11,536,000		
日清紡ホールディングス	40,900	740.00	30,266,000		
倉敷紡績	6,600	1,842.00	12,157,200	貸付株式数	1,200株
ダイワボウＨＤ	5,700	6,520.00	37,164,000		
シキボウ	4,000	1,041.00	4,164,000	貸付株式数	400株
日東紡績	10,100	4,250.00	42,925,000	貸付株式数	3,100株
トヨタ紡織	19,500	1,370.00	26,715,000		
マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	15,800	2,067.00	32,658,600	貸付株式数	4,900株
Ｈａｍｅｅ	2,400	1,763.00	4,231,200	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	2,600	2,943.00	7,651,800	貸付株式数	1,000株
ウエルシアＨＤ	39,500	4,195.00	165,702,500	貸付株式数	10,600株
クリエイトＳＤＨ	11,200	3,710.00	41,552,000		
バイタルＫＳＫＨＤ	12,700	861.00	10,934,700		
八洲電機	5,100	942.00	4,804,200	貸付株式数	100株
メディアスホールディングス	3,700	901.00	3,333,700		
レスターホールディングス	6,900	2,242.00	15,469,800		
ジューテックＨＤ	1,300	1,014.00	1,318,200	貸付株式数	100株
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	7,200	360.00	2,592,000	貸付株式数	2,800株
大光	2,800	680.00	1,904,000	貸付株式数	1,100株
ＯＣＨＩホールディングス	1,900	1,305.00	2,479,500	貸付株式数	100株
ＴＯＫＡＩホールディングス	34,900	991.00	34,585,900		
黒谷	1,600	621.00	993,600		
ミサワ	1,600	812.00	1,299,200		
ティーライフ	900	1,330.00	1,197,000		
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,100	774.00	851,400	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,500	412.00	618,000	貸付株式数	400株
三洋貿易	6,700	1,019.00	6,827,300		
チムニー	2,000	1,231.00	2,462,000	貸付株式数	400株
シュッピン	4,600	833.00	3,831,800		
ビューティガレージ	1,100	3,050.00	3,355,000	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	6,600	3,225.00	21,285,000	貸付株式数	2,600株
ウイン・パートナーズ	4,700	1,145.00	5,381,500		

ネクステージ	10,500	1,388.00	14,574,000		
ジョイフル本田	19,400	1,453.00	28,188,200	貸付株式数	7,400株
鳥貴族	2,200	1,372.00	3,018,400	貸付株式数	700株
キリン堂ホールディングス	1,300	3,485.00	4,530,500		
ホットランド	4,500	1,252.00	5,634,000	貸付株式数	1,800株
すかいらーくＨＤ	74,400	1,581.00	117,626,400	貸付株式数	29,900株 (2,800株)
ＳＦＰホールディングス	3,800	1,274.00	4,841,200	貸付株式数	1,500株
綿半ホールディングス	5,000	1,375.00	6,875,000	貸付株式数	300株
日本毛織	21,300	1,056.00	22,492,800	貸付株式数	5,700株
ダイトウボウ	12,100	115.00	1,391,500	貸付株式数	4,300株
トーア紡コーポレーション	2,600	488.00	1,268,800	貸付株式数	1,000株
ダイドーリミテツド	9,700	197.00	1,910,900	貸付株式数	2,700株
ヨシックス	1,100	1,732.00	1,905,200		
ユナイテッド・スーパーマーケ	19,300	1,081.00	20,863,300	貸付株式数	7,700株
三栄建築設計	2,700	1,735.00	4,684,500		
野村不動産ＨＬＤＧＳ	40,200	2,260.00	90,852,000		
三重交通グループＨＤ	13,100	467.00	6,117,700	貸付株式数	3,500株
サムティ	9,500	1,654.00	15,713,000	貸付株式数	3,800株
日本商業開発	4,500	1,712.00	7,704,000	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーション	11,000	1,754.00	19,294,000	貸付株式数	4,300株
フィル・カンパニー	1,200	2,062.00	2,474,400	貸付株式数	400株
ハウスコム	900	1,295.00	1,165,500		
日本管理センター	3,800	1,301.00	4,943,800		
サンセイランディック	2,500	735.00	1,837,500		
エストラスト	1,400	726.00	1,016,400	貸付株式数	300株
フージャースＨＤ	13,300	674.00	8,964,200	貸付株式数	600株
オープンハウス	20,700	4,135.00	85,594,500		
東急不動産ＨＤ	180,200	506.00	91,181,200		
飯田ＧＨＤ	55,200	2,098.00	115,809,600	貸付株式数	8,700株
イーグランド	1,000	782.00	782,000		
帝国繊維	7,500	2,573.00	19,297,500	貸付株式数	2,900株
日本コークス工業	56,000	71.00	3,976,000		
ゴルフダイジェスト・オン	2,900	925.00	2,682,500	貸付株式数	1,100株
ミタチ産業	2,000	602.00	1,204,000	貸付株式数	600株
ＢＥＥＮＯＳ	3,000	2,535.00	7,605,000	貸付株式数	200株
あさひ	5,000	1,559.00	7,795,000	貸付株式数	1,900株

日本調剤	4,100	1,515.00	6,211,500		
コスモス薬品	5,900	18,000.00	106,200,000	貸付株式数	2,000株
シップヘルスケアＨＤ	10,700	5,200.00	55,640,000	貸付株式数	4,200株
トーエル	3,200	768.00	2,457,600	貸付株式数	1,100株
ソフトクリエイトＨＤ	2,900	3,185.00	9,236,500	貸付株式数	1,100株
オンリー	1,100	465.00	511,500	貸付株式数	300株
セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ	259,200	3,313.00	858,729,600		
クリエイト・レストランツ・ホール	36,000	551.00	19,836,000	貸付株式数	14,400株 (800株)
明治電機工業	2,100	1,414.00	2,969,400		
ツルハホールディングス	14,500	15,280.00	221,560,000		
デリカフーズＨＬＤＧＳ	2,200	609.00	1,339,800		
スターティアホールディングス	1,700	726.00	1,234,200	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,300	1,437.00	7,616,100		
フェリシモ	1,400	1,358.00	1,901,200	貸付株式数	400株
トリドールホールディングス	16,500	1,402.00	23,133,000	貸付株式数	6,100株 (4,500株)
帝　人	53,600	1,784.00	95,622,400		
東　レ	476,400	566.10	269,690,040		
ク　ラ　レ	103,600	1,036.00	107,329,600		
旭　化　成	436,400	957.10	417,678,440	貸付株式数	5,600株
サカイオーベックス	1,700	2,039.00	3,466,300		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	6,000	487.00	2,922,000	貸付株式数	2,400株
稲葉製作所	3,700	1,362.00	5,039,400	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングＧ	2,000	2,160.00	4,320,000	貸付株式数	700株
トーカロ	18,600	1,245.00	23,157,000		
アルファＣＯ	2,200	970.00	2,134,000		
ＳＵＭＣＯ	84,300	2,114.00	178,210,200	貸付株式数	33,700株
川田テクノロジーズ	1,400	4,215.00	5,901,000		
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	1,900	4,465.00	8,483,500	貸付株式数	700株
信和	3,600	684.00	2,462,400		
ビーロット	3,400	830.00	2,822,000		
ファーストブラザーズ	1,500	945.00	1,417,500	貸付株式数	500株
ハウスドゥ	3,500	1,183.00	4,140,500	貸付株式数	1,300株
シーアールイー	1,800	1,315.00	2,367,000	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	1,100	1,574.00	1,731,400		
ケイアイスター不動産	2,200	2,539.00	5,585,800		

アグレ都市デザイン	1,700	645.00	1,096,500	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,300	3,265.00	4,244,500		
テンポイノベーション	1,700	844.00	1,434,800	貸付株式数	600株
グロバルリンクマネジメント	1,400	828.00	1,159,200	貸付株式数	400株
住江織物	1,400	2,178.00	3,049,200	貸付株式数	400株
日本フエルト	3,500	455.00	1,592,500		
イチカワ	900	1,347.00	1,212,300		
エコナックホールディングス	13,500	90.00	1,215,000		
日東製網	800	1,483.00	1,186,400	貸付株式数	200株
芦森工業	1,300	982.00	1,276,600	貸付株式数	500株
アツギ	5,300	525.00	2,782,500		
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	1,100	674.00	741,400		
ＪＭホールディングス	5,100	2,435.00	12,418,500	貸付株式数	1,300株
コメダホールディングス	14,600	1,860.00	27,156,000	貸付株式数	5,600株
サツドラホールディングス	900	2,020.00	1,818,000		
アレンザホールディングス	3,300	1,382.00	4,560,600	貸付株式数	300株 (300株)
串カツ田中ＨＬＤＧＳ	1,300	1,600.00	2,080,000	貸付株式数	500株 (400株)
バロックジャパン	4,600	673.00	3,095,800		
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	6,000	8,700.00	52,200,000	貸付株式数	2,300株
ダイニック	2,400	871.00	2,090,400		
共和レザー	3,600	605.00	2,178,000		
ピーバンドットコム	600	912.00	547,200		
力の源ＨＤ	3,000	588.00	1,764,000	貸付株式数	100株
スシローグローバルＨＬＤＧＳ	36,500	3,320.00	121,180,000		
アセンテック	1,400	1,938.00	2,713,200	貸付株式数	500株
セーレン	16,300	1,526.00	24,873,800	貸付株式数	5,600株
ソトー	2,400	926.00	2,222,400	貸付株式数	200株
東海染工	900	1,112.00	1,000,800	貸付株式数	200株
小松マテーレ	10,800	953.00	10,292,400		
ワコールホールディングス	16,400	2,001.00	32,816,400		
ホギメディカル	7,500	3,160.00	23,700,000		
クラウディアＨＬＤＧＳ	1,700	302.00	513,400	貸付株式数	600株
ＴＳＩホールディングス	20,900	201.00	4,200,900		
マツオカコーポレーション	1,900	2,532.00	4,810,800	貸付株式数	700株
ワールド	9,400	1,282.00	12,050,800		

ＴＩＳ	66,100	2,078.00	137,355,800		
ＪＮＳホールディングス	2,800	607.00	1,699,600		
電算システム	2,500	3,325.00	8,312,500	貸付株式数	900株
グリー	40,900	585.00	23,926,500		
コーエーテクモＨＤ	13,600	5,550.00	75,480,000		
三菱総合研究所	2,800	4,160.00	11,648,000		
ボルテージ	1,900	554.00	1,052,600	貸付株式数	600株
電算	700	2,412.00	1,688,400		
ＡＧＳ	3,700	862.00	3,189,400		
ファインデックス	5,700	1,362.00	7,763,400	貸付株式数	2,100株
ブレインパッド	1,700	4,275.00	7,267,500	貸付株式数	100株
ＫＬａｂ	12,200	1,018.00	12,419,600		
ポールトゥウィン・ピットクル	8,000	960.00	7,680,000	貸付株式数	3,200株
イーブックイニシアティブ	900	2,921.00	2,628,900	貸付株式数	300株
ネクソン	166,700	3,155.00	525,938,500		
アイスタイル	18,400	453.00	8,335,200	貸付株式数	7,300株
エムアップホールディングス	1,900	2,629.00	4,995,100	貸付株式数	700株
エイチーム	4,500	977.00	4,396,500	貸付株式数	1,800株
エニグモ	6,300	1,325.00	8,347,500		
テクノスジャパン	5,300	759.00	4,022,700		
ｅｎｉｓｈ	3,500	473.00	1,655,500	貸付株式数	200株
コロプラ	21,700	914.00	19,833,800	貸付株式数	8,700株 (8,700株)
オルトプラス	4,400	442.00	1,944,800	貸付株式数	1,500株
ブロードリーフ	32,900	648.00	21,319,200	貸付株式数	13,100株
クロス・マーケティングＧ	3,200	354.00	1,132,800		
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	3,700	1,185.00	4,384,500	貸付株式数	1,400株
システム情報	4,900	1,170.00	5,733,000	貸付株式数	1,900株
メディアドゥ	2,100	7,500.00	15,750,000	貸付株式数	800株
じげん	16,500	327.00	5,395,500		
ブイキューブ	3,600	3,370.00	12,132,000	貸付株式数	1,400株
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	779.00	1,012,700	貸付株式数	500株
サイバーリンクス	1,200	6,670.00	8,004,000	貸付株式数	400株
ディー・エル・イー	4,300	346.00	1,487,800		
フィックスターズ	7,100	1,039.00	7,376,900	貸付株式数	2,700株
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,900	1,274.00	3,694,600	貸付株式数	1,200株
オプティム	3,500	3,080.00	10,780,000	貸付株式数	1,300株

セレス	2,300	2,817.00	6,479,100	貸付株式数	800株
ＳＨＩＦＴ	2,700	15,470.00	41,769,000	貸付株式数	1,000株
特種東海製紙	4,100	5,350.00	21,935,000	貸付株式数	300株
ティーガイア	5,900	1,839.00	10,850,100		
セック	1,000	3,030.00	3,030,000		
日本アジアグループ	7,300	835.00	6,095,500	貸付株式数	2,900株
テクマトリックス	9,400	2,296.00	21,582,400		
プロシップ	1,900	1,423.00	2,703,700	貸付株式数	700株
ガンホー・オンライン・エンター	16,000	2,653.00	42,448,000		
GMOペイメントゲートウェイ	14,000	14,640.00	204,960,000	貸付株式数	3,700株
ザッパラス	2,900	484.00	1,403,600	貸付株式数	1,300株
システムリサーチ	1,800	1,634.00	2,941,200	貸付株式数	300株
インターネットイニシアティブ	9,900	4,975.00	49,252,500		
さくらインターネット	7,000	736.00	5,152,000	貸付株式数	2,800株
ヴィンクス	1,900	1,245.00	2,365,500	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインHD	1,400	10,320.00	14,448,000	貸付株式数	500株 (400株)
ＳＲＡホールディングス	3,500	2,480.00	8,680,000		
システムインテグレータ	2,300	664.00	1,527,200	貸付株式数	800株
朝日ネット	4,700	877.00	4,121,900		
ｅＢＡＳＥ	8,000	1,059.00	8,472,000	貸付株式数	3,100株
アバント	6,300	1,105.00	6,961,500	貸付株式数	2,500株
アドソル日進	2,400	2,958.00	7,099,200		
フリービット	3,700	920.00	3,404,000	貸付株式数	1,300株
コムチュア	7,500	3,230.00	24,225,000		
サイバーコム	1,200	1,769.00	2,122,800	貸付株式数	400株
アステリア	4,400	1,095.00	4,818,000	貸付株式数	1,600株
アイル	3,700	1,428.00	5,283,600	貸付株式数	1,400株
王子ホールディングス	275,600	474.00	130,634,400		
日本製紙	29,300	1,125.00	32,962,500	貸付株式数	11,700株
三菱製紙	7,300	321.00	2,343,300		
北越コーポレーション	39,900	351.00	14,004,900		
中越パルプ	2,800	1,347.00	3,771,600		
巴川製紙	2,100	885.00	1,858,500		
大王製紙	30,500	1,806.00	55,083,000	貸付株式数	200株
阿波製紙	2,000	452.00	904,000		
マークラインズ	3,000	2,717.00	8,151,000		

メディカル・データ・ビジ	7,400	3,120.00	23,088,000	貸付株式数	2,900株
ｇｕｍｉ	8,600	868.00	7,464,800		
ショーケース	1,600	750.00	1,200,000	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,600	993.00	1,588,800	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,400	4,890.00	11,736,000	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメーション	2,900	1,509.00	4,376,100	貸付株式数	1,000株
ＰＣＩホールディングス	2,800	1,320.00	3,696,000	貸付株式数	1,000株
パイプドＨＤ	900	1,697.00	1,527,300	貸付株式数	200株 (200株)
アイビーシー	1,400	1,191.00	1,667,400	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,200	2,756.00	3,307,200		
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,200	3,550.00	4,260,000	貸付株式数	400株
ランドコンピュータ	1,000	1,126.00	1,126,000	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	900	4,425.00	3,982,500		
オープンドア	3,400	1,261.00	4,287,400	貸付株式数	1,300株
マイネット	2,100	961.00	2,018,100	貸付株式数	800株
アカツキ	2,400	4,485.00	10,764,000	貸付株式数	900株
ベネフィットジャパン	500	2,074.00	1,037,000		
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	1,600	3,580.00	5,728,000		
ＬＩＮＥ	15,300	5,380.00	82,314,000		
カナミックネットワーク	6,000	814.00	4,884,000		
ノムラシステムコーポレーション	3,400	387.00	1,315,800	貸付株式数	1,100株
レンゴー	62,500	795.00	49,687,500		
トーモク	4,100	1,730.00	7,093,000	貸付株式数	1,100株
ザ・パック	5,000	2,892.00	14,460,000	貸付株式数	800株
チェンジ	4,600	8,100.00	37,260,000		
シンクロ・フード	2,700	310.00	837,000	貸付株式数	400株
オークネット	3,600	1,369.00	4,928,400	貸付株式数	1,400株
セグエグループ	1,300	1,357.00	1,764,100		
エイトレッド	1,100	2,799.00	3,078,900	貸付株式数	100株
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,700	417.00	2,793,900	貸付株式数	2,600株
マクロミル	13,500	650.00	8,775,000	貸付株式数	5,200株
ビーグリー	1,300	1,970.00	2,561,000	貸付株式数	500株
オロ	1,900	3,890.00	7,391,000	貸付株式数	700株
ユーザーローカル	600	4,045.00	2,427,000		
テモナ	1,300	1,377.00	1,790,100	貸付株式数	500株

ニーズウェル	1,000	753.00	753,000	貸付株式数	100株
サインポスト	1,300	988.00	1,284,400	貸付株式数	500株
昭和電工	49,800	1,937.00	96,462,600		
住友化学	482,900	370.00	178,673,000		
住友精化	3,000	4,150.00	12,450,000		
日産化学	36,400	6,240.00	227,136,000		
ラサ工業	2,300	1,999.00	4,597,700	貸付株式数	800株
クレハ	5,600	5,300.00	29,680,000		
多木化学	2,600	6,650.00	17,290,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,900	1,463.00	7,168,700		
石原産業	11,900	576.00	6,854,400		
片倉コープアグリ	1,600	1,247.00	1,995,200		
日本曹達	9,800	2,747.00	26,920,600		
東ソー	101,800	1,646.00	167,562,800		
トクヤマ	19,000	2,217.00	42,123,000		
セントラル硝子	13,400	2,224.00	29,801,600	貸付株式数	400株
東亞合成	41,100	1,250.00	51,375,000	貸付株式数	900株
大阪ソーダ	6,700	2,447.00	16,394,900		
関東電化	15,800	702.00	11,091,600		
デンカ	24,100	3,230.00	77,843,000		
イビデン	41,300	4,890.00	201,957,000		
信越化学	113,100	17,135.00	1,937,968,500		
日本カーバイド	2,100	1,309.00	2,748,900		
堺　化　学	4,200	1,943.00	8,160,600		
第一稀元素化学工	7,100	697.00	4,948,700		
エア・ウォーター	61,300	1,721.00	105,497,300		
日本酸素ＨＬＤＧＳ	63,300	1,744.00	110,395,200	貸付株式数	25,400株
日本化学工業	2,100	2,554.00	5,363,400		
東邦アセチレン	800	1,231.00	984,800		
日本パーカライジング	33,000	1,095.00	36,135,000	貸付株式数	5,500株
高圧ガス	10,400	757.00	7,872,800		
チタン工業	900	1,947.00	1,752,300	貸付株式数	300株
四国化成	9,600	1,192.00	11,443,200		
戸田工業	1,500	2,185.00	3,277,500	貸付株式数	500株
ステラ　ケミファ	3,600	3,350.00	12,060,000	貸付株式数	1,400株 (100株)
保土谷化学	2,500	4,605.00	11,512,500		
日本触媒	10,200	5,220.00	53,244,000		
大日精化	5,800	2,388.00	13,850,400		
カネカ	17,100	3,140.00	53,694,000		

協和キリン	67,600	2,835.00	191,646,000		
三菱瓦斯化学	61,400	2,214.00	135,939,600		
三井化学	61,100	2,933.00	179,206,300		
ＪＳＲ	61,500	2,885.00	177,427,500		
東京応化工業	11,400	6,580.00	75,012,000	貸付株式数	3,600株 (100株)
大阪有機化学	6,100	2,899.00	17,683,900		
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	439,800	577.50	253,984,500		
ＫＨネオケム	10,900	2,787.00	30,378,300		
ダイセル	82,400	734.00	60,481,600	貸付株式数	28,100株
住友ベークライト	10,400	3,220.00	33,488,000		
積水化学	139,000	1,803.00	250,617,000		
日本ゼオン	59,600	1,293.00	77,062,800		
アイカ工業	19,800	3,690.00	73,062,000		
宇部興産	33,200	1,775.00	58,930,000		
積水樹脂	11,800	2,190.00	25,842,000	貸付株式数	2,200株
タキロンシーアイ	14,000	708.00	9,912,000		
旭有機材	3,800	1,457.00	5,536,600		
ニチバン	3,500	1,621.00	5,673,500	貸付株式数	100株
リケンテクノス	16,400	446.00	7,314,400	貸付株式数	2,800株
大倉工業	3,100	1,877.00	5,818,700	貸付株式数	900株
積水化成品	8,900	538.00	4,788,200		
群栄化学	1,400	2,533.00	3,546,200		
タイガース　ポリマー	3,400	422.00	1,434,800		
ミライアル	2,300	1,211.00	2,785,300	貸付株式数	800株
ダイキアクシス	2,400	1,047.00	2,512,800	貸付株式数	800株
ダイキョーニシカワ	13,800	685.00	9,453,000	貸付株式数	5,100株
竹本容器	2,200	983.00	2,162,600	貸付株式数	800株
森六ホールディングス	3,600	1,989.00	7,160,400		
日本化薬	41,000	917.00	37,597,000		
カーリットホールディングス	6,900	600.00	4,140,000	貸付株式数	2,700株
ＥＰＳホールディングス	8,800	959.00	8,439,200		
ソルクシーズ	2,900	1,056.00	3,062,400	貸付株式数	1,000株
レッグス	1,700	1,493.00	2,538,100	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	24,300	962.00	23,376,600		
フェイス	2,300	798.00	1,835,400		
プロトコーポレーション	6,000	1,053.00	6,318,000		
ハイマックス	1,600	1,158.00	1,852,800		
アミューズ	3,500	2,575.00	9,012,500		

野村総合研究所	93,500	3,525.00	329,587,500		
ドリームインキュベータ	1,900	1,451.00	2,756,900		
サイバネットシステム	5,100	968.00	4,936,800		
クイック	3,900	1,125.00	4,387,500	貸付株式数	600株
ＴＡＣ	4,400	219.00	963,600		
ＣＥホールディングス	4,000	601.00	2,404,000	貸付株式数	900株
ケネディクス	55,800	759.00	42,352,200		
日本システム技術	1,200	1,588.00	1,905,600		
電通グループ	72,200	3,400.00	245,480,000	貸付株式数	28,800株
インテージホールディングス	8,300	1,035.00	8,590,500	貸付株式数	3,300株
テイクアンドギヴニーズ	2,400	576.00	1,382,400	貸付株式数	900株
東邦システムサイエンス	1,700	932.00	1,584,400		
ぴあ	1,800	2,715.00	4,887,000	貸付株式数	700株
イオンファンタジー	2,500	2,200.00	5,500,000	貸付株式数	700株
ソースネクスト	31,600	313.00	9,890,800	貸付株式数	9,200株
シーティーエス	7,300	940.00	6,862,000	貸付株式数	2,900株
ネクシィーズグループ	2,200	858.00	1,887,600	貸付株式数	800株
インフォコム	7,300	3,660.00	26,718,000		
メディカルシステムネットワーク	6,400	626.00	4,006,400		
日本精化	5,400	1,453.00	7,846,200	貸付株式数	1,100株
扶桑化学工業	6,700	3,455.00	23,148,500		
トリケミカル	1,500	14,110.00	21,165,000		
ＨＥＲＯＺ	900	2,908.00	2,617,200	貸付株式数	300株 (300株)
ラクスル	5,300	5,070.00	26,871,000	貸付株式数	2,100株
ＦＩＧ	7,700	273.00	2,102,100	貸付株式数	2,800株
システムサポート	1,400	1,487.00	2,081,800	貸付株式数	200株
ＡＤＥＫＡ	30,300	1,658.00	50,237,400		
日油	24,800	4,630.00	114,824,000	貸付株式数	300株
ミヨシ油脂	2,500	1,233.00	3,082,500		
新日本理化	10,700	166.00	1,776,200	貸付株式数	2,100株
ハリマ化成グループ	5,500	1,022.00	5,621,000	貸付株式数	1,200株
イーソル	3,100	1,416.00	4,389,600	貸付株式数	1,200株
アルテリア・ネットワークス	7,400	1,591.00	11,773,400		
東海ソフト	400	1,117.00	446,800	貸付株式数	100株
ヒト・コミュニケーションズＨＤ	1,300	1,500.00	1,950,000		

トビラシステムズ	800	1,728.00	1,382,400		
花　王	161,000	7,808.00	1,257,088,000		
第一工業製薬	2,500	4,510.00	11,275,000	貸付株式数	900株
石原ケミカル	1,800	2,097.00	3,774,600	貸付株式数	700株
日華化学	2,200	959.00	2,109,800	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	3,110.00	4,354,000	貸付株式数	500株
三洋化成	3,900	4,480.00	17,472,000		
武田薬品	559,600	3,745.00	2,095,702,000		
アステラス製薬	583,100	1,483.50	865,028,850		
大日本住友製薬	49,700	1,323.00	65,753,100		
塩野義製薬	84,600	5,593.00	473,167,800		
わかもと製薬	8,500	273.00	2,320,500		
あすか製薬	7,700	1,704.00	13,120,800		
日本新薬	17,600	7,460.00	131,296,000		
ビオフエルミン製薬	1,200	2,401.00	2,881,200		
中外製薬	210,400	5,044.00	1,061,257,600		
科研製薬	11,600	3,810.00	44,196,000		
エーザイ	80,600	7,887.00	635,692,200	貸付株式数	32,400株
理研ビタミン	6,500	1,332.00	8,658,000		
ロート製薬	34,600	3,425.00	118,505,000		
小野薬品	154,500	3,303.00	510,313,500		
久光製薬	17,700	6,120.00	108,324,000		
有機合成薬品	5,900	306.00	1,805,400	貸付株式数	2,000株
持田製薬	9,300	4,010.00	37,293,000		
参天製薬	125,600	1,735.00	217,916,000	貸付株式数	19,900株
扶桑薬品	2,400	2,833.00	6,799,200		
日本ケミファ	900	2,470.00	2,223,000		
ツムラ	20,800	3,045.00	63,336,000		
日医工	19,200	1,000.00	19,200,000	貸付株式数	7,600株
テ　ル　モ	190,300	4,147.00	789,174,100		
ＨＵグループＨＤ	18,100	2,826.00	51,150,600		
キッセイ薬品工業	11,800	2,090.00	24,662,000		
生化学工業	13,000	993.00	12,909,000		
栄研化学	11,900	1,937.00	23,050,300		
日水製薬	2,800	989.00	2,769,200		
鳥居薬品	4,200	3,165.00	13,293,000		
ＪＣＲファーマ	19,100	2,720.00	51,952,000		
東和薬品	8,600	1,901.00	16,348,600		
富士製薬工業	4,600	1,248.00	5,740,800	貸付株式数	900株
沢井製薬	13,800	4,715.00	65,067,000		

ゼリア新薬工業	12,100	1,868.00	22,602,800	貸付株式数	2,900株
第一三共	577,500	3,694.00	2,133,285,000		
キョーリン製薬ＨＤ	15,000	1,877.00	28,155,000	貸付株式数	100株
大幸薬品	8,300	1,685.00	13,985,500	貸付株式数	3,300株
ダイト	4,200	3,620.00	15,204,000		
大塚ホールディングス	139,700	4,242.00	592,607,400	貸付株式数	3,100株
大正製薬ＨＤ	14,100	6,640.00	93,624,000		
ペプチドリーム	34,200	5,320.00	181,944,000	貸付株式数	13,800株
大日本塗料	7,500	923.00	6,922,500		
日本ペイントＨＯＬＤ	54,400	13,370.00	727,328,000		
関西ペイント	74,000	3,165.00	234,210,000	貸付株式数	29,800株
神東塗料	6,800	181.00	1,230,800	貸付株式数	2,000株
中国塗料	18,800	994.00	18,687,200		
日本特殊塗料	5,000	1,145.00	5,725,000		
藤倉化成	8,900	507.00	4,512,300		
太陽ホールディングス	4,900	6,410.00	31,409,000		
ＤＩＣ	27,800	2,567.00	71,362,600	貸付株式数	10,800株
サカタインクス	14,400	1,158.00	16,675,200	貸付株式数	5,800株
東洋インキＳＣホールディン	13,700	1,961.00	26,865,700		
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5,000	860.00	4,300,000	貸付株式数	1,900株
アルプス技研	5,700	2,095.00	11,941,500		
サニックス	11,400	278.00	3,169,200	貸付株式数	4,500株
ダイオーズ	1,200	943.00	1,131,600	貸付株式数	400株
日本空調サービス	6,800	762.00	5,181,600		
オリエンタルランド	68,400	17,765.00	1,215,126,000	貸付株式数	4,900株
フォーカスシステムズ	4,200	903.00	3,792,600	貸付株式数	1,600株
ダスキン	15,900	2,774.00	44,106,600	貸付株式数	2,600株
パーク２４	35,800	1,556.00	55,704,800	貸付株式数	14,300株
明光ネットワークジャパン	8,100	528.00	4,276,800	貸付株式数	3,200株
ファルコホールディングス	3,500	1,587.00	5,554,500		
クレスコ	4,000	1,280.00	5,120,000		
フジ・メディア・ＨＤ	63,500	1,087.00	69,024,500		
秀英予備校	1,400	420.00	588,000	貸付株式数	500株
田谷	1,200	547.00	656,400	貸付株式数	400株
ラウンドワン	18,100	859.00	15,547,900	貸付株式数	7,200株
リゾートトラスト	29,600	1,628.00	48,188,800		
オービック	22,900	23,470.00	537,463,000		
ジャストシステム	10,800	7,030.00	75,924,000		
ＴＤＣソフト	5,900	1,044.00	6,159,600		

Ｚホールディングス	908,800	657.00	597,081,600		
ビー・エム・エル	8,300	3,280.00	27,224,000		
ワタベウェディング	1,000	289.00	289,000	貸付株式数	300株
トレンドマイクロ	35,200	5,670.00	199,584,000		
りらいあコミュニケーショ	11,400	1,234.00	14,067,600	貸付株式数	4,400株
ＩＤホールディングス	2,500	1,224.00	3,060,000		
リソー教育	29,600	315.00	9,324,000		
日本オラクル	13,400	11,570.00	155,038,000		
早稲田アカデミー	2,800	953.00	2,668,400		
アルファシステムズ	2,100	3,520.00	7,392,000	貸付株式数	800株
フューチャー	8,000	1,777.00	14,216,000		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,400	1,470.00	6,468,000		
ＳＢテクノロジー	2,400	3,620.00	8,688,000		
トーセ	1,800	872.00	1,569,600	貸付株式数	300株
ユー・エス・エス	71,800	2,184.00	156,811,200		
オービックビジネスＣ	6,700	7,400.00	49,580,000		
伊藤忠テクノソリュー	30,100	3,685.00	110,918,500		
アイティフォー	8,100	921.00	7,460,100	貸付株式数	200株
東京個別指導学院	2,300	613.00	1,409,900		
東計電算	1,000	4,355.00	4,355,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	39,800	7,150.00	284,570,000	貸付株式数	15,900株
楽天	300,700	1,169.00	351,518,300		
エックスネット	1,100	981.00	1,079,100		
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,034.00	3,515,600		
テー・オー・ダブリュー	10,400	280.00	2,912,000		
大塚商会	35,700	5,060.00	180,642,000		
サイボウズ	7,800	2,870.00	22,386,000	貸付株式数	3,100株
山田コンサルティンググループ	4,100	970.00	3,977,000		
セントラルスポーツ	2,400	2,150.00	5,160,000	貸付株式数	300株
パラカ	1,700	1,642.00	2,791,400	貸付株式数	600株
電通国際情報Ｓ	4,100	6,990.00	28,659,000		
ＡＣＣＥＳＳ	6,100	820.00	5,002,000	貸付株式数	2,400株
デジタルガレージ	11,900	4,225.00	50,277,500	貸付株式数	4,700株
イーエムシステムズ	9,300	820.00	7,626,000	貸付株式数	3,600株
ウェザーニューズ	2,300	5,600.00	12,880,000	貸付株式数	800株
ＣＩＪ	4,700	973.00	4,573,100		
ビジネスエンジニアリング	800	3,465.00	2,772,000	貸付株式数	200株
日本エンタープライズ	7,300	224.00	1,635,200	貸付株式数	2,800株
WOWOW	3,200	2,837.00	9,078,400	貸付株式数	800株

スカラ	4,600	865.00	3,979,000	貸付株式数	1,800株 (100株)
インテリジェント　ウェイブ	3,700	710.00	2,627,000		
フルキャストホールディングス	5,800	1,693.00	9,819,400	貸付株式数	2,400株
エン・ジャパン	11,500	3,250.00	37,375,000	貸付株式数	2,200株
富士フイルムＨＬＤＧＳ	129,000	5,625.00	725,625,000		
コニカミノルタ	148,300	334.00	49,532,200		
資　生　堂	133,700	7,360.00	984,032,000		
ライオン	87,500	2,468.00	215,950,000	貸付株式数	7,000株
高砂香料	4,200	2,520.00	10,584,000		
マンダム	15,300	1,637.00	25,046,100	貸付株式数	6,100株
ミルボン	9,000	5,960.00	53,640,000	貸付株式数	200株
ファンケル	27,300	4,235.00	115,615,500	貸付株式数	11,000株
コーセー	12,700	15,940.00	202,438,000	貸付株式数	4,600株
コタ	3,900	1,359.00	5,300,100		
シーボン	800	1,972.00	1,577,600		
ポーラ・オルビスＨＤ	28,800	2,085.00	60,048,000	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	5,700	4,295.00	24,481,500		
アジュバンコスメジャパン	1,400	1,018.00	1,425,200		
エステー	4,400	2,037.00	8,962,800		
アグロカネショウ	2,600	1,745.00	4,537,000	貸付株式数	1,000株
コ　ニ　シ	11,000	1,592.00	17,512,000		
長谷川香料	11,700	2,012.00	23,540,400	貸付株式数	4,000株
星光ＰＭＣ	3,800	718.00	2,728,400		
小林製薬	18,900	12,550.00	237,195,000	貸付株式数	2,800株
荒川化学工業	6,000	1,120.00	6,720,000		
メック	4,600	2,279.00	10,483,400	貸付株式数	1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,695.00	4,851,000	貸付株式数	400株
タカラバイオ	17,700	2,973.00	52,622,100	貸付株式数	7,100株
ＪＣＵ	8,200	3,685.00	30,217,000		
新田ゼラチン	4,000	702.00	2,808,000	貸付株式数	200株
ＯＡＴアグリオ	1,200	1,422.00	1,706,400	貸付株式数	200株
デクセリアルズ	17,600	1,275.00	22,440,000		
アース製薬	4,800	6,150.00	29,520,000	貸付株式数	1,900株
北興化学	6,500	1,124.00	7,306,000	貸付株式数	2,600株
大成ラミック	2,200	2,904.00	6,388,800		
クミアイ化学	28,000	1,021.00	28,588,000	貸付株式数	11,200株

日本農薬	12,000	531.00	6,372,000	貸付株式数	1,900株
富士興産	2,200	920.00	2,024,000	貸付株式数	400株
ニチレキ	8,000	1,636.00	13,088,000		
ユシロ化学	3,700	1,164.00	4,306,800		
ビーピー・カストロール	2,400	1,266.00	3,038,400	貸付株式数	900株
富士石油	17,700	184.00	3,256,800		
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,300	1,011.00	2,325,300	貸付株式数	900株
出光興産	74,700	2,174.00	162,397,800		
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,011,500	358.50	362,622,750		
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	19,600	1,774.00	34,770,400	貸付株式数	2,300株
横浜ゴム	39,000	1,523.00	59,397,000		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	35,500	1,647.00	58,468,500	貸付株式数	1,200株
ブリヂストン	178,700	3,644.00	651,182,800	貸付株式数	800株
住友ゴム	60,500	923.00	55,841,500	貸付株式数	1,000株
藤倉コンポジット	6,200	386.00	2,393,200		
オカモト	4,100	4,075.00	16,707,500		
アキレス	4,700	1,424.00	6,692,800		
フ　コ　ク	3,000	697.00	2,091,000	貸付株式数	1,100株
ニッタ	7,600	2,206.00	16,765,600		
クリエートメディック	2,100	962.00	2,020,200		
住友理工	12,800	513.00	6,566,400		
三ツ星ベルト	8,800	1,631.00	14,352,800		
バンドー化学	11,800	576.00	6,796,800		
ＡＧＣ	61,800	3,475.00	214,755,000	貸付株式数	12,500株
日本板硝子	32,300	401.00	12,952,300	貸付株式数	12,900株
石塚硝子	1,200	1,917.00	2,300,400		
有沢製作所	10,700	917.00	9,811,900	貸付株式数	700株
日本山村硝子	2,800	863.00	2,416,400		
日本電気硝子	25,000	2,282.00	57,050,000		
オハラ	2,700	1,508.00	4,071,600	貸付株式数	100株
住友大阪セメント	12,700	3,090.00	39,243,000		
太平洋セメント	42,400	2,806.00	118,974,400		
リソルホールディングス	700	3,765.00	2,635,500	貸付株式数	200株
日本ヒユーム	6,700	780.00	5,226,000	貸付株式数	2,400株
日本コンクリート	14,600	318.00	4,642,800		
三谷セキサン	3,100	4,175.00	12,942,500		
アジアパイルＨＤ	9,600	455.00	4,368,000		
東海カーボン	66,100	1,146.00	75,750,600	貸付株式数	26,500株

日本カーボン	3,500	3,735.00	13,072,500	貸付株式数	1,100株
東洋炭素	4,000	1,784.00	7,136,000		
ノリタケ	3,700	2,931.00	10,844,700		
ＴＯＴＯ	48,000	5,910.00	283,680,000		
日本碍子	80,600	1,659.00	133,715,400		
日本特殊陶業	51,400	1,891.00	97,197,400	貸付株式数	8,700株
ダントーホールディングス	5,600	487.00	2,727,200	貸付株式数	2,000株
ＭＡＲＵＷＡ	2,600	11,080.00	28,808,000	貸付株式数	1,000株
品川リフラクトリーズ	1,700	2,459.00	4,180,300		
黒崎播磨	1,300	3,595.00	4,673,500		
ヨータイ	5,300	825.00	4,372,500	貸付株式数	2,000株
イソライト	3,400	442.00	1,502,800		
東京窯業	8,400	345.00	2,898,000	貸付株式数	3,300株
ニッカトー	3,000	708.00	2,124,000		
フジミインコーポレーテッド	6,100	3,640.00	22,204,000		
クニミネ工業	2,800	1,098.00	3,074,400	貸付株式数	100株
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,034.00	1,137,400		
ニチアス	18,500	2,437.00	45,084,500		
日本製鉄	297,600	1,276.50	379,886,400		
神戸製鋼所	122,100	505.00	61,660,500	貸付株式数	48,400株
中山製鋼所	8,700	376.00	3,271,200		
合同製鐵	3,600	1,855.00	6,678,000	貸付株式数	300株
ＪＦＥホールディングス	179,700	956.00	171,793,200		
東京製鐵	32,600	656.00	21,385,600	貸付株式数	5,300株
共英製鋼	7,600	1,494.00	11,354,400	貸付株式数	1,500株
大和工業	14,200	2,646.00	37,573,200		
東京鐵鋼	2,700	2,207.00	5,958,900		
大阪製鐵	3,500	1,188.00	4,158,000		
淀川製鋼所	8,900	1,973.00	17,559,700		
丸一鋼管	21,700	2,196.00	47,653,200	貸付株式数	8,600株
モリ工業	2,000	2,441.00	4,882,000		
大同特殊鋼	10,800	4,340.00	46,872,000		
日本高周波	2,400	337.00	808,800		
日本冶金工	5,500	1,650.00	9,075,000		
山陽特殊製鋼	4,500	1,250.00	5,625,000		
愛知製鋼	3,600	2,550.00	9,180,000		
日立金属	71,800	1,533.00	110,069,400		
日本金属	1,600	1,221.00	1,953,600	貸付株式数	400株
大平洋金属	4,500	1,850.00	8,325,000		

新日本電工	43,600	228.00	9,940,800		
栗本鉄工所	3,300	1,711.00	5,646,300		
虹　技	1,000	1,257.00	1,257,000		
日本鋳鉄管	800	1,316.00	1,052,800		
日本製鋼所	20,300	2,550.00	51,765,000		
三菱製鋼	4,900	554.00	2,714,600	貸付株式数	1,800株
日亜鋼業	9,600	308.00	2,956,800	貸付株式数	2,600株
日本精線	1,100	3,310.00	3,641,000	貸付株式数	100株
エンビプロＨＤ	3,000	559.00	1,677,000	貸付株式数	1,000株
大紀アルミニウム	11,000	681.00	7,491,000		
日本軽金属ＨＤ	16,900	1,792.00	30,284,800		
三井金属	18,000	2,958.00	53,244,000		
東邦亜鉛	3,400	2,040.00	6,936,000	貸付株式数	1,300株
三菱マテリアル	44,000	1,982.00	87,208,000		
住友鉱山	85,000	3,887.00	330,395,000		
ＤＯＷＡホールディングス	16,800	3,450.00	57,960,000		
古河機金	11,800	1,136.00	13,404,800		
エス・サイエンス	37,600	44.00	1,654,400	貸付株式数	11,500株
大阪チタニウム	6,900	840.00	5,796,000	貸付株式数	2,700株
東邦チタニウム	12,000	689.00	8,268,000	貸付株式数	3,700株
ＵＡＣＪ	10,100	1,791.00	18,089,100		
ＣＫサンエツ	1,400	3,855.00	5,397,000	貸付株式数	500株
古河電工	20,800	2,644.00	54,995,200		
住友電工	248,200	1,194.00	296,350,800		
フジクラ	81,000	407.00	32,967,000		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	7,800	1,612.00	12,573,600	貸付株式数	2,100株
東京特殊電線	1,000	2,407.00	2,407,000	貸付株式数	400株
タツタ電線	13,300	620.00	8,246,000		
カナレ電気	1,100	1,763.00	1,939,300	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	3,300	1,060.00	3,498,000		
リョービ	8,200	1,216.00	9,971,200	貸付株式数	900株
アーレステイ	8,600	322.00	2,769,200		
アサヒＨＤ	11,800	3,105.00	36,639,000		
東洋製罐グループＨＤ	42,400	1,007.00	42,696,800		
ホッカンホールディングス	3,700	1,380.00	5,106,000		
コロナ	3,400	903.00	3,070,200		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	12,500	1,982.00	24,775,000		
ＯＳＪＢ　ＨＤ	33,300	236.00	7,858,800		
駒井ハルテック	1,200	1,658.00	1,989,600		
高田機工	600	2,549.00	1,529,400	貸付株式数	100株

三和ホールディングス	62,900	1,270.00	79,883,000		
文化シヤッター	19,800	912.00	18,057,600	貸付株式数	7,800株
三協立山	8,700	765.00	6,655,500	貸付株式数	3,400株
アルインコ	4,900	908.00	4,449,200		
東洋シヤッター	1,700	744.00	1,264,800		
ＬＩＸＩＬグループ	98,200	2,505.00	245,991,000	貸付株式数	7,700株
日本フイルコン	5,000	529.00	2,645,000		
ノーリツ	13,800	1,611.00	22,231,800		
長府製作所	6,800	2,040.00	13,872,000	貸付株式数	2,700株
リンナイ	13,000	12,180.00	158,340,000		
ユニプレス	13,200	895.00	11,814,000		
ダイニチ工業	3,500	960.00	3,360,000		
日東精工	8,900	430.00	3,827,000		
三洋工業	800	1,916.00	1,532,800		
岡　部	13,700	806.00	11,042,200	貸付株式数	5,400株
ジーテクト	8,200	1,390.00	11,398,000	貸付株式数	3,300株
東　プ　レ	12,500	1,304.00	16,300,000		
高周波熱錬	12,900	446.00	5,753,400		
東京製綱	4,700	747.00	3,510,900		
サンコール	4,900	416.00	2,038,400		
モリテックスチル	5,400	495.00	2,673,000	貸付株式数	2,100株
パイオラックス	9,900	1,561.00	15,453,900	貸付株式数	3,900株
エイチワン	6,400	700.00	4,480,000		
日本発条	71,000	633.00	44,943,000		
中央発條	700	2,964.00	2,074,800		
アドバネクス	900	1,290.00	1,161,000		
三浦工業	28,800	5,490.00	158,112,000		
タ　ク　マ	22,700	1,793.00	40,701,100		
テクノプロ・ホールディング	12,900	8,800.00	113,520,000		
アトラ	1,700	268.00	455,600	貸付株式数	500株
インターワークス	1,600	323.00	516,800		
アイ・アールジャパンＨＤ	2,600	16,650.00	43,290,000	貸付株式数	1,000株
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,800	2,105.00	10,104,000		
ファーストロジック	1,400	818.00	1,145,200	貸付株式数	400株
三機サービス	1,300	999.00	1,298,700		
Ｇｕｎｏｓｙ	4,000	751.00	3,004,000	貸付株式数	100株
デザインワン・ジャパン	1,500	224.00	336,000	貸付株式数	600株
イー・ガーディアン	3,200	3,170.00	10,144,000		
リブセンス	4,400	251.00	1,104,400		

ジャパンマテリアル	19,900	1,451.00	28,874,900	貸付株式数	7,900株
ベクトル	8,200	920.00	7,544,000	貸付株式数	3,200株
ウチヤマホールディングス	3,200	298.00	953,600		
チャームケアコーポレーション	5,500	1,349.00	7,419,500		
キャリアリンク	2,300	1,948.00	4,480,400	貸付株式数	800株
ＩＢＪ	4,500	767.00	3,451,500	貸付株式数	1,200株
アサンテ	2,700	1,407.00	3,798,900	貸付株式数	1,000株
Ｎ・フィールド	4,300	785.00	3,375,500	貸付株式数	1,700株
バリューＨＲ	2,600	1,856.00	4,825,600	貸付株式数	1,000株
M&Aキャピタルパートナー	5,300	6,300.00	33,390,000	貸付株式数	2,000株 (1,700株)
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,500	2,021.00	5,052,500	貸付株式数	900株
ＥＲＩホールディングス	1,800	692.00	1,245,600	貸付株式数	600株
アビスト	900	2,997.00	2,697,300	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	4,400	1,640.00	7,216,000	貸付株式数	1,700株
ウィルグループ	4,300	979.00	4,209,700	貸付株式数	1,600株
エスクローＡＪ	9,000	331.00	2,979,000		
リクルートホールディングス	460,500	4,400.00	2,026,200,000		
エラン	4,200	3,190.00	13,398,000		
ツ　ガ　ミ	13,900	1,650.00	22,935,000	貸付株式数	5,500株
オークマ	7,800	6,020.00	46,956,000		
芝浦機械	7,600	2,301.00	17,487,600	貸付株式数	3,000株
アマダ	82,500	1,006.00	82,995,000		
アイダエンジニア	17,400	884.00	15,381,600		
滝澤鉄工所	2,000	1,003.00	2,006,000	貸付株式数	100株
ＦＵＪＩ	28,700	2,529.00	72,582,300		
牧野フライス	7,800	4,200.00	32,760,000		
オーエスジー	31,500	1,887.00	59,440,500	貸付株式数	1,200株
ダイジェット	700	1,412.00	988,400		
旭ダイヤモンド	17,600	424.00	7,462,400		
DMG森精機	42,200	1,542.00	65,072,400	貸付株式数	700株
ソディツク	14,900	833.00	12,411,700		
ディスコ	9,000	33,250.00	299,250,000		
日東工器	3,700	1,664.00	6,156,800		
日進工具	2,600	2,931.00	7,620,600	貸付株式数	700株
パンチ工業	5,900	440.00	2,596,000		

冨士ダイス	2,900	664.00	1,925,600	貸付株式数	1,100株
土木管理総合試験	2,900	360.00	1,044,000	貸付株式数	100株
ネットマーケティング	2,300	579.00	1,331,700	貸付株式数	900株
日本郵政	525,500	772.70	406,053,850		
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	10,900	1,603.00	17,472,700		
鎌倉新書	4,900	1,072.00	5,252,800	貸付株式数	1,900株 (400株)
ＳＭＮ	1,300	768.00	998,400		
一蔵	700	368.00	257,600	貸付株式数	200株
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,200	3,550.00	7,810,000		
グローバルキッズＣＯＭＰ	1,000	922.00	922,000		
エアトリ	3,300	1,227.00	4,049,100	貸付株式数	1,300株 (200株)
アトラエ	1,900	3,070.00	5,833,000	貸付株式数	700株
ストライク	2,400	6,320.00	15,168,000	貸付株式数	900株
ソラスト	17,900	1,517.00	27,154,300		
セラク	2,100	2,479.00	5,205,900	貸付株式数	800株
インソース	2,800	3,690.00	10,332,000	貸付株式数	1,000株 (900株)
豊田自動織機	54,400	7,540.00	410,176,000	貸付株式数	21,900株
豊和工業	3,900	810.00	3,159,000		
ＯＫＫ	2,700	384.00	1,036,800		
石川製作所	1,700	1,689.00	2,871,300	貸付株式数	600株 (600株)
東洋機械金属	4,600	405.00	1,863,000		
津田駒工業	1,200	906.00	1,087,200	貸付株式数	400株
エンシュウ	1,500	915.00	1,372,500		
島精機製作所	10,500	1,741.00	18,280,500	貸付株式数	600株
オプトラン	7,900	2,184.00	17,253,600		
ＮＣホールディングス	2,000	604.00	1,208,000		
イワキポンプ	4,200	801.00	3,364,200	貸付株式数	500株
フリュー	6,500	1,181.00	7,676,500	貸付株式数	2,400株
ヤマシンフィルタ	14,600	1,066.00	15,563,600	貸付株式数	5,800株
日阪製作所	8,400	838.00	7,039,200		
やまびこ	13,000	1,414.00	18,382,000	貸付株式数	700株
平田機工	3,100	8,340.00	25,854,000	貸付株式数	1,200株
ペガサスミシン製造	6,600	293.00	1,933,800		
マルマエ	2,700	1,072.00	2,894,400	貸付株式数	900株
タツモ	3,000	1,506.00	4,518,000		

ナブテスコ	39,200	4,310.00	168,952,000		
三井海洋開発	7,100	1,770.00	12,567,000		
レオン自動機	6,600	1,107.00	7,306,200		
ＳＭＣ	21,100	66,320.00	1,399,352,000		
ホソカワミクロン	2,400	6,330.00	15,192,000		
ユニオンツール	2,400	3,065.00	7,356,000	貸付株式数	100株
オイレス工業	8,600	1,594.00	13,708,400		
日精エーエスビー	2,000	5,700.00	11,400,000		
サト－ホールディングス	9,600	2,023.00	19,420,800		
技研製作所	5,900	4,100.00	24,190,000		
日本エアーテック	2,300	1,589.00	3,654,700	貸付株式数	800株
カ　ワ　タ	1,900	916.00	1,740,400		
日精樹脂工業	5,600	862.00	4,827,200	貸付株式数	2,200株
オカダアイヨン	2,000	997.00	1,994,000	貸付株式数	800株
ワイエイシイホールディングス	2,800	865.00	2,422,000		
小松製作所	304,800	2,540.00	774,192,000	貸付株式数	100株
住友重機械	38,600	2,253.00	86,965,800	貸付株式数	15,500株
日立建機	27,200	2,891.00	78,635,200		
日　工	9,200	663.00	6,099,600		
巴工業	2,700	1,919.00	5,181,300	貸付株式数	300株
井関農機	6,800	1,369.00	9,309,200	貸付株式数	1,300株
ＴＯＷＡ	6,800	1,814.00	12,335,200	貸付株式数	100株
丸山製作所	1,700	1,356.00	2,305,200		
北川鉄工所	3,000	1,279.00	3,837,000		
シンニッタン	10,400	183.00	1,903,200		
ローツェ	3,000	5,420.00	16,260,000	貸付株式数	1,100株
タカキタ	2,500	691.00	1,727,500	貸付株式数	500株
クボタ	357,000	2,070.50	739,168,500	貸付株式数	18,600株
荏原実業	1,700	3,670.00	6,239,000		
東洋エンジニア	8,700	351.00	3,053,700		
三菱化工機	2,300	2,245.00	5,163,500		
月島機械	12,300	1,201.00	14,772,300		
帝国電機製作所	5,600	1,245.00	6,972,000		
東京機械	3,100	265.00	821,500	貸付株式数	1,200株
新東工業	16,000	711.00	11,376,000		
渋谷工業	5,900	3,650.00	21,535,000		
アイチ　コーポレーション	11,600	928.00	10,764,800		
小森コーポレーション	17,200	713.00	12,263,600		
鶴見製作所	5,100	1,711.00	8,726,100		

住友精密	1,000	2,003.00	2,003,000		
日本ギア工業	2,400	314.00	753,600	貸付株式数	700株
酒井重工業	1,200	2,485.00	2,982,000	貸付株式数	300株
荏原製作所	27,900	3,340.00	93,186,000		
石井鉄工所	900	2,790.00	2,511,000		
酉島製作所	6,800	840.00	5,712,000		
北越工業	7,000	1,041.00	7,287,000	貸付株式数	100株
ダイキン工業	85,700	23,665.00	2,028,090,500		
オルガノ	2,400	5,930.00	14,232,000		
トーヨーカネツ	3,000	2,131.00	6,393,000		
栗田工業	36,500	3,850.00	140,525,000		
椿本チエイン	9,500	2,529.00	24,025,500		
大同工業	3,200	676.00	2,163,200		
日　機　装	20,600	995.00	20,497,000		
木村化工機	5,700	503.00	2,867,100	貸付株式数	300株
レイズネクスト	11,200	1,111.00	12,443,200		
アネスト岩田	10,500	987.00	10,363,500	貸付株式数	2,500株
ダイフク	34,400	12,100.00	416,240,000	貸付株式数	11,600株
サムコ	1,800	3,565.00	6,417,000	貸付株式数	700株
加藤製作所	3,700	1,016.00	3,759,200		
油研工業	1,100	1,514.00	1,665,400		
タダノ	32,800	823.00	26,994,400	貸付株式数	12,700株
フジテック	24,600	2,132.00	52,447,200		
ＣＫＤ	18,500	2,225.00	41,162,500		
キトー	5,200	1,586.00	8,247,200		
平和	18,600	1,421.00	26,430,600		
理想科学工業	6,000	1,291.00	7,746,000		
ＳＡＮＫＹＯ	15,000	2,568.00	38,520,000	貸付株式数	1,900株
日本金銭機械	7,300	541.00	3,949,300	貸付株式数	2,900株
マースグループＨＬＤＧＳ	4,100	1,598.00	6,551,800		
フクシマガリレイ	4,200	4,395.00	18,459,000	貸付株式数	200株
オーイズミ	2,800	399.00	1,117,200		
ダイコク電機	3,100	881.00	2,731,100		
竹内製作所	11,400	2,457.00	28,009,800		
ア　マ　ノ	17,800	2,454.00	43,681,200	貸付株式数	7,000株
ＪＵＫＩ	9,300	542.00	5,040,600		
サンデンホールディングス	9,000	372.00	3,348,000	貸付株式数	2,700株
蛇の目ミシン	6,000	854.00	5,124,000		
ブラザー工業	82,100	2,000.00	164,200,000		
マックス	10,400	1,400.00	14,560,000		

モリタホールディングス	11,800	1,784.00	21,051,200		
グローリー	17,500	2,100.00	36,750,000		
新晃工業	6,300	1,718.00	10,823,400	貸付株式数	2,200株
大和冷機工業	9,800	1,026.00	10,054,800		
セガサミーホールディングス	66,600	1,467.00	97,702,200	貸付株式数	8,000株
日本ピストンリング	2,400	935.00	2,244,000		
リ　ケ　ン	3,100	2,215.00	6,866,500	貸付株式数	400株
ＴＰＲ	9,100	1,308.00	11,902,800	貸付株式数	3,300株
ツバキ・ナカシマ	13,300	881.00	11,717,300		
ホシザキ	21,200	10,330.00	218,996,000		
大豊工業	5,400	608.00	3,283,200		
日本精工	126,600	845.00	106,977,000		
Ｎ　Ｔ　Ｎ	157,300	218.00	34,291,400		
ジェイテクト	64,500	811.00	52,309,500		
不　二　越	6,200	4,310.00	26,722,000	貸付株式数	1,900株
ミネベアミツミ	124,800	2,174.00	271,315,200		
日本トムソン	19,900	328.00	6,527,200		
Ｔ　Ｈ　Ｋ	41,400	3,225.00	133,515,000	貸付株式数	15,800株
ユーシン精機	5,300	787.00	4,171,100		
前澤給装工業	2,400	2,310.00	5,544,000		
イーグル工業	8,500	903.00	7,675,500		
前澤工業	4,000	458.00	1,832,000		
日本ピラー工業	6,800	1,621.00	11,022,800		
キッツ	27,500	563.00	15,482,500	貸付株式数	1,100株
日　立	323,100	3,966.00	1,281,414,600		
三菱電機	672,100	1,533.50	1,030,665,350		
富士電機	40,600	3,710.00	150,626,000		
東洋電機製造	2,400	1,105.00	2,652,000	貸付株式数	500株
安川電機	72,400	5,030.00	364,172,000	貸付株式数	29,300株
シンフォニア　テクノロジー	8,700	1,318.00	11,466,600		
明　電　舎	12,400	1,818.00	22,543,200		
オリジン	1,800	1,371.00	2,467,800	貸付株式数	100株
山洋電気	3,300	5,160.00	17,028,000		
デンヨー	5,800	2,089.00	12,116,200	貸付株式数	500株
ベイカレントコンサルティング	3,900	17,380.00	67,782,000	貸付株式数	1,500株
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	1,600	2,530.00	4,048,000	貸付株式数	500株

アイモバイル	2,200	1,303.00	2,866,600	貸付株式数	800株
キャリアインデックス	2,800	726.00	2,032,800	貸付株式数	1,000株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2,200	792.00	1,742,400	貸付株式数	800株
船場	1,100	905.00	995,500	貸付株式数	200株
グレイステクノロジー	3,000	8,330.00	24,990,000		
ジャパンエレベーターＳＨＤ	7,100	4,865.00	34,541,500		
フルテック	900	1,441.00	1,296,900	貸付株式数	300株
グリーンズ	1,800	458.00	824,400	貸付株式数	600株
ツナググループＨＬＤＧＳ	900	354.00	318,600	貸付株式数	300株
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	1,700	576.00	979,200	貸付株式数	600株
ソウルドアウト	1,300	1,555.00	2,021,500	貸付株式数	500株
ＭＳ＆ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	1,000	620.00	620,000	貸付株式数	300株
ミダック	800	3,385.00	2,708,000		
日総工産	4,500	752.00	3,384,000		
キュービーネットＨＬＤＧＳ	2,900	1,587.00	4,602,300	貸付株式数	1,000株
ＲＰＡホールディングス	4,800	673.00	3,230,400	貸付株式数	1,900株
三桜工業	8,600	661.00	5,684,600	貸付株式数	3,400株
マキタ	87,700	5,400.00	473,580,000	貸付株式数	3,200株
東芝テック	8,500	3,750.00	31,875,000		
芝浦メカトロニクス	1,200	3,885.00	4,662,000		
マブチモーター	18,700	4,660.00	87,142,000		
日本電産	161,900	13,305.00	2,154,079,500	貸付株式数	5,000株
ユーエムシーエレクトロニクス	4,200	409.00	1,717,800	貸付株式数	1,600株
トレックス・セミコンダクター	3,900	1,305.00	5,089,500		
東光高岳	3,700	1,332.00	4,928,400		
ダブル・スコープ	10,700	786.00	8,410,200	貸付株式数	4,200株
宮越ホールディングス	2,600	685.00	1,781,000	貸付株式数	900株
ダイヘン	7,400	4,540.00	33,596,000	貸付株式数	300株
ヤーマン	11,100	2,324.00	25,796,400	貸付株式数	1,000株
ＪＶＣケンウッド	55,100	141.00	7,769,100		
ミマキエンジニアリング	6,000	510.00	3,060,000	貸付株式数	2,100株
Ｉ－ＰＥＸ	2,800	1,965.00	5,502,000	貸付株式数	500株 (500株)
日新電機	15,700	1,165.00	18,290,500		
大崎電気	13,300	552.00	7,341,600	貸付株式数	5,300株

オムロン	60,300	9,430.00	568,629,000		
日東工業	10,000	1,856.00	18,560,000		
ＩＤＥＣ	9,800	1,845.00	18,081,000	貸付株式数	3,900株
正興電機製作所	1,700	2,146.00	3,648,200	貸付株式数	600株
不二電機工業	1,000	1,301.00	1,301,000	貸付株式数	200株 (200株)
ジーエス・ユアサ　コーポ	22,600	2,524.00	57,042,400		
サクサホールディングス	1,500	1,441.00	2,161,500		
メルコホールディングス	2,300	3,060.00	7,038,000		
テクノメディカ	1,500	1,491.00	2,236,500	貸付株式数	300株
ダイヤモンドエレクトリクHD	1,400	1,292.00	1,808,800		
日本電気	81,600	5,630.00	459,408,000		
富　士　通	64,800	14,505.00	939,924,000		
沖　電　気	27,700	906.00	25,096,200		
岩崎通信機	3,000	850.00	2,550,000		
電気興業	3,300	2,900.00	9,570,000	貸付株式数	800株
サンケン電気	7,400	3,815.00	28,231,000		
ナカヨ	1,300	1,475.00	1,917,500		
アイホン	3,800	1,539.00	5,848,200		
ルネサスエレクトロニクス	287,900	928.00	267,171,200		
セイコーエプソン	83,600	1,557.00	130,165,200		
ワコム	45,600	965.00	44,004,000		
アルバック	12,400	4,220.00	52,328,000		
アクセル	2,700	807.00	2,178,900		
ＥＩＺＯ	5,300	3,630.00	19,239,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	50.00	3,085,000		
日本信号	17,400	931.00	16,199,400		
京三製作所	15,800	421.00	6,651,800		
能美防災	8,900	2,263.00	20,140,700		
ホーチキ	4,900	1,246.00	6,105,400		
星和電機	3,500	614.00	2,149,000		
エレコム	7,600	4,775.00	36,290,000		
パナソニック	768,700	1,112.50	855,178,750	貸付株式数	309,300株
シャープ	78,200	1,400.00	109,480,000	貸付株式数	31,300株
アンリツ	43,500	2,379.00	103,486,500	貸付株式数	17,500株
富士通ゼネラル	18,500	3,165.00	58,552,500		
ソ　ニ　ー※	421,400	9,704.00	4,089,265,600		
Ｔ　Ｄ　Ｋ	32,500	14,720.00	478,400,000		
帝国通信工業	3,000	1,168.00	3,504,000		

タムラ製作所	22,700	535.00	12,144,500		
アルプスアルパイン	59,800	1,308.00	78,218,400		
池上通信機	2,100	949.00	1,992,900		
日本電波工業	6,300	511.00	3,219,300	貸付株式数	2,400株
鈴木	3,300	897.00	2,960,100		
日本トリム	900	4,065.00	3,658,500		
ローランド　ディー.ジー.	3,700	1,707.00	6,315,900	貸付株式数	1,400株
フオスター電機	7,100	1,118.00	7,937,800		
ＳＭＫ	1,700	3,045.00	5,176,500	貸付株式数	100株
ヨコオ	4,400	2,428.00	10,683,200	貸付株式数	1,700株
ティアック	4,900	106.00	519,400	貸付株式数	1,300株
ホシデン	18,600	876.00	16,293,600		
ヒロセ電機	10,400	14,760.00	153,504,000	貸付株式数	4,100株
日本航空電子	15,500	1,400.00	21,700,000		
ＴＯＡ	7,200	870.00	6,264,000		
マクセルホールディングス	14,600	1,200.00	17,520,000		
古野電気	8,700	1,188.00	10,335,600		
ユニデンホールディングス	1,900	2,389.00	4,539,100	貸付株式数	200株
スミダコーポレーション	5,200	1,052.00	5,470,400		
アイコム	3,800	2,658.00	10,100,400	貸付株式数	100株
リオン	2,800	3,205.00	8,974,000		
本多通信工業	5,800	473.00	2,743,400		
船井電機	6,800	420.00	2,856,000		
横河電機	61,700	1,844.00	113,774,800		
新電元工業	2,400	2,346.00	5,630,400		
アズビル	42,500	4,685.00	199,112,500		
東亜ディーケーケー	3,300	851.00	2,808,300	貸付株式数	1,300株
日本光電工業	27,800	3,300.00	91,740,000		
チノー	2,300	1,424.00	3,275,200	貸付株式数	700株
共和電業	6,900	402.00	2,773,800		
日本電子材料	2,700	1,567.00	4,230,900	貸付株式数	1,000株
堀場製作所	13,300	5,600.00	74,480,000	貸付株式数	3,700株
アドバンテスト	50,100	7,260.00	363,726,000		
小野測器	2,700	522.00	1,409,400		
エスペック	6,000	1,940.00	11,640,000		
キーエンス	61,000	53,290.00	3,250,690,000	貸付株式数	5,300株
日置電機	3,300	3,925.00	12,952,500	貸付株式数	800株
シスメックス	48,100	10,930.00	525,733,000		
日本マイクロニクス	11,800	985.00	11,623,000		

メガチップス	6,300	2,857.00	17,999,100		
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	4,000	3,390.00	13,560,000	貸付株式数	1,600株
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	5,700	403.00	2,297,100	貸付株式数	2,200株 (2,000株)
澤藤電機	900	1,813.00	1,631,700	貸付株式数	300株
デンソー	148,000	4,929.00	729,492,000		
原田工業	3,200	851.00	2,723,200	貸付株式数	1,200株
コーセル	9,000	1,105.00	9,945,000		
イリソ電子工業	5,700	4,225.00	24,082,500	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	11,100	1,887.00	20,945,700		
千代田インテグレ	2,900	1,527.00	4,428,300		
アイ・オー・データ	2,300	969.00	2,228,700	貸付株式数	800株
レーザーテック	29,600	11,000.00	325,600,000		
スタンレー電気	47,200	3,070.00	144,904,000		
岩崎電気	2,600	1,386.00	3,603,600		
ウシオ電機	37,300	1,315.00	49,049,500		
岡谷電機	5,200	428.00	2,225,600		
ヘリオステクノＨ	6,300	302.00	1,902,600	貸付株式数	200株
エノモト	2,000	1,272.00	2,544,000	貸付株式数	800株
日本セラミック	6,900	2,867.00	19,782,300		
遠藤照明	3,300	565.00	1,864,500		
古河電池	4,800	1,696.00	8,140,800	貸付株式数	1,900株
双信電機	3,300	498.00	1,643,400	貸付株式数	1,200株
山一電機	4,900	1,513.00	7,413,700		
図　研	4,400	2,642.00	11,624,800	貸付株式数	300株
日本電子	13,300	4,095.00	54,463,500		
カ　シ　オ	59,700	1,875.00	111,937,500	貸付株式数	2,000株
ファナック	63,300	25,365.00	1,605,604,500		
日本シイエムケイ	15,900	401.00	6,375,900	貸付株式数	6,300株
エンプラス	3,500	2,829.00	9,901,500		
大真空	2,500	2,146.00	5,365,000		
ロ　ー　ム	28,000	8,710.00	243,880,000		
浜松ホトニクス	48,300	5,870.00	283,521,000	貸付株式数	4,300株
三井ハイテック	7,500	2,879.00	21,592,500	貸付株式数	2,600株
新光電気工業	22,700	2,311.00	52,459,700		
京　セ　ラ	94,600	5,963.00	564,099,800		
協栄産業	700	1,292.00	904,400		
太陽誘電	30,000	4,735.00	142,050,000		
村田製作所	197,600	9,129.00	1,803,890,400		
双葉電子工業	10,800	865.00	9,342,000		

日東電工	46,400	8,640.00	400,896,000		
北陸電気工業	2,700	915.00	2,470,500		
東海理化電機	17,800	1,597.00	28,426,600		
ニチコン	22,900	1,094.00	25,052,600		
日本ケミコン	5,100	1,512.00	7,711,200		
ＫＯＡ	10,200	1,431.00	14,596,200		
三井Ｅ＆ＳＨＤ	21,700	341.00	7,399,700		
日立造船	53,500	402.00	21,507,000		
三菱重工業	112,700	2,351.50	265,014,050		
川崎重工業	52,500	1,515.00	79,537,500	貸付株式数	17,400株
ＩＨＩ	48,600	1,551.00	75,378,600	貸付株式数	19,500株
名村造船所	22,200	151.00	3,352,200	貸付株式数	8,700株
サノヤスホールディングス	9,400	156.00	1,466,400		
スプリックス	2,100	842.00	1,768,200	貸付株式数	500株
マネジメントソリューションズ	2,800	1,508.00	4,222,400	貸付株式数	1,100株
プロレド・パートナーズ	900	4,870.00	4,383,000	貸付株式数	300株
ＡＮＤ　ＦＡＣＴＯＲＹ	500	791.00	395,500	貸付株式数	200株
ギークス	600	1,202.00	721,200	貸付株式数	200株
カーブスホールディングス	17,800	722.00	12,851,600	貸付株式数	7,100株
フォーラムエンジニアリング	3,300	816.00	2,692,800		
日本車輌	2,500	2,482.00	6,205,000	貸付株式数	900株
三菱ロジスネクスト	9,000	1,108.00	9,972,000	貸付株式数	2,000株
近畿車輌	1,000	1,303.00	1,303,000	貸付株式数	200株
ＦＰＧ	20,600	497.00	10,238,200	貸付株式数	8,200株 (200株)
島根銀行	1,500	637.00	955,500		
じもとホールディングス	4,500	897.00	4,036,500		
全国保証	18,800	4,775.00	89,770,000	貸付株式数	6,800株
めぶきフィナンシャルＧ	344,900	214.00	73,808,600		
東京きらぼしＦＧ	9,000	1,140.00	10,260,000		
九州フィナンシャルＧ	145,000	510.00	73,950,000		
かんぽ生命保険	23,400	1,740.00	40,716,000		
ゆうちょ銀行	187,100	822.00	153,796,200	貸付株式数	75,800株
富山第一銀行	15,700	292.00	4,584,400		
コンコルディア・フィナンシャル	378,600	371.00	140,460,600		
ジェイリース	2,300	672.00	1,545,600	貸付株式数	700株
西日本フィナンシャルＨＤ	44,300	723.00	32,028,900	貸付株式数	1,500株

マーキュリアインベストメント	2,800	656.00	1,836,800	貸付株式数	1,100株
イントラスト	2,500	898.00	2,245,000	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	2,800	1,139.00	3,189,200		
Ｃａｓａ	2,300	1,280.00	2,944,000	貸付株式数	800株
アルヒ	10,700	1,921.00	20,554,700	貸付株式数	3,800株
プレミアグループ	3,600	2,245.00	8,082,000		
日産自動車	793,300	492.50	390,700,250		
いすゞ自動車	195,000	1,018.00	198,510,000		
トヨタ自動車 ※	750,500	6,999.00	5,252,749,500		
日野自動車	84,100	905.00	76,110,500		
三菱自動車工業	250,500	188.00	47,094,000	貸付株式数	100,900株
エフテック	4,800	568.00	2,726,400	貸付株式数	1,800株
レシップホールディングス	2,600	543.00	1,411,800		
ＧＭＢ	1,500	634.00	951,000		
ファルテック	1,400	587.00	821,800		
武蔵精密工業	15,100	1,539.00	23,238,900		
日産車体	13,100	902.00	11,816,200	貸付株式数	3,900株
新明和工業	18,300	826.00	15,115,800		
極東開発工業	12,500	1,381.00	17,262,500		
トピー工業	5,600	1,078.00	6,036,800	貸付株式数	1,100株
ティラド	2,400	1,279.00	3,069,600		
タチエス	11,100	1,125.00	12,487,500		
Ｎ　Ｏ　Ｋ	36,100	1,152.00	41,587,200		
フタバ産業	18,900	505.00	9,544,500	貸付株式数	7,400株
ＫＹＢ	7,600	2,518.00	19,136,800	貸付株式数	2,500株
市光工業	10,200	528.00	5,385,600	貸付株式数	4,000株
大同メタル工業	13,100	467.00	6,117,700		
プレス工業	33,600	303.00	10,180,800		
ミクニ	8,400	277.00	2,326,800	貸付株式数	2,200株
太平洋工業	14,300	1,073.00	15,343,900	貸付株式数	4,400株
河西工業	9,200	347.00	3,192,400	貸付株式数	3,400株
アイシン精機	55,400	3,095.00	171,463,000		
マ　ツ　ダ	198,200	617.00	122,289,400		
今仙電機製作所	6,100	872.00	5,319,200	貸付株式数	2,400株
本田技研 ※	529,500	2,871.50	1,520,459,250		
スズキ	133,400	5,604.00	747,573,600		
ＳＵＢＡＲＵ	208,800	2,073.00	432,842,400		
安永	3,300	1,150.00	3,795,000	貸付株式数	1,300株
ヤマハ発動機	94,300	2,010.00	189,543,000		

小糸製作所	40,300	6,280.00	253,084,000	貸付株式数	7,300株
ＴＢＫ	7,900	452.00	3,570,800		
エクセディ	9,300	1,234.00	11,476,200		
ミツバ	12,400	513.00	6,361,200		
豊田合成	21,800	2,832.00	61,737,600		
愛三工業	10,600	443.00	4,695,800		
盟和産業	1,000	873.00	873,000	貸付株式数	200株
日本プラスト	5,000	450.00	2,250,000		
ヨ　ロ　ズ	6,400	1,130.00	7,232,000	貸付株式数	2,500株
エフ・シー・シー	11,200	1,992.00	22,310,400	貸付株式数	4,200株
新家工業	1,500	1,152.00	1,728,000		
シマノ	25,200	24,740.00	623,448,000	貸付株式数	1,000株
テイ・エス　テック	15,700	3,050.00	47,885,000	貸付株式数	5,500株
関西みらいＦＧ	39,500	522.00	20,619,000	貸付株式数	400株
３３ＦＧ	6,200	1,281.00	7,942,200		
第四北越フィナンシャルＧ	11,500	2,364.00	27,186,000	貸付株式数	600株
ひろぎんＨＬＤＧＳ	98,300	581.00	57,112,300	貸付株式数	30,000株
ジャムコ	3,300	621.00	2,049,300	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
小　野　建	5,500	1,215.00	6,682,500	貸付株式数	2,200株
はるやまＨＬＤＧＳ	3,100	690.00	2,139,000	貸付株式数	1,000株
南　陽	1,400	1,755.00	2,457,000		
ノ　ジ　マ	12,000	2,730.00	32,760,000		
佐鳥電機	4,500	773.00	3,478,500	貸付株式数	1,600株
カッパ・クリエイト	9,400	1,407.00	13,225,800	貸付株式数	3,500株
エコートレーディング	1,500	618.00	927,000	貸付株式数	600株 (100株)
伯東	4,100	1,056.00	4,329,600		
コンドーテック	5,200	1,016.00	5,283,200	貸付株式数	1,800株
中山福	3,700	502.00	1,857,400		
ライトオン	4,900	618.00	3,028,200	貸付株式数	1,800株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,700	2,702.00	23,507,400		
ジーンズメイト	2,700	336.00	907,200	貸付株式数	900株 (200株)
三菱食品	7,200	2,758.00	19,857,600		
良品計画	88,100	2,147.00	189,150,700		
三城ホールディングス	6,900	291.00	2,007,900	貸付株式数	2,700株
松田産業	4,900	1,721.00	8,432,900		
第一興商	9,900	3,370.00	33,363,000		

メディパルＨＤ	71,400	1,963.00	140,158,200		
アドヴァン	10,300	1,301.00	13,400,300		
ＳＰＫ	2,800	1,248.00	3,494,400	貸付株式数	1,000株
萩原電気ＨＬＤＧＳ	2,500	2,416.00	6,040,000		
アルビス	2,500	2,556.00	6,390,000	貸付株式数	600株
アズワン	4,300	16,040.00	68,972,000		
スズデン	2,300	1,200.00	2,760,000	貸付株式数	800株
尾家産業	1,900	1,476.00	2,804,400	貸付株式数	700株
シモジマ	4,100	1,329.00	5,448,900	貸付株式数	900株
ドウシシャ	6,300	2,009.00	12,656,700		
小津産業	1,500	1,840.00	2,760,000		
コナカ	7,700	258.00	1,986,600	貸付株式数	3,000株
高速	4,000	1,576.00	6,304,000		
ハウス　ローゼ	800	1,667.00	1,333,600		
Ｇ－７ホールディングス	3,900	2,436.00	9,500,400		
たけびし	2,400	1,498.00	3,595,200	貸付株式数	900株
イオン北海道	8,600	956.00	8,221,600	貸付株式数	1,400株
コ　ジ　マ	11,400	755.00	8,607,000	貸付株式数	4,300株
ヒマラヤ	2,200	906.00	1,993,200		
コーナン商事	9,500	3,230.00	30,685,000	貸付株式数	300株
ネットワンシステムズ	25,200	3,720.00	93,744,000	貸付株式数	10,100株
エコス	2,400	2,304.00	5,529,600		
ワタミ	7,900	887.00	7,007,300	貸付株式数	3,000株
マルシェ	1,500	505.00	757,500	貸付株式数	600株
リックス	1,500	1,650.00	2,475,000	貸付株式数	500株
システムソフト	20,300	92.00	1,867,600		
パンパシフィックＨＤ	145,800	2,467.00	359,688,600		
丸文	5,600	487.00	2,727,200		
西松屋チェーン	14,700	1,572.00	23,108,400	貸付株式数	5,600株
ゼンショーホールディングス	31,700	2,610.00	82,737,000		
ハピネット	5,500	1,426.00	7,843,000		
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,774.00	7,450,800	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,400	914.00	1,279,600	貸付株式数	500株
橋本総業ＨＬＤＧＳ	1,300	2,317.00	3,012,100		
日本ライフライン	19,700	1,438.00	28,328,600		
サイゼリヤ	10,000	1,790.00	17,900,000	貸付株式数	500株
タカショー	3,900	805.00	3,139,500	貸付株式数	1,500株
ＶＴホールディングス	27,600	375.00	10,350,000		

マルカ	2,300	1,980.00	4,554,000	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,700	3,200.00	18,240,000		
魚力	1,900	1,704.00	3,237,600		
ＩＤＯＭ	18,000	572.00	10,296,000	貸付株式数	5,100株
日本エム・ディ・エム	3,900	2,345.00	9,145,500	貸付株式数	1,500株
ポプラ	1,800	408.00	734,400	貸付株式数	700株
フジ・コーポレーション	1,800	2,331.00	4,195,800	貸付株式数	700株 (700株)
ユナイテッドアローズ	7,000	1,463.00	10,241,000	貸付株式数	2,800株
進和	4,000	2,157.00	8,628,000	貸付株式数	1,400株
エスケイジャパン	1,600	451.00	721,600	貸付株式数	500株
ダイトロン	2,800	1,475.00	4,130,000	貸付株式数	1,000株
ハイデイ日高	9,600	1,693.00	16,252,800	貸付株式数	2,700株
シークス	8,500	1,566.00	13,311,000	貸付株式数	1,600株
京都きもの友禅	3,900	226.00	881,400	貸付株式数	1,600株
コロワイド	22,100	1,542.00	34,078,200	貸付株式数	8,800株 (300株)
ピーシーデポコーポ	8,800	597.00	5,253,600	貸付株式数	3,500株
田中商事	2,100	696.00	1,461,600		
オーハシテクニカ	3,500	1,350.00	4,725,000		
壱番屋	4,600	5,120.00	23,552,000	貸付株式数	1,800株
白銅	2,300	1,433.00	3,295,900	貸付株式数	800株
トップカルチャー	2,400	359.00	861,600		
ＰＬＡＮＴ	1,600	774.00	1,238,400	貸付株式数	600株
スギホールディングス	13,300	6,930.00	92,169,000		
ダイコー通産	400	1,403.00	561,200	貸付株式数	100株
薬王堂ホールディングス	2,900	2,401.00	6,962,900		
島津製作所	80,400	3,755.00	301,902,000		
Ｊ　Ｍ　Ｓ	5,700	939.00	5,352,300		
クボテック	1,900	369.00	701,100	貸付株式数	600株
長野計器	5,000	785.00	3,925,000		
ブイ・テクノロジー	3,200	5,270.00	16,864,000	貸付株式数	1,200株
スター精密	10,500	1,471.00	15,445,500		
東京計器	4,200	893.00	3,750,600	貸付株式数	200株
愛知時計	900	4,405.00	3,964,500		
インターアクション	3,600	1,880.00	6,768,000	貸付株式数	1,400株
オーバル	6,400	229.00	1,465,600	貸付株式数	1,200株
東京精密	12,300	4,605.00	56,641,500		
マニー	26,800	2,558.00	68,554,400		
ニコン	102,700	649.00	66,652,300		

トプコン	34,000	1,327.00	45,118,000	貸付株式数	13,600株
オリンパス	372,300	2,256.50	840,094,950		
理研計器	6,000	2,798.00	16,788,000		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	11,700	6,960.00	81,432,000		
キヤノン電子	6,100	1,453.00	8,863,300	貸付株式数	700株
タムロン	5,500	1,599.00	8,794,500		
ＨＯＹＡ	133,500	13,910.00	1,856,985,000		
シ　ー　ド	2,900	598.00	1,734,200	貸付株式数	1,100株
ノーリツ鋼機	4,600	2,228.00	10,248,800	貸付株式数	1,100株
エー・アンド・デイ	6,100	910.00	5,551,000		
朝日インテック	76,300	3,825.00	291,847,500		
キヤノン	334,300	1,853.50	619,625,050	貸付株式数	141,500株
リ　コ　ー	172,100	697.00	119,953,700	貸付株式数	68,900株
シチズン時計	79,600	275.00	21,890,000	貸付株式数	31,600株
リズム	2,100	637.00	1,337,700		
大研医器	5,100	512.00	2,611,200		
メニコン	9,600	6,480.00	62,208,000	貸付株式数	2,400株
シンシア	900	383.00	344,700		
中本パックス	1,600	1,587.00	2,539,200	貸付株式数	600株
スノーピーク	3,500	1,565.00	5,477,500	貸付株式数	1,400株
パラマウントベッドＨＤ	7,100	4,265.00	30,281,500		
トランザクション	4,000	938.00	3,752,000	貸付株式数	1,400株
粧美堂	2,000	392.00	784,000	貸付株式数	300株
ニホンフラッシュ	6,300	1,364.00	8,593,200		
前田工繊	7,500	2,597.00	19,477,500	貸付株式数	2,300株
永大産業	8,600	290.00	2,494,000		
アートネイチャー	7,200	669.00	4,816,800		
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	69,600	9,530.00	663,288,000		
アイフィスジャパン	1,800	792.00	1,425,600	貸付株式数	600株
共立印刷	11,300	124.00	1,401,200		
ＳＨＯＥＩ	6,000	3,605.00	21,630,000		
フランスベッドＨＬＤＧＳ	9,200	851.00	7,829,200	貸付株式数	3,600株
マーベラス	10,000	907.00	9,070,000		
パイロットコーポレーション	11,500	2,959.00	34,028,500		
萩原工業	3,700	1,533.00	5,672,100		
エイベックス	11,500	942.00	10,833,000		
トッパン・フォームズ	14,400	998.00	14,371,200		

フジシールインターナショナル	15,200	1,937.00	29,442,400		
タカラトミー	30,300	933.00	28,269,900		
廣済堂	4,900	631.00	3,091,900		
エステールホールディングス	2,000	617.00	1,234,000	貸付株式数	700株
レック	7,200	1,548.00	11,145,600		
タカノ	2,600	597.00	1,552,200	貸付株式数	1,000株
三光合成	7,500	292.00	2,190,000		
プロネクサス	5,700	1,075.00	6,127,500	貸付株式数	100株
ホクシン	5,700	110.00	627,000		
ウッドワン	2,400	1,168.00	2,803,200		
大建工業	4,500	1,975.00	8,887,500		
き　も　と	12,400	182.00	2,256,800	貸付株式数	4,400株
凸版印刷	94,700	1,425.00	134,947,500		
大日本印刷	87,800	1,956.00	171,736,800		
共同印刷	2,100	2,918.00	6,127,800	貸付株式数	700株
ＮＩＳＳＨＡ	13,900	1,376.00	19,126,400	貸付株式数	5,500株
光村印刷	600	1,795.00	1,077,000	貸付株式数	200株
藤森工業	6,000	4,725.00	28,350,000	貸付株式数	400株
ヴィア・ホールディングス	8,100	249.00	2,016,900	貸付株式数	3,200株
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,300	1,938.00	6,395,400	貸付株式数	1,300株 (100株)
前澤化成工業	4,300	982.00	4,222,600		
未来工業	3,600	1,880.00	6,768,000	貸付株式数	900株
アシックス	59,200	1,880.00	111,296,000	貸付株式数	800株
ツ　ツ　ミ	2,100	2,111.00	4,433,100		
ウェーブロックＨＬＤＧＳ	2,300	738.00	1,697,400		
ジェイ　エス　ピー	3,900	1,507.00	5,877,300	貸付株式数	1,500株
ニ　チ　ハ	9,400	3,260.00	30,644,000	貸付株式数	400株
エフピコ	14,200	4,185.00	59,427,000		
小松ウオール工業	1,900	1,742.00	3,309,800		
ヤマハ	40,000	5,960.00	238,400,000		
河合楽器	2,100	2,700.00	5,670,000		
クリナップ	6,300	462.00	2,910,600		
ピジョン	43,300	4,660.00	201,778,000		
天馬	4,500	1,907.00	8,581,500		
オリバー	1,400	2,361.00	3,305,400	貸付株式数	100株
兼松サステック	400	1,610.00	644,000		
キングジム	5,700	895.00	5,101,500		

象印マホービン	18,400	1,886.00	34,702,400		
リンテック	16,000	2,155.00	34,480,000		
信越ポリマー	12,100	940.00	11,374,000		
東　リ	16,800	256.00	4,300,800		
イトーキ	13,700	338.00	4,630,600		
任　天　堂	41,300	59,260.00	2,447,438,000		
三菱鉛筆	10,800	1,442.00	15,573,600	貸付株式数	800株
松　風	3,000	1,823.00	5,469,000		
タカラスタンダード	13,700	1,380.00	18,906,000		
コ　ク　ヨ	32,200	1,342.00	43,212,400		
ナカバヤシ	6,600	607.00	4,006,200	貸付株式数	200株
ニ　フ　コ	24,700	3,675.00	90,772,500	貸付株式数	7,300株
立川ブラインド	3,000	1,246.00	3,738,000	貸付株式数	1,100株
グローブライド	3,000	4,045.00	12,135,000		
オカムラ	23,400	937.00	21,925,800	貸付株式数	1,000株
バルカー	5,500	1,870.00	10,285,000		
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,000	1,461.00	1,461,000	貸付株式数	300株
伊　藤　忠	463,600	2,758.50	1,278,840,600		
丸　紅	689,300	608.50	419,439,050		
スクロール	10,100	773.00	7,807,300	貸付株式数	600株
高　島	1,000	1,574.00	1,574,000		
ヨンドシーホールディングス	6,800	1,864.00	12,675,200		
三陽商会	3,500	529.00	1,851,500	貸付株式数	1,400株
長瀬産業	36,900	1,435.00	52,951,500		
ナイガイ	2,500	353.00	882,500		
蝶　理	4,300	1,540.00	6,622,000	貸付株式数	100株
豊田通商	73,900	3,610.00	266,779,000	貸付株式数	29,800株
オンワードホールディングス	40,100	185.00	7,418,500		
三共生興	9,300	437.00	4,064,100		
兼　松	25,000	1,205.00	30,125,000		
美　津　濃	6,100	1,812.00	11,053,200		
ツカモトコーポレーション	1,300	1,401.00	1,821,300		
ルックホールディングス	2,100	976.00	2,049,600	貸付株式数	800株
三井物産	573,900	1,780.00	1,021,542,000		
日本紙パルプ	3,800	3,445.00	13,091,000	貸付株式数	100株
東京エレクトロン	42,700	35,470.00	1,514,569,000	貸付株式数	17,200株
カメイ	8,500	1,173.00	9,970,500	貸付株式数	1,400株

東都水産	800	4,550.00	3,640,000	貸付株式数	300株
ＯＵＧホールディングス	1,100	2,844.00	3,128,400		
スターゼン	2,500	4,245.00	10,612,500		
セイコーＨＤ	9,500	1,344.00	12,768,000	貸付株式数	1,800株
山　善	26,100	994.00	25,943,400		
椿本興業	1,200	3,645.00	4,374,000		
住友商事	418,200	1,286.50	538,014,300		
日本ユニシス	20,600	3,860.00	79,516,000		
内田洋行	2,600	5,130.00	13,338,000	貸付株式数	1,000株
三菱商事	434,600	2,433.00	1,057,381,800		
第一実業	3,300	4,025.00	13,282,500		
キヤノンマーケティングＪＰＮ	16,500	2,183.00	36,019,500	貸付株式数	6,400株
西華産業	3,700	1,260.00	4,662,000		
佐藤商事	5,400	1,028.00	5,551,200		
菱洋エレクトロ	6,800	2,752.00	18,713,600	貸付株式数	2,400株
東京産業	6,000	557.00	3,342,000		
ユアサ商事	6,400	3,275.00	20,960,000		
神鋼商事	1,600	1,860.00	2,976,000		
トルク	3,900	275.00	1,072,500		
阪和興業	12,500	2,500.00	31,250,000		
正栄食品	4,300	3,770.00	16,211,000	貸付株式数	1,700株
カナデン	5,400	1,289.00	6,960,600	貸付株式数	1,900株
菱電商事	4,800	1,508.00	7,238,400	貸付株式数	1,600株
ニプロ	46,400	1,120.00	51,968,000	貸付株式数	500株
フルサト工業	3,400	1,253.00	4,260,200	貸付株式数	1,300株
岩谷産業	14,900	5,680.00	84,632,000		
ナイス	2,500	1,561.00	3,902,500		
昭光通商	2,300	607.00	1,396,100		
ニチモウ	1,000	1,976.00	1,976,000		
極東貿易	1,900	1,377.00	2,616,300	貸付株式数	700株
イ　ワ　キ	8,700	526.00	4,576,200	貸付株式数	3,300株
兼松エレクトロニクス	3,600	4,040.00	14,544,000		
三愛石油	16,300	1,154.00	18,810,200	貸付株式数	6,500株
稲畑産業	14,800	1,378.00	20,394,400	貸付株式数	5,900株
ＧＳＩクレオス	1,600	1,799.00	2,878,400	貸付株式数	600株
明和産業	6,300	407.00	2,564,100	貸付株式数	2,300株
クワザワホールディングス	2,300	583.00	1,340,900		
ヤマエ久野	4,900	1,191.00	5,835,900		
ゴールドウイン	11,900	7,020.00	83,538,000	貸付株式数	4,100株

ユニ・チヤーム	142,700	5,063.00	722,490,100	貸付株式数	27,300株
デサント	12,800	1,724.00	22,067,200		
キ　ン　グ	3,000	546.00	1,638,000		
ワ　キ　タ	14,200	1,145.00	16,259,000		
ヤマトインターナシヨナル	5,700	337.00	1,920,900	貸付株式数	100株
東邦ホールディングス	21,200	1,903.00	40,343,600		
サンゲツ	17,700	1,465.00	25,930,500		
ミツウロコグループ	9,800	1,292.00	12,661,600	貸付株式数	3,700株
シナネンホールディングス	2,800	2,958.00	8,282,400	貸付株式数	400株
伊藤忠エネクス	14,700	1,000.00	14,700,000		
サンリオ	18,600	1,575.00	29,295,000	貸付株式数	300株
サンワ　テクノス	4,700	941.00	4,422,700		
リョーサン	7,200	1,855.00	13,356,000		
新光商事	10,000	768.00	7,680,000		
トーホー	3,000	2,034.00	6,102,000	貸付株式数	100株
三信電気	3,600	2,146.00	7,725,600		
東陽テクニカ	7,400	1,058.00	7,829,200		
モスフード　サービス	8,700	2,703.00	23,516,100	貸付株式数	3,100株
加賀電子	6,600	2,165.00	14,289,000	貸付株式数	500株
三益半導体	5,300	2,800.00	14,840,000		
ソーダニツカ	6,800	540.00	3,672,000	貸付株式数	600株
立花エレテック	4,900	1,647.00	8,070,300	貸付株式数	1,600株
木曽路	8,800	2,359.00	20,759,200	貸付株式数	1,800株
ＳＲＳホールディングス	8,100	868.00	7,030,800	貸付株式数	3,100株
千　趣　会	12,200	332.00	4,050,400	貸付株式数	4,800株
タカキユー	6,100	139.00	847,900	貸付株式数	2,200株 (1,600株)
リテールパートナーズ	8,900	1,481.00	13,180,900	貸付株式数	400株
ケーヨー	13,700	742.00	10,165,400		
上新電機	7,700	2,742.00	21,113,400	貸付株式数	2,800株
日本瓦斯	10,500	5,280.00	55,440,000		
ロイヤルホールディングス	11,700	1,782.00	20,849,400	貸付株式数	4,600株
東　天　紅	500	926.00	463,000		
いなげや	8,200	2,039.00	16,719,800		
島　忠	12,500	5,480.00	68,500,000	貸付株式数	5,000株
チヨダ	7,000	893.00	6,251,000	貸付株式数	2,800株
ライフコーポレーション	5,100	3,685.00	18,793,500	貸付株式数	2,000株
リンガーハツト	8,300	2,212.00	18,359,600	貸付株式数	3,100株 (1,700株)
ＭｒＭａｘＨＤ	9,200	854.00	7,856,800		

テンアライド	5,900	350.00	2,065,000	貸付株式数	2,300株
ＡＯＫＩホールディングス	13,500	409.00	5,521,500		
オークワ	10,500	1,339.00	14,059,500		
コメリ	10,300	2,835.00	29,200,500		
青山商事	13,800	446.00	6,154,800	貸付株式数	5,500株
しまむら	7,700	10,800.00	83,160,000		
はせがわ	3,400	296.00	1,006,400	貸付株式数	300株
高　島　屋	48,700	803.00	39,106,100	貸付株式数	19,500株
松　屋	13,500	719.00	9,706,500	貸付株式数	2,800株
エイチ・ツー・オーリテイリング	31,800	643.00	20,447,400		
近鉄百貨店	2,500	3,295.00	8,237,500	貸付株式数	1,000株
丸井グループ	60,800	1,906.00	115,884,800		
クレディセゾン	46,600	1,195.00	55,687,000		
アクシアル　リテイリング	5,500	4,745.00	26,097,500		
井　筒　屋	4,000	179.00	716,000		
イオン	254,900	3,105.00	791,464,500	貸付株式数	102,600株
イ　ズ　ミ	13,500	3,600.00	48,600,000	貸付株式数	5,400株
フオーバル	2,900	879.00	2,549,100	貸付株式数	100株
平　和　堂	13,400	2,124.00	28,461,600	貸付株式数	5,200株
フ　ジ	8,000	1,921.00	15,368,000	貸付株式数	2,100株
ヤオコー	7,600	7,140.00	54,264,000	貸付株式数	3,000株
ゼビオホールディングス	8,000	760.00	6,080,000	貸付株式数	3,200株
ケーズホールディングス	64,000	1,268.00	81,152,000	貸付株式数	25,700株
ＰＡＬＴＡＣ	10,600	5,980.00	63,388,000		
三谷産業	8,700	423.00	3,680,100		
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,400	1,000.00	3,400,000	貸付株式数	1,300株
日産東京販売ＨＤ	9,700	250.00	2,425,000		
新生銀行	48,900	1,242.00	60,733,800		
あおぞら銀行	39,800	1,895.00	75,421,000		
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ ※	4,537,800	448.50	2,035,203,300		
りそなホールディングス	722,200	365.70	264,108,540		
三井住友トラストＨＤ	125,400	3,051.00	382,595,400		
三井住友フィナンシャルＧ ※	458,800	3,032.00	1,391,081,600		
千葉銀行	221,400	592.00	131,068,800		
群馬銀行	127,500	325.00	41,437,500		
武蔵野銀行	9,900	1,588.00	15,721,200		
千葉興業銀行	18,000	263.00	4,734,000		

筑波銀行	28,100	196.00	5,507,600		
七十七銀行	22,400	1,466.00	32,838,400		
青森銀行	5,200	2,433.00	12,651,600		
秋田銀行	4,300	1,393.00	5,989,900	貸付株式数	1,600株
山形銀行	7,500	1,181.00	8,857,500	貸付株式数	3,000株
岩手銀行	4,400	2,216.00	9,750,400		
東邦銀行	59,500	227.00	13,506,500		
東北銀行	3,100	1,076.00	3,335,600	貸付株式数	1,000株
みちのく銀行	4,400	1,183.00	5,205,200		
ふくおかフィナンシャルG	56,000	1,863.00	104,328,000		
静岡銀行	161,600	742.00	119,907,200		
十六銀行	8,300	1,983.00	16,458,900		
スルガ銀行	63,000	337.00	21,231,000		
八十二銀行	160,200	371.00	59,434,200		
山梨中央銀行	7,800	739.00	5,764,200		
大垣共立銀行	13,100	2,348.00	30,758,800		
福井銀行	5,700	1,995.00	11,371,500		
北國銀行	6,600	2,884.00	19,034,400		
清水銀行	2,700	1,890.00	5,103,000		
富山銀行	1,300	3,460.00	4,498,000		
滋賀銀行	13,300	2,373.00	31,560,900	貸付株式数	1,900株
南都銀行	11,200	1,871.00	20,955,200		
百五銀行	59,500	317.00	18,861,500		
京都銀行	23,800	5,210.00	123,998,000	貸付株式数	9,500株
紀陽銀行	23,500	1,590.00	37,365,000	貸付株式数	2,100株
ほくほくフィナンシャルG	44,000	1,037.00	45,628,000	貸付株式数	1,200株
山陰合同銀行	39,500	545.00	21,527,500		
中国銀行	57,000	921.00	52,497,000	貸付株式数	9,900株
鳥取銀行	2,200	1,185.00	2,607,000		
伊予銀行	94,800	692.00	65,601,600		
百十四銀行	7,100	1,618.00	11,487,800	貸付株式数	1,700株
四国銀行	10,200	708.00	7,221,600	貸付株式数	2,700株
阿波銀行	10,800	2,568.00	27,734,400	貸付株式数	400株
大分銀行	3,900	2,325.00	9,067,500		
宮崎銀行	4,500	2,300.00	10,350,000		
佐賀銀行	4,000	1,370.00	5,480,000	貸付株式数	300株
沖縄銀行	6,100	2,953.00	18,013,300	貸付株式数	600株
琉球銀行	15,500	873.00	13,531,500		
セブン銀行	222,800	229.00	51,021,200	貸付株式数	51,800株
みずほフィナンシャルG	901,100	1,327.50	1,196,210,250		

高知銀行	2,500	786.00	1,965,000		
山口フィナンシャルＧ	82,600	652.00	53,855,200		
芙蓉総合リース	7,000	6,380.00	44,660,000		
みずほリース	10,200	2,777.00	28,325,400		
東京センチュリー	13,400	6,910.00	92,594,000	貸付株式数	3,000株
ＳＢＩホールディングス	75,100	2,830.00	212,533,000	貸付株式数	4,400株
日本証券金融	29,500	500.00	14,750,000	貸付株式数	7,900株
アイフル	102,000	267.00	27,234,000		
日本アジア投資	6,300	225.00	1,417,500		
長野銀行	2,100	1,450.00	3,045,000		
名古屋銀行	5,100	2,706.00	13,800,600		
北洋銀行	101,000	233.00	23,533,000		
愛知銀行	2,400	3,080.00	7,392,000		
中京銀行	2,700	2,139.00	5,775,300	貸付株式数	1,000株
大光銀行	2,200	1,253.00	2,756,600		
愛媛銀行	9,000	1,075.00	9,675,000	貸付株式数	2,200株
トマト銀行	2,500	1,101.00	2,752,500		
京葉銀行	28,000	457.00	12,796,000		
栃木銀行	31,600	183.00	5,782,800		
北日本銀行	2,000	2,041.00	4,082,000		
東和銀行	11,700	642.00	7,511,400	貸付株式数	1,500株
福島銀行	7,300	225.00	1,642,500	貸付株式数	2,500株
大東銀行	3,300	615.00	2,029,500		
リコーリース	5,200	2,901.00	15,085,200	貸付株式数	2,100株
イオンフィナンシャルサービス	40,900	1,138.00	46,544,200	貸付株式数	16,400株
ア　コ　ム	133,000	501.00	66,633,000		
ジャックス	7,400	1,816.00	13,438,400		
オ　リ　コ	180,900	115.00	20,803,500		
日立キャピタル	15,700	2,394.00	37,585,800		
オリックス	411,500	1,553.00	639,059,500		
三菱ＵＦＪリース	167,900	479.00	80,424,100		
ジャフコ　グループ	10,300	4,480.00	46,144,000		
九州　リースサービス	2,900	608.00	1,763,200	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	51,500	334.00	17,201,000		
大和証券Ｇ本社	534,400	454.10	242,671,040		
野村ホールディングス	1,166,900	524.00	611,455,600		
岡三証券グループ	56,400	369.00	20,811,600	貸付株式数	2,500株
丸三証券	19,700	474.00	9,337,800		
東洋証券	24,300	133.00	3,231,900	貸付株式数	500株

東海東京ＨＤ	76,600	308.00	23,592,800	貸付株式数	30,600株
光世証券	1,800	682.00	1,227,600		
水戸証券	19,100	236.00	4,507,600	貸付株式数	7,200株
いちよし証券	12,200	470.00	5,734,000		
松井証券	37,700	840.00	31,668,000		
ＳＯＭＰＯホールディングス	124,800	4,010.00	500,448,000		
日本取引所グループ	190,600	2,583.50	492,415,100		
マネックスＧ	50,000	349.00	17,450,000	貸付株式数	19,900株
極東証券	8,700	722.00	6,281,400	貸付株式数	2,100株
岩井コスモホールディング	6,300	1,332.00	8,391,600		
藍澤證券	12,000	724.00	8,688,000		
フィデアホール	64,400	109.00	7,019,600		
池田泉州ＨＤ	76,900	152.00	11,688,800		
アニコム　ホールディングス	22,000	1,093.00	24,046,000		
ＭＳ＆ＡＤ	173,500	3,035.00	526,572,500		
マネーパートナーズＧＰ	6,600	205.00	1,353,000		
スパークス・グループ	30,800	235.00	7,238,000	貸付株式数	6,600株
小林洋行	2,800	266.00	744,800		
第一生命ＨＬＤＧＳ	375,500	1,644.50	617,509,750		
東京海上ＨＤ	234,600	5,190.00	1,217,574,000		
アドバンテッジリスクマネ	3,300	692.00	2,283,600	貸付株式数	1,300株
イー・ギャランティ	7,400	2,067.00	15,295,800	貸付株式数	400株
アサックス	3,500	706.00	2,471,000	貸付株式数	300株
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,700	1,813.00	4,895,100		
Ｔ＆Ｄホールディングス	198,400	1,219.00	241,849,600		
アドバンスクリエイト	1,600	1,920.00	3,072,000	貸付株式数	500株
三井不動産	322,400	2,181.50	703,315,600		
三菱地所	464,700	1,804.00	838,318,800		
平和不動産	12,200	3,420.00	41,724,000		
東京建物	65,300	1,433.00	93,574,900		
ダイビル	17,000	1,343.00	22,831,000	貸付株式数	6,800株
京阪神ビルディング	10,500	1,918.00	20,139,000	貸付株式数	400株
住友不動産	149,000	3,405.00	507,345,000		
太平洋興発	2,600	618.00	1,606,800	貸付株式数	300株
テーオーシー	12,500	639.00	7,987,500		
東京楽天地	1,100	4,355.00	4,790,500	貸付株式数	200株
スターツコーポレーション	8,900	2,819.00	25,089,100	貸付株式数	3,300株

フジ住宅	7,700	615.00	4,735,500	貸付株式数	2,200株
空港施設	6,300	464.00	2,923,200		
明和地所	4,000	533.00	2,132,000		
ゴールドクレスト	5,000	1,405.00	7,025,000	貸付株式数	2,000株
リログループ	35,200	2,913.00	102,537,600	貸付株式数	500株
エスリード	2,700	1,317.00	3,555,900		
日神グループＨＬＤＧＳ	10,300	377.00	3,883,100	貸付株式数	3,700株
日本エスコン	12,200	922.00	11,248,400		
タカラレーベン	30,200	296.00	8,939,200	貸付株式数	3,800株
ＡＶＡＮＴＩＡ	3,800	805.00	3,059,000	貸付株式数	600株
イオンモール	33,100	1,675.00	55,442,500	貸付株式数	13,300株
毎日コムネット	2,000	715.00	1,430,000		
ファースト住建	2,900	1,069.00	3,100,100	貸付株式数	1,100株 (100株)
ランド	378,100	9.00	3,402,900		
カチタス	16,500	3,100.00	51,150,000	貸付株式数	5,000株
東祥	4,000	1,330.00	5,320,000		
トーセイ	9,400	1,163.00	10,932,200	貸付株式数	3,700株
穴吹興産	1,500	1,681.00	2,521,500	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	9,400	921.00	8,657,400		
インテリックス	2,400	560.00	1,344,000	貸付株式数	100株
ランドビジネス	2,600	336.00	873,600		
サンネクスタグループ	1,900	1,025.00	1,947,500		
グランディハウス	5,300	380.00	2,014,000		
東武鉄道	70,000	3,130.00	219,100,000		
相鉄ホールディングス	21,400	2,549.00	54,548,600	貸付株式数	1,600株
東急	169,400	1,267.00	214,629,800		
京浜急行	86,200	1,787.00	154,039,400	貸付株式数	27,100株
小田急電鉄	100,000	3,165.00	316,500,000		
京王電鉄	34,900	7,410.00	258,609,000		
京成電鉄	46,800	3,505.00	164,034,000		
富士急行	9,200	4,825.00	44,390,000	貸付株式数	3,600株
新京成電鉄	1,700	2,150.00	3,655,000	貸付株式数	600株
東日本旅客鉄道	118,400	6,488.00	768,179,200		
西日本旅客鉄道	60,000	4,764.00	285,840,000		
東海旅客鉄道	55,900	13,300.00	743,470,000		
西武ホールディングス	88,200	1,035.00	91,287,000		
鴻池運輸	10,600	1,037.00	10,992,200		
西日本鉄道	18,600	2,959.00	55,037,400	貸付株式数	4,200株
ハマキョウレックス	5,200	2,921.00	15,189,200		

サカイ引越センター	3,600	5,170.00	18,612,000		
近鉄グループＨＬＤＧＳ	63,700	4,630.00	294,931,000		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	84,700	3,410.00	288,827,000		
南海電鉄	30,100	2,622.00	78,922,200	貸付株式数	4,800株
京阪ホールディングス	28,300	4,915.00	139,094,500	貸付株式数	3,100株
神戸電鉄	1,500	3,595.00	5,392,500		
名古屋鉄道	52,300	2,872.00	150,205,600	貸付株式数	5,300株
山陽電鉄	4,600	2,033.00	9,351,800		
トランコム	1,800	8,380.00	15,084,000		
日本通運	22,000	6,980.00	153,560,000		
ヤマトホールディングス	111,800	2,637.00	294,816,600		
山　九	17,700	3,845.00	68,056,500		
日　新	5,600	1,212.00	6,787,200		
丸　運	3,500	248.00	868,000	貸付株式数	800株
丸全昭和運輸	5,200	3,345.00	17,394,000	貸付株式数	800株
センコーグループＨＬＤＧＳ	35,100	970.00	34,047,000	貸付株式数	13,900株
トナミホールディングス	1,500	5,850.00	8,775,000		
ニッコンホールディングス	22,700	2,032.00	46,126,400		
日石輸送	600	2,583.00	1,549,800		
福山通運	8,100	4,630.00	37,503,000	貸付株式数	2,100株
セイノーホールディングス	47,800	1,462.00	69,883,600		
エスライン	2,000	932.00	1,864,000	貸付株式数	500株
神奈川中央交通	1,600	3,860.00	6,176,000	貸付株式数	500株
日立物流	11,700	3,110.00	36,387,000		
丸和運輸機関	6,800	4,625.00	31,450,000		
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	6,400	1,858.00	11,891,200		
日本郵船	53,400	2,276.00	121,538,400		
商船三井	40,400	2,728.00	110,211,200		
川崎汽船	19,700	1,689.00	33,273,300	貸付株式数	7,800株
ＮＳユナイテッド海運	3,600	1,325.00	4,770,000		
明治海運	6,600	409.00	2,699,400		
飯野海運	30,200	387.00	11,687,400		
共栄タンカー	1,200	816.00	979,200		
九州旅客鉄道	55,900	2,198.00	122,868,200		
ＳＧホールディングス	133,900	3,120.00	417,768,000		
日本航空	142,600	1,977.00	281,920,200		
ＡＮＡホールディングス	116,600	2,517.50	293,540,500		
パスコ	1,300	1,283.00	1,667,900		

西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,200	2,255.00	2,706,000	貸付株式数	400株
シルバーライフ	900	1,970.00	1,773,000		
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	700	1,419.00	993,300	貸付株式数	100株
一家ダイニングプロジ	500	551.00	275,500	貸付株式数	200株
ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	2,900	4,150.00	12,035,000		
国際紙パルプ商事	15,900	255.00	4,054,500		
ナルミヤ・インターナショナル	1,400	751.00	1,051,400		
ブックオフＧＨＤ	3,900	839.00	3,272,100	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,200	2,990.00	60,398,000		
三井倉庫ＨＯＬＤ	7,400	2,247.00	16,627,800		
住友倉庫	22,600	1,350.00	30,510,000		
渋沢倉庫	3,500	2,246.00	7,861,000		
ヤマタネ	3,300	1,371.00	4,524,300		
東陽倉庫	11,300	304.00	3,435,200		
乾汽船	3,700	938.00	3,470,600	貸付株式数	100株
日本トランスシティ	13,800	566.00	7,810,800	貸付株式数	2,800株
ケイヒン	1,200	1,379.00	1,654,800	貸付株式数	300株
中央倉庫	3,900	1,200.00	4,680,000		
川西倉庫	1,100	1,141.00	1,255,100	貸付株式数	100株
安田倉庫	5,100	988.00	5,038,800		
ファイズホールディングス	1,400	1,111.00	1,555,400	貸付株式数	500株
東洋埠頭	2,000	1,444.00	2,888,000		
宇徳	5,500	463.00	2,546,500	貸付株式数	1,200株
上　組	35,600	1,805.00	64,258,000		
サンリツ	1,500	683.00	1,024,500		
キムラユニティー	1,600	1,032.00	1,651,200		
キユーソー流通システム	1,600	1,650.00	2,640,000	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	13,600	2,170.00	29,512,000	貸付株式数	5,400株
東海運	3,600	306.00	1,101,600	貸付株式数	1,300株
エーアイテイー	4,500	994.00	4,473,000		
内外トランスライン	2,100	1,270.00	2,667,000	貸付株式数	800株
ショーエイコーポ	900	1,027.00	924,300	貸付株式数	300株
日本コンセプト	2,000	1,743.00	3,486,000	貸付株式数	500株
ＴＢＳホールディングス	40,000	1,869.00	74,760,000		
日本テレビＨＬＤＳ	54,900	1,137.00	62,421,300	貸付株式数	22,000株
朝日放送グループＨＤ	6,400	693.00	4,435,200	貸付株式数	2,500株

テレビ朝日ＨＤ	18,100	1,684.00	30,480,400	貸付株式数	7,300株
スカパーＪＳＡＴＨＤ	43,600	473.00	20,622,800		
テレビ東京ＨＤ	5,400	2,349.00	12,684,600	貸付株式数	600株
日本ＢＳ放送	2,100	1,062.00	2,230,200	貸付株式数	800株
ビジョン	6,700	1,156.00	7,745,200	貸付株式数	2,400株
スマートバリュー	1,800	965.00	1,737,000	貸付株式数	600株
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	2,600	1,354.00	3,520,400	貸付株式数	1,000株
ワイヤレスゲート	3,200	650.00	2,080,000	貸付株式数	700株
コネクシオ	3,800	1,227.00	4,662,600		
日本通信	51,700	203.00	10,495,100	貸付株式数	19,600株
クロップス	1,300	804.00	1,045,200		
日本電信電話	882,200	2,465.00	2,174,623,000		
ＫＤＤＩ	481,200	2,982.50	1,435,179,000		
ソフトバンク	600,700	1,284.50	771,599,150		
光通信	6,800	25,070.00	170,476,000		
エムティーアイ	6,400	842.00	5,388,800		
ＧＭＯインターネット	24,000	2,936.00	70,464,000		
ファイバーゲート	2,100	2,128.00	4,468,800	貸付株式数	800株
アイドママーケティングコミュ	2,100	381.00	800,100		
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	17,900	3,310.00	59,249,000		
学研ホールディングス	8,900	1,634.00	14,542,600		
ゼンリン	13,300	1,296.00	17,236,800		
昭文社ホールディングス	3,100	491.00	1,522,100	貸付株式数	1,200株
インプレスホールディングス	5,300	174.00	922,200		
東京電力ＨＤ	537,100	272.00	146,091,200	貸付株式数	66,000株
中部電力	205,500	1,257.50	258,416,250		
関西電力	254,500	955.30	243,123,850		
中国電力	97,100	1,327.00	128,851,700		
北陸電力	61,400	735.00	45,129,000	貸付株式数	1,300株
東北電力	167,700	875.00	146,737,500		
四国電力	60,400	710.00	42,884,000		
九州電力	138,500	881.00	122,018,500		
北海道電力	63,600	392.00	24,931,200		
沖縄電力	13,200	1,451.00	19,153,200		
電源開発	53,500	1,404.00	75,114,000		
エフオン	3,700	1,180.00	4,366,000	貸付株式数	1,200株
イーレックス	9,700	1,964.00	19,050,800	貸付株式数	3,800株

レノバ	11,300	2,590.00	29,267,000	貸付株式数	4,500株
東京瓦斯	129,400	2,344.50	303,378,300		
大阪瓦斯	130,500	2,004.00	261,522,000		
東邦瓦斯	33,100	6,830.00	226,073,000	貸付株式数	13,300株
北海道瓦斯	3,600	1,520.00	5,472,000		
広島ガス	14,200	371.00	5,268,200	貸付株式数	4,500株
西部瓦斯	7,500	3,550.00	26,625,000		
静岡ガス	19,300	989.00	19,087,700	貸付株式数	2,200株
メタウォーター	6,600	2,363.00	15,595,800		
アイネット	3,400	1,488.00	5,059,200	貸付株式数	1,300株
松　竹	4,400	13,010.00	57,244,000	貸付株式数	600株
東　宝	39,000	4,420.00	172,380,000		
エイチ・アイ・エス	10,100	1,610.00	16,261,000	貸付株式数	4,000株
東　映	2,500	16,740.00	41,850,000	貸付株式数	500株
ラックランド	1,500	2,336.00	3,504,000	貸付株式数	600株
ＮＴＴデータ	175,500	1,388.00	243,594,000		
共立メンテナンス	10,700	3,635.00	38,894,500		
イチネンホールディングス	7,200	1,312.00	9,446,400	貸付株式数	2,800株
建設技術研究所	4,200	2,115.00	8,883,000		
スペース	4,100	807.00	3,308,700		
長　大	2,500	1,303.00	3,257,500		
アインホールディングス	8,200	7,110.00	58,302,000	貸付株式数	3,100株
燦ホールディングス	2,800	1,220.00	3,416,000	貸付株式数	300株
ピー・シー・エー	1,100	4,535.00	4,988,500	貸付株式数	400株 (400株)
スバル興業	400	8,130.00	3,252,000		
東京テアトル	3,100	1,288.00	3,992,800	貸付株式数	900株
タナベ経営	1,100	1,318.00	1,449,800		
ビジネスＢ太田昭和	2,200	1,727.00	3,799,400	貸付株式数	200株
ナ　ガ　ワ	2,000	9,140.00	18,280,000	貸付株式数	200株
よみうりランド	1,400	6,040.00	8,456,000	貸付株式数	500株
東京都競馬	4,200	5,170.00	21,714,000	貸付株式数	1,600株
常磐興産	2,600	1,453.00	3,777,800	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,700	2,173.00	23,251,100	貸付株式数	4,200株
東京ドーム	26,400	1,347.00	35,560,800	貸付株式数	7,000株
ＤＴＳ	14,800	2,200.00	32,560,000		
スクウェア・エニックス・ＨＤ	28,200	6,410.00	180,762,000	貸付株式数	11,300株
シーイーシー	7,100	1,517.00	10,770,700		
カプコン	31,200	5,880.00	183,456,000		

西尾レントオール	6,000	2,033.00	12,198,000		
アイ・エス・ビー	1,400	2,993.00	4,190,200		
アゴーラ・ホスピタリティーG	47,500	24.00	1,140,000		
日本空港ビルデング	21,200	6,080.00	128,896,000	貸付株式数	8,500株
トランス・コスモス	6,200	2,700.00	16,740,000		
乃村工藝社	27,700	780.00	21,606,000		
ジャステック	4,200	1,365.00	5,733,000	貸付株式数	1,600株
ＳＣＳＫ	15,200	6,230.00	94,696,000	貸付株式数	200株
藤田観光	2,900	1,475.00	4,277,500	貸付株式数	1,100株 (100株)
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	3,900	889.00	3,467,100	貸付株式数	1,500株
日本管財	6,900	2,074.00	14,310,600		
トーカイ	6,200	2,033.00	12,604,600		
白　洋　舎	800	2,447.00	1,957,600	貸付株式数	300株
セコム	68,200	10,395.00	708,939,000		
日本システムウエア	2,200	2,103.00	4,626,600		
セントラル警備保障	3,100	3,475.00	10,772,500		
アイネス	6,500	1,424.00	9,256,000		
丹青社	12,200	762.00	9,296,400		
メイテツク	8,000	4,805.00	38,440,000		
ＴＫＣ	5,600	6,940.00	38,864,000	貸付株式数	900株
富士ソフト	7,100	5,060.00	35,926,000	貸付株式数	2,800株
応用地質	6,900	1,215.00	8,383,500		
船井総研ホールディン	13,300	2,516.00	33,462,800		
ＮＳＤ	21,200	1,995.00	42,294,000		
進学会ホールディングス	2,500	445.00	1,112,500	貸付株式数	100株
丸紅建材リース	700	1,724.00	1,206,800		
オ　オ　バ	4,800	753.00	3,614,400	貸付株式数	1,100株
コナミホールディングス	24,000	5,470.00	131,280,000		
いであ	1,500	1,736.00	2,604,000	貸付株式数	600株
学　究　社	1,800	1,212.00	2,181,600	貸付株式数	100株
ベネッセホールディングス	21,500	2,192.00	47,128,000		
イオンディライト	7,900	2,634.00	20,808,600		
ナック	3,600	915.00	3,294,000	貸付株式数	600株
福井コンピュータＨＬＤＳ	2,600	3,355.00	8,723,000	貸付株式数	1,000株
ダイセキ	10,800	2,961.00	31,978,800		
ステップ	2,400	1,561.00	3,746,400	貸付株式数	900株
日鉄物産	4,700	3,550.00	16,685,000		

泉州電業	2,000	2,875.00	5,750,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,700	2,325.00	3,952,500	貸付株式数	100株
トラスコ中山	14,900	2,606.00	38,829,400	貸付株式数	4,200株
ヤマダホールディングス	201,900	496.00	100,142,400	貸付株式数	61,200株
オートバックスセブン	24,600	1,296.00	31,881,600		
モリト	4,900	612.00	2,998,800		
アークランドサカモト	10,500	1,789.00	18,784,500		
ニトリホールディングス	28,700	22,230.00	638,001,000		
グルメ杵屋	4,700	981.00	4,610,700	貸付株式数	1,800株 (200株)
愛　眼	5,400	226.00	1,220,400	貸付株式数	2,100株
ケーユーホールディングス	2,900	801.00	2,322,900	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	22,000	1,906.00	41,932,000	貸付株式数	8,500株
加藤産業	9,600	3,455.00	33,168,000	貸付株式数	2,300株
北恵	1,600	953.00	1,524,800	貸付株式数	600株
イノテック	3,800	906.00	3,442,800		
イエローハット	12,600	1,610.00	20,286,000	貸付株式数	5,000株
松屋フーズＨＬＤＧＳ	3,200	3,430.00	10,976,000		
ＪＢＣＣホールディングス	4,500	1,481.00	6,664,500		
ＪＫホールディングス	6,000	810.00	4,860,000	貸付株式数	2,100株
サガミホールディングス	8,900	1,243.00	11,062,700	貸付株式数	3,100株
日　伝	6,000	2,358.00	14,148,000	貸付株式数	2,200株
関西スーパーマーケット	5,500	1,252.00	6,886,000	貸付株式数	800株
ミロク情報サービス	5,900	2,039.00	12,030,100	貸付株式数	1,300株 (400株)
北沢産業	5,200	280.00	1,456,000		
杉本商事	3,500	2,385.00	8,347,500	貸付株式数	1,100株
因幡電機産業	18,800	2,397.00	45,063,600	貸付株式数	3,600株
王将フードサービス	4,900	6,000.00	29,400,000		
プレナス	7,200	1,737.00	12,506,400	貸付株式数	1,100株
ミニストップ	5,000	1,350.00	6,750,000	貸付株式数	1,700株
アークス	13,600	2,182.00	29,675,200		
バローホールディングス	14,700	2,592.00	38,102,400		
東　テ　ク	2,200	2,520.00	5,544,000		
ミスミグループ本社	83,000	3,275.00	271,825,000	貸付株式数	3,800株
藤　　久	1,200	891.00	1,069,200	貸付株式数	400株
アルテック	5,600	292.00	1,635,200		
ベ　ル　ク	3,300	6,110.00	20,163,000		
大　庄	3,500	960.00	3,360,000	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	2,000	1,874.00	3,748,000	貸付株式数	700株

ファーストリテイリング	8,900	85,940.00	764,866,000		
ソフトバンクグループ	523,900	7,272.00	3,809,800,800		
蔵王産業	1,100	1,308.00	1,438,800		
スズケン	28,000	3,990.00	111,720,000	貸付株式数	1,300株
サンドラッグ	25,000	4,380.00	109,500,000		
サックスバーホールディング	5,500	531.00	2,920,500	貸付株式数	2,200株
ジェコス	4,500	957.00	4,306,500		
ヤマザワ	1,400	1,726.00	2,416,400	貸付株式数	500株
や　ま　や	1,300	2,110.00	2,743,000		
グローセル	6,500	420.00	2,730,000		
ベルーナ	14,400	956.00	13,766,400	貸付株式数	5,700株
合計			163,479,342,460		

（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
本田技研	30,000株	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	200,000株
三井住友フィナンシャルＧ	30,000株		

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	277,498,394	327,212,168
国債証券	71,946,332,660	79,869,797,660
地方債証券	4,253,511,900	4,128,711,500
特殊債券	3,020,630,000	3,097,138,700
社債券	2,898,205,400	2,777,936,600
未収入金	1,861,375,540	101,092,000
未収利息	188,754,567	196,593,327
前払費用	12,421,243	3,411,279
流動資産合計	84,458,729,704	90,501,893,234
資産合計	84,458,729,704	90,501,893,234
負債の部		
流動負債		
未払金	1,951,218,000	100,000,000
未払解約金	19,276,281	142,747,138
その他未払費用	134	－
流動負債合計	1,970,494,415	242,747,138
負債合計	1,970,494,415	242,747,138
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	57,670,399,195	63,632,169,674
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	24,817,836,094	26,626,976,422
元本等合計	82,488,235,289	90,259,146,096
純資産合計	82,488,235,289	90,259,146,096
負債純資産合計	84,458,729,704	90,501,893,234

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12月3日 至　2020年11月30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12月2日現在	2020年11月30日現在
1. ※1　期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	56,170,487,793円	57,670,399,195円
期中追加設定元本額	19,864,910,379円	27,218,615,082円
期中一部解約元本額	18,364,998,977円	21,256,844,603円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	109,396,910円	65,126,538円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	596,838,676円	505,967,183円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	82,263,337円	62,478,037円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	882,267,553円	718,126,297円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	7,293,354,645円	8,503,141,748円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	11,302,866,367円	10,269,709,415円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,855,649,526円	1,737,338,049円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	265,692,526円	226,910,962円

ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	369,416,535円	339,059,642円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	81,822,975円	90,548,180円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	21,258,481,478円	23,601,367,986円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	3,005,941,387円	6,701,446,457円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	1,491,311,778円	1,691,971,743円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,129,962,205円	1,058,268,870円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,866,925,426円	6,961,101,317円
ダイワライフスタイル２５	450,390,874円	459,018,956円
ダイワライフスタイル５０	491,002,347円	504,172,138円
ダイワライフスタイル７５	136,814,650円	136,416,156円
計	57,670,399,195円	63,632,169,674円
2. 期末日における受益権の総数	57,670,399,195口	63,632,169,674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12月3日 至 2020年11月30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11月30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	2019年12月2日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	772,340,790	△1,166,650,040
地方債証券	2,883,500	△30,019,100
特殊債券	△5,121,500	△22,302,900
社債券	3,077,600	△16,802,200
合計	773,180,390	△1,235,774,240

（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12月2日まで、及び2019年12月3日から2020年11月30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12月2日現在	2020年11月30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12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4303円 (14,303円)	1.4185円 (14,185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	４０７　２年国債	100,000,000	100,230,000	
	４０８　２年国債	150,000,000	150,382,500	
	４０９　２年国債	50,000,000	50,137,500	
	４１０　２年国債	2,000,000,000	2,006,360,000	
	４１３　２年国債	60,000,000	60,225,000	
	４１５　２年国債	750,000,000	753,067,500	
	４１７　２年国債	100,000,000	100,450,000	
	１３１　５年国債	1,170,000,000	1,173,346,200	
	１３２　５年国債	880,000,000	883,071,200	
	１３３　５年国債	550,000,000	552,381,500	
	１３４　５年国債	870,000,000	874,289,100	
	１３５　５年国債	1,700,000,000	1,709,401,000	
	１３６　５年国債	950,000,000	955,709,500	
	１３７　５年国債	700,000,000	704,725,000	
	１３８　５年国債	900,000,000	907,029,000	
	１３９　５年国債	850,000,000	856,757,500	
	１４０　５年国債	900,000,000	907,704,000	
	１４１　５年国債	920,000,000	928,436,400	
	１４２　５年国債	430,000,000	434,115,100	
	１４３　５年国債	650,000,000	656,461,000	
	１４４　５年国債	1,085,000,000	1,095,915,100	
	１　４０年国債	70,000,000	102,314,800	
	２　４０年国債	110,000,000	155,778,700	
	３　４０年国債	150,000,000	212,988,000	
	４　４０年国債	107,000,000	152,652,620	
	５　４０年国債	125,000,000	172,705,000	
	６　４０年国債	105,000,000	143,091,900	
	７　４０年国債	121,000,000	158,820,970	
	８　４０年国債	230,000,000	282,336,500	
	９　４０年国債	220,000,000	201,889,600	

１０　４０年国債	345,000,000	370,875,000	
１１　４０年国債	320,000,000	333,408,000	
１２　４０年国債	350,000,000	329,353,500	
１３　４０年国債	310,000,000	291,338,000	
３１９　１０年国債	100,000,000	101,279,000	
３２１　１０年国債	175,000,000	177,548,000	
３２２　１０年国債	130,000,000	131,723,800	
３２３　１０年国債	380,000,000	386,049,600	
３２５　１０年国債	310,000,000	315,208,000	
３２６　１０年国債	30,000,000	30,512,100	
３２７　１０年国債	450,000,000	458,608,500	
３２８　１０年国債	350,000,000	355,890,500	
３２９　１０年国債	500,000,000	511,900,000	
３３０　１０年国債	612,000,000	628,095,600	
３３１　１０年国債	365,000,000	372,544,550	
３３２　１０年国債	250,000,000	255,630,000	
３３３　１０年国債	700,000,000	717,045,000	
３３４　１０年国債	900,000,000	923,436,000	
３３５　１０年国債	690,000,000	706,608,300	
３３６　１０年国債	275,000,000	282,056,500	
３３７　１０年国債	400,000,000	407,004,000	
３３８　１０年国債	580,000,000	593,287,800	
３３９　１０年国債	590,000,000	604,036,100	
３４０　１０年国債	760,000,000	778,711,200	
３４１　１０年国債	500,000,000	510,280,000	
３４２　１０年国債	1,080,000,000	1,091,502,000	
３４３　１０年国債	680,000,000	687,588,800	
３４４　１０年国債	820,000,000	829,569,400	
３４５　１０年国債	650,000,000	657,910,500	
３４６　１０年国債	700,000,000	708,869,000	
３４７　１０年国債	950,000,000	962,521,000	
３４８　１０年国債	600,000,000	608,214,000	
３４９　１０年国債	1,050,000,000	1,064,532,000	
３５０　１０年国債	700,000,000	709,765,000	
３５１　１０年国債	800,000,000	810,936,000	
３５２　１０年国債	750,000,000	759,997,500	
３５３　１０年国債	580,000,000	587,505,200	
３５４　１０年国債	600,000,000	607,494,000	
３５５　１０年国債	690,000,000	698,286,900	

３５６　１０年国債	510,000,000	515,849,700	
３５７　１０年国債	720,000,000	727,502,400	
３５８　１０年国債	580,000,000	585,660,800	
３５９　１０年国債	1,128,000,000	1,137,678,240	
３６０　１０年国債	120,000,000	120,879,600	
１　３０年国債	16,000,000	19,978,720	
２　３０年国債	24,000,000	29,338,800	
３　３０年国債	30,000,000	36,531,300	
４　３０年国債	36,000,000	46,270,080	
５　３０年国債	28,000,000	34,285,160	
６　３０年国債	24,000,000	30,103,920	
７　３０年国債	55,000,000	68,833,050	
８　３０年国債	27,000,000	32,412,420	
９　３０年国債	43,000,000	49,597,490	
１０　３０年国債	45,000,000	50,314,050	
１１　３０年国債	40,000,000	47,755,200	
１２　３０年国債	60,000,000	74,837,400	
１３　３０年国債	75,000,000	92,820,750	
１４　３０年国債	82,000,000	105,986,640	
１５　３０年国債	50,000,000	65,517,500	
１６　３０年国債	250,000,000	328,777,500	
１７　３０年国債	130,000,000	169,669,500	
１８　３０年国債	80,000,000	103,569,600	
１９　３０年国債	57,000,000	73,976,880	
２１　３０年国債	60,000,000	78,239,400	
２２　３０年国債	170,000,000	227,366,500	
２４　３０年国債	92,000,000	123,750,120	
２５　３０年国債	150,000,000	197,455,500	
２６　３０年国債	180,000,000	240,417,000	
２７　３０年国債	150,000,000	203,929,500	
２８　３０年国債	170,000,000	232,267,600	
２９　３０年国債	200,000,000	271,208,000	
３０　３０年国債	220,000,000	295,809,800	
３１　３０年国債	300,000,000	399,672,000	
３２　３０年国債	285,000,000	386,514,150	
３３　３０年国債	200,000,000	261,112,000	
３４　３０年国債	270,000,000	363,976,200	
３５　３０年国債	300,000,000	394,074,000	
３６　３０年国債	350,000,000	461,265,000	

３７　３０年国債	200,000,000	260,422,000	
３８　３０年国債	200,000,000	257,060,000	
３９　３０年国債	230,000,000	300,738,800	
４０　３０年国債	200,000,000	257,434,000	
４１　３０年国債	170,000,000	215,279,500	
４２　３０年国債	205,000,000	259,858,000	
４３　３０年国債	200,000,000	253,774,000	
４４　３０年国債	200,000,000	254,022,000	
４５　３０年国債	200,000,000	245,310,000	
４６　３０年国債	140,000,000	171,820,600	
４７　３０年国債	400,000,000	500,588,000	
４８　３０年国債	130,000,000	156,855,400	
４９　３０年国債	120,000,000	144,849,600	
５０　３０年国債	200,000,000	212,996,000	
５１　３０年国債	240,000,000	226,812,000	
５２　３０年国債	300,000,000	297,282,000	
５３　３０年国債	250,000,000	253,425,000	
５４　３０年国債	310,000,000	328,937,900	
５５　３０年国債	260,000,000	275,696,200	
５６　３０年国債	100,000,000	105,963,000	
５７　３０年国債	230,000,000	243,540,100	
５８　３０年国債	370,000,000	391,023,400	
５９　３０年国債	300,000,000	309,285,000	
６０　３０年国債	210,000,000	226,902,900	
６１　３０年国債	200,000,000	205,542,000	
６２　３０年国債	200,000,000	194,924,000	
６３　３０年国債	230,000,000	217,724,900	
６４　３０年国債	330,000,000	311,493,600	
６５　３０年国債	200,000,000	188,472,000	
６６　３０年国債	235,000,000	220,810,700	
６７　３０年国債	164,000,000	162,571,560	
６８　３０年国債	70,000,000	69,212,500	
５３　２０年国債	66,000,000	67,539,780	
５４　２０年国債	65,000,000	66,584,700	
５５　２０年国債	140,000,000	143,868,200	
５８　２０年国債	200,000,000	207,336,000	
５９　２０年国債	45,000,000	46,694,250	
６０　２０年国債	10,000,000	10,314,800	
６１　２０年国債	100,000,000	102,617,000	

６２　２０年国債	95,000,000	97,273,350	
６３　２０年国債	130,000,000	136,437,600	
６４　２０年国債	90,000,000	95,152,500	
６５　２０年国債	175,000,000	185,913,000	
６６　２０年国債	185,000,000	195,970,500	
６７　２０年国債	55,000,000	58,708,100	
６８　２０年国債	120,000,000	129,283,200	
６９　２０年国債	110,000,000	118,145,500	
７０　２０年国債	83,000,000	90,489,920	
７１　２０年国債	125,000,000	135,388,750	
７２　２０年国債	105,000,000	113,926,050	
７３　２０年国債	120,000,000	130,384,800	
７４　２０年国債	73,000,000	79,614,530	
７５　２０年国債	80,000,000	87,692,800	
７６　２０年国債	51,000,000	55,463,010	
７７　２０年国債	130,000,000	141,937,900	
７８　２０年国債	61,000,000	66,622,370	
７９　２０年国債	50,000,000	54,837,500	
８０　２０年国債	53,000,000	58,369,960	
８２　２０年国債	87,000,000	96,259,410	
８３　２０年国債	93,000,000	103,388,100	
８５　２０年国債	58,000,000	64,797,020	
８６　２０年国債	80,000,000	90,227,200	
８７　２０年国債	55,000,000	61,738,050	
８８　２０年国債	100,000,000	113,396,000	
８９　２０年国債	78,000,000	88,012,860	
９０　２０年国債	20,000,000	22,684,800	
９１　２０年国債	60,000,000	68,404,200	
９２　２０年国債	310,000,000	351,524,500	
９３　２０年国債	100,000,000	113,310,000	
９４　２０年国債	130,000,000	148,127,200	
９５　２０年国債	50,000,000	57,912,500	
９６　２０年国債	55,000,000	62,978,300	
９７　２０年国債	40,000,000	46,285,200	
９８　２０年国債	320,000,000	368,092,800	
９９　２０年国債	100,000,000	115,542,000	
１００　２０年国債	155,000,000	181,010,550	
１０１　２０年国債	350,000,000	413,875,000	
１０３　２０年国債	170,000,000	200,659,500	

１０４　２０年国債	10,000,000	11,651,600	
１０５　２０年国債	126,000,000	147,393,540	
１０６　２０年国債	150,000,000	176,644,500	
１０７　２０年国債	90,000,000	105,728,400	
１０８　２０年国債	462,000,000	535,263,960	
１０９　２０年国債	55,000,000	63,936,950	
１１０　２０年国債	260,000,000	306,581,600	
１１１　２０年国債	200,000,000	238,438,000	
１１２　２０年国債	150,000,000	177,541,500	
１１３　２０年国債	310,000,000	368,276,900	
１１４　２０年国債	70,000,000	83,419,700	
１１５　２０年国債	180,000,000	216,138,600	
１１６　２０年国債	200,000,000	241,026,000	
１１７　２０年国債	200,000,000	239,164,000	
１１８　２０年国債	95,000,000	113,037,650	
１１９　２０年国債	93,000,000	108,883,470	
１２０　２０年国債	280,000,000	322,478,800	
１２１　２０年国債	200,000,000	236,670,000	
１２２　２０年国債	160,000,000	187,771,200	
１２３　２０年国債	200,000,000	241,368,000	
１２４　２０年国債	300,000,000	359,049,000	
１２５　２０年国債	130,000,000	158,798,900	
１２６　２０年国債	110,000,000	132,112,200	
１２７　２０年国債	165,000,000	196,475,400	
１２８　２０年国債	250,000,000	298,540,000	
１２９　２０年国債	100,000,000	118,366,000	
１３０　２０年国債	140,000,000	166,145,000	
１３１　２０年国債	150,000,000	176,403,000	
１３２　２０年国債	40,000,000	47,150,400	
１３３　２０年国債	430,000,000	511,583,900	
１３４　２０年国債	200,000,000	238,518,000	
１３５　２０年国債	92,000,000	108,687,880	
１３６　２０年国債	145,000,000	169,679,000	
１３８　２０年国債	100,000,000	116,118,000	
１３９　２０年国債	370,000,000	433,869,400	
１４０　２０年国債	400,000,000	474,656,000	
１４１　２０年国債	200,000,000	237,824,000	
１４２　２０年国債	240,000,000	288,242,400	
１４３　２０年国債	210,000,000	247,667,700	

	１４４　２０年国債	240,000,000	280,140,000	
	１４５　２０年国債	380,000,000	453,674,400	
	１４６　２０年国債	280,000,000	334,936,000	
	１４７　２０年国債	300,000,000	355,686,000	
	１４８　２０年国債	280,000,000	328,854,400	
	１４９　２０年国債	402,000,000	473,129,880	
	１５０　２０年国債	200,000,000	233,018,000	
	１５１　２０年国債	400,000,000	455,604,000	
	１５２　２０年国債	300,000,000	341,940,000	
	１５３　２０年国債	400,000,000	461,884,000	
	１５４　２０年国債	550,000,000	627,715,000	
	１５５　２０年国債	400,000,000	444,808,000	
	１５６　２０年国債	200,000,000	204,570,000	
	１５７　２０年国債	100,000,000	99,103,000	
	１５８　２０年国債	400,000,000	414,256,000	
	１５９　２０年国債	280,000,000	293,988,800	
	１６０　２０年国債	360,000,000	383,565,600	
	１６１　２０年国債	250,000,000	262,237,500	
	１６２　２０年国債	350,000,000	366,793,000	
	１６３　２０年国債	290,000,000	303,864,900	
	１６４　２０年国債	390,000,000	401,832,600	
	１６５　２０年国債	520,000,000	535,106,000	
	１６６　２０年国債	250,000,000	265,552,500	
	１６７　２０年国債	300,000,000	307,902,000	
	１６８　２０年国債	320,000,000	322,473,600	
	１６９　２０年国債	300,000,000	296,610,000	
	１７０　２０年国債	265,000,000	261,737,850	
	１７１　２０年国債	300,000,000	295,998,000	
	１７２　２０年国債	175,000,000	175,628,250	
	１７３　２０年国債	410,000,000	410,742,100	
	１７４　２０年国債	30,000,000	30,027,300	
	２７　メキシコ国債	100,000,000	94,647,500	
	１１　フイリピン共和国	100,000,000	99,957,000	
国債証券　合計			79,869,797,660	
地方債証券	７１３　東京都公債	100,000,000	101,373,700	
	７５１　東京都公債	100,000,000	101,740,700	
	１６　東京都２０年	100,000,000	115,381,500	
	２４－１　北海道公債	100,000,000	101,347,500	
	２４－６　北海道公債	100,000,000	101,433,200	

	２２２　神奈川県公債	100,000,000	100,121,800	
	３１　神奈川県２０年	100,000,000	110,064,200	
	３６１　大阪府公債	100,000,000	101,422,100	
	４２０　大阪府公債	200,000,000	201,266,200	
	２４－５　京都府公債	100,000,000	101,453,000	
	２６－１７　兵庫県公債	100,000,000	101,851,500	
	３　兵庫県公債１２年	200,000,000	204,676,400	
	１９兵庫県公債２０年	100,000,000	116,738,700	
	２６－１０　静岡県公債	100,000,000	101,959,400	
	２１－５　愛知県公債	100,000,000	118,478,200	
	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	101,593,400	
	２９－５　広島県公債	100,000,000	101,267,200	
	４　埼玉県３０年	100,000,000	116,726,500	
	２９－１　福岡県公債	100,000,000	100,915,000	
	２２－１　福岡県１５年	100,000,000	108,150,000	
	１６　千葉県２０年	100,000,000	116,983,200	
	２８－２　新潟県公債	100,000,000	100,761,700	
	１０８　共同発行地方	100,000,000	101,290,700	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	101,425,500	
	１２６　共同発行地方	100,000,000	102,240,500	
	１３１　共同発行地方	100,000,000	102,063,400	
	１６８　共同発行地方	100,000,000	100,962,700	
	２５－６　大阪市公債	200,000,000	204,030,200	
	１１　名古屋市２０年	100,000,000	118,098,800	
	２０－１　神戸市２０年	100,000,000	117,165,100	
	２４－１０　神戸市公債	100,000,000	101,467,300	
	２４－３　横浜市公債	100,000,000	101,446,100	
	２４－５　札幌市公債	100,000,000	101,272,000	
	４　川崎市公債３０年	100,000,000	132,043,200	
	２３－４　福岡市２０年	100,000,000	118,447,600	
	２４－４　福井県公債	100,000,000	101,053,300	
地方債証券　合計			4,128,711,500	
特殊債券	４７日本政策投資ＣＯ	100,000,000	107,903,000	
	１９　政保政策投資Ｃ	100,000,000	101,475,700	
	２４７　道路機構	200,000,000	195,574,200	
	８６　政保道路機構	100,000,000	116,636,100	
	１６８　政保道路機構	100,000,000	101,372,700	
	１７３　政保道路機構	100,000,000	101,471,100	
	１７５　政保道路機構	100,000,000	101,474,900	

	１８６　政保道路機構	100,000,000	101,477,300	
	１９０　政保道路機構	100,000,000	101,426,700	
	２２３　政保道路機構	100,000,000	115,813,300	
	２３６　政保道路機構	100,000,000	101,321,600	
	２６１　政保道路機構	200,000,000	203,702,000	
	２８４　政保道路機構	200,000,000	194,686,000	
	２９８　政保道路機構	100,000,000	103,190,500	
	３３　地方公共団体	100,000,000	101,238,300	
	３９政保地方公共団	100,000,000	101,342,900	
	Ｆ１４３地方公共団体	100,000,000	108,469,700	
	１　地方公共団１５年	100,000,000	108,858,200	
	４８　地方公共団体	100,000,000	101,927,500	
	５１　地方公共団体	100,000,000	102,222,300	
	３１　地方公共団２０	100,000,000	118,583,400	
	６５　地方公共団体	100,000,000	101,956,100	
	７１　地方公共団体	100,000,000	101,900,200	
	２５　日本政策金融	100,000,000	101,390,600	
	２５　政保日本政策	100,000,000	101,759,000	
	１２７　都市再生	100,000,000	100,023,100	
	１９　利付商工債	100,000,000	99,942,300	
特殊債券　合計			3,097,138,700	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	99,909,000	
	６３　中日本高速道	100,000,000	102,447,200	
	２１　西日本高速道	100,000,000	102,091,200	
	１２　アサヒグループＨＤ	100,000,000	100,552,600	
	１１日本たばこ産業	100,000,000	102,243,900	
	５　野村不動産ＨＤ	100,000,000	102,723,800	
	２３　森ビル	100,000,000	100,631,000	
	１１　セブンアンドアイ	100,000,000	100,715,500	
	１４　セブンアンドアイ	100,000,000	100,009,900	
	４　ＪＸホールデイングス	100,000,000	102,104,300	
	１７　パナソニツク	100,000,000	100,997,900	
	１５　デンソー	100,000,000	100,232,500	
	７　凸版印刷	100,000,000	106,929,700	
	１　三菱ＵＦＪＦＧ　劣後	100,000,000	101,696,500	
	１１三菱ＵＦＪ信託ＢＫ	100,000,000	101,789,700	
	７８　トヨタファイナンス	100,000,000	100,334,000	
	１７５　オリックス	100,000,000	102,662,900	
	１３　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	106,475,800	

	１０７東日本旅客鉄	100,000,000	115,983,600	
	４１　東海旅客鉄道	100,000,000	115,988,900	
	５０９　関西電力	100,000,000	100,869,200	
	３７２　中国電力	100,000,000	101,990,700	
	４８２　九州電力	100,000,000	100,278,600	
	３３２　北海道電力	100,000,000	102,876,100	
	１１　東京電力パワー	100,000,000	101,026,000	
	３０　大阪瓦斯	100,000,000	101,426,500	
	４　フアーストリテイリング	100,000,000	102,949,600	
社債券　合計			2,777,936,600	
合計			89,873,584,460	

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12月2日現在	2020年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	612,451,738	365,587,927
コール・ローン	6,367,531,949	3,752,997,009
株式	121,306,145,522	151,364,986,629
新株予約権証券	－	868,069
投資証券	3,645,255,546	3,711,750,912
派生商品評価勘定	373,437,617	619,719,431
未収入金	96,592,173	12,393,192
未収配当金	214,896,369	182,217,065
差入委託証拠金	1,487,858,524	2,380,060,115
流動資産合計	134,104,169,438	162,390,580,349
資産合計	134,104,169,438	162,390,580,349
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	930,366	23,156,487
未払金	76,338,905	1,712,592
未払解約金	58,281,600	82,467,100
その他未払費用	3,792	－
流動負債合計	135,554,663	107,336,179
負債合計	135,554,663	107,336,179
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	48,893,612,273	54,067,455,177
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	85,075,002,502	108,215,788,993
元本等合計	133,968,614,775	162,283,244,170
純資産合計	133,968,614,775	162,283,244,170
負債純資産合計	134,104,169,438	162,390,580,349

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12月3日 至　2020年11月30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)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、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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12月2日現在	2020年11月30日現在
1．※1　期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	43,964,024,902円	48,893,612,273円
期中追加設定元本額	10,527,862,672円	16,107,558,260円
期中一部解約元本額	5,598,275,301円	10,933,715,356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	466,203,951円	429,418,774円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	12,135,579円	6,511,702円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	136,414,008円	109,450,582円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	19,175,184円	14,001,565円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	467,869,193円	353,394,455円
外国株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	8,549,100円	22,667,766円

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	538,132,530円	535,920,559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）	1,863,069,978円	2,255,476,207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）	538,513,489円	662,541,353円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	2,768,783円	11,396,584円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	2,115,496円	6,026,400円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	1,146,595,215円	2,011,620,301円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	816,785,041円	1,021,183,359円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	26,201,082円	49,879,929円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	29,501,748,908円	33,018,813,032円
ダイワ・ライフ・バランス３０	576,429,097円	579,030,840円
ダイワ・ライフ・バランス５０	874,085,645円	976,488,397円
ダイワ・ライフ・バランス７０	675,316,597円	722,361,053円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,500,453,033円	1,541,641,973円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	3,017,912円	2,282,168円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	14,368,992円	11,422,149円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	5,760,550円	7,627,380円
ダイワつみたてインデックス外国株式	136,727,006円	452,466,523円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	88,638円	2,121,988円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	86,527円	2,068,375円

ダイワつみたてインデックスバランス７０	530,015円	2,463,419円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	184,271,979円	161,683,743円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	323,611,524円	284,495,474円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,650,169,104円	2,255,482,425円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	127,631,309円	110,264,809円
ダイワバランスファンド2020-07（適格機関投資家専用）	－円	271,255,135円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	677,239,222円	798,778,255円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	111,772,535円	183,907,812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）	2,632,754,719円	2,325,979,029円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,712,848,524円	2,735,745,325円
ダイワライフスタイル２５	18,663,687円	17,629,498円
ダイワライフスタイル５０	67,445,810円	63,519,419円
ダイワライフスタイル７５	54,062,311円	50,437,420円
計	48,893,612,273円	54,067,455,177円
2. 期末日における受益権の総数	48,893,612,273口	54,067,455,177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12月3日 至 2020年11月30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11月30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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	14,202,028,663	17,672,692,878
新株予約権証券	－	30,829
投資証券	442,369,912	△288,804,566
合計	14,644,398,575	17,383,919,141

（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12月2日まで、及び2019年12月3日から2020年11月30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12月2日 現在				2020年11月30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								
株価指数先物取引								
買　建	8,546,091,477	－	8,919,524,138	373,432,661	6,984,505,406	－	7,583,915,003	599,409,597
合計	8,546,091,477	－	8,919,524,138	373,432,661	6,984,505,406	－	7,583,915,003	599,409,597

（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12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち	(円)	(円)	(円)	うち	(円)	(円)

		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	6,314,295,910	－	6,313,370,500	△925,410	4,081,862,053	－	4,079,015,400	△2,846,653
アメリカ・ドル	4,843,983,500	－	4,843,319,000	△664,500	3,024,714,845	－	3,001,843,000	△22,871,845
イギリス・ポンド	240,357,900	－	240,312,000	△45,900	165,466,538	－	169,006,600	3,540,062
オーストラリア・ドル	96,328,960	－	96,317,000	△11,960	112,156,038	－	117,657,000	5,500,962
カナダ・ドル	226,600,550	－	226,572,500	△28,050	129,630,400	－	131,901,000	2,270,600
スイス・フラン	230,248,200	－	230,202,000	△46,200	173,808,703	－	174,769,600	960,897
ユーロ	676,776,800	－	676,648,000	△128,800	476,085,529	－	483,838,200	7,752,671
合計	6,314,295,910	－	6,313,370,500	△925,410	4,081,862,053	－	4,079,015,400	△2,846,653

（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12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	2.7400円	3.0015円

（1万口当たり純資産額）	(27,400円)	(30,015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	3,750	147.400	552,750.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,230	295.310	953,851.300	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,100	119.070	726,327.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,400	88.130	387,772.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,780	143.280	255,038.400	
	SYNCHRONY FINANCIAL	17,300	31.090	537,857.000	
	ABBOTT LABORATORIES	57,916	107.620	6,232,919.920	
	HOWMET AEROSPACE INC	13,233	24.600	325,531.800	
	VERISK ANALYTICS INC	5,150	198.230	1,020,884.500	
	LAS VEGAS SANDS CORP	11,100	56.590	628,149.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	9,650	131.950	1,273,317.500	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	20,262	148.280	3,004,449.360	
	QORVO INC	3,850	150.110	577,923.500	
	AFLAC INC	22,550	45.280	1,021,064.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	4,350	109.950	478,282.500	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,050	67.230	339,511.500	
	ADOBE INC	15,770	477.030	7,522,763.100	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,050	38.770	273,328.500	
	LULULEMON ATHLETICA INC	4,100	365.390	1,498,099.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,400	12.860	185,184.000	
	GARMIN LTD	4,650	117.050	544,282.500	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,310	277.830	2,030,937.300	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	22,750	209.410	4,764,077.500	
	WR BERKLEY CORP	4,575	64.410	294,675.750	
	AUTOZONE INC	770	1,119.240	861,814.800	
	DOLLAR TREE INC	7,721	109.900	848,537.900	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	36,650	9.820	359,903.000	

PINNACLE WEST CAPITAL	3,800	83.940	318,972.000	
CELANESE CORP	3,950	133.680	528,036.000	
DR HORTON INC	11,316	75.980	859,789.680	
DENTSPLY SIRONA INC	7,000	51.660	361,620.000	
AUTODESK INC	7,230	272.810	1,972,416.300	
MOODY'S CORP	5,570	277.220	1,544,115.400	
ALBEMARLE CORP	3,550	137.660	488,693.000	
ATMOS ENERGY CORP	4,000	96.820	387,280.000	
ALLIANT ENERGY CORP	8,050	52.760	424,718.000	
CITIGROUP INC	68,173	56.670	3,863,363.910	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14,150	175.250	2,479,787.500	
AMERICAN ELECTRIC POWER	16,400	84.920	1,392,688.000	
ALLEGHANY CORP	480	589.880	283,142.400	
DOMINO'S PIZZA INC	1,270	390.470	495,896.900	
HESS CORP	9,000	50.770	456,930.000	
DAVITA INC	2,750	109.880	302,170.000	
DANAHER CORP	20,850	216.780	4,519,863.000	
FORTIVE CORP	9,850	71.430	703,585.500	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	18,050	104.990	1,895,069.500	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	18,400	50.450	928,280.000	
BUNGE LTD	4,450	60.840	270,738.000	
TE CONNECTIVITY LTD	10,675	115.310	1,230,934.250	
APPLE INC	567,800	116.590	66,199,802.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,200	78.870	804,474.000	
BOEING CO/THE	17,560	216.500	3,801,740.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,165	77.810	401,888.650	
BECTON DICKINSON AND CO	9,419	228.960	2,156,574.240	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	18.490	123,883.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,350	102.280	444,918.000	
CDK GLOBAL INC	4,000	46.740	186,960.000	
NISOURCE INC	12,600	24.510	308,826.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,450	92.720	412,604.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	26,021	39.950	1,039,538.950	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	135,504	60.580	8,208,832.320	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	45,550	231.550	10,547,102.500	
ANSYS INC	2,780	330.410	918,539.800	
TRUIST FINANCIAL CORP	44,417	48.500	2,154,224.500	

BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	22,200	60.530	1,343,766.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	74,000	63.050	4,665,700.000	
JPMORGAN CHASE & CO	99,770	121.220	12,094,119.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	7,700	145.630	1,121,351.000	
LKQ CORP	9,150	35.980	329,217.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,660	171.390	284,507.400	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,062	81.100	816,028.200	
CADENCE DESIGN SYS INC	9,300	116.580	1,084,194.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,010	190.750	764,907.500	
DOLLAR GENERAL CORP	8,350	218.010	1,820,383.500	
SERVICENOW INC	6,260	527.480	3,302,024.800	
CATERPILLAR INC	17,650	175.080	3,090,162.000	
BROWN & BROWN INC	7,950	45.620	362,679.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,300	45.790	334,267.000	
CMS ENERGY CORP	9,300	61.980	576,414.000	
MOSAIC CO/THE	12,050	22.680	273,294.000	
DELTA AIR LINES INC	5,150	41.060	211,459.000	
CORNING INC	24,600	37.090	912,414.000	
CISCO SYSTEMS INC	138,250	42.700	5,903,275.000	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	4,200	51.130	214,746.000	
MORGAN STANLEY	45,902	63.840	2,930,383.680	
MSCI INC	2,820	402.250	1,134,345.000	
FAIR ISAAC CORP	1,000	473.520	473,520.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,100	289.960	318,956.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7,500	69.620	522,150.000	
BROADCOM INC	13,052	394.950	5,154,887.400	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,780	129.860	490,870.800	
ARAMARK	7,200	36.180	260,496.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,250	28.910	209,597.500	
DTE ENERGY COMPANY	6,250	128.530	803,312.500	
CENTENE CORP	18,987	63.170	1,199,408.790	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,500	91.710	320,985.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14,300	34.140	488,202.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,150	115.860	712,539.000	
GARTNER INC	2,920	152.550	445,446.000	
SPLUNK INC	5,180	204.030	1,056,875.400	
DOMINION ENERGY INC	27,641	79.040	2,184,744.640	
MONSTER BEVERAGE CORP	12,850	84.150	1,081,327.500	
SMITH (A.O.) CORP	4,250	57.080	242,590.000	

DEERE & CO	9,650	261.950	2,527,817.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	9,884	197.030	1,947,444.520	
VMWARE INC-CLASS A	2,830	142.080	402,086.400	
CABLE ONE INC	170	1,962.060	333,550.200	
BURLINGTON STORES INC	2,190	221.580	485,260.200	
NASDAQ INC	3,700	127.120	470,344.000	
VAIL RESORTS INC	1,360	282.670	384,431.200	
EAST WEST BANCORP INC	4,600	43.740	201,204.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,250	120.220	270,495.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,430	93.130	226,305.900	
CONSOLIDATED EDISON INC	10,900	77.770	847,693.000	
COGNEX CORP	5,500	74.500	409,750.000	
TELEFLEX INC	1,500	371.050	556,575.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,800	135.290	378,812.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,400	277.960	667,104.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	710	535.070	379,899.700	
CATALENT INC	5,150	97.400	501,610.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4,480	276.450	1,238,496.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,000	207.020	414,040.000	
IDEX CORP	2,520	192.360	484,747.200	
COLGATE-PALMOLIVE CO	26,800	84.900	2,275,320.000	
ROLLINS INC	4,925	57.030	280,872.750	
AMETEK INC	7,425	119.770	889,292.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,200	86.270	707,414.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,350	41.230	179,350.500	
HEICO CORP	1,400	127.060	177,884.000	
XPO LOGISTICS INC	3,100	105.820	328,042.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,240	322.750	400,210.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,850	87.860	777,561.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,300	426.110	553,943.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	14,440	388.390	5,608,351.600	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,600	122.710	319,046.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,800	325.950	586,710.000	
RPM INTERNATIONAL INC	4,350	87.670	381,364.500	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	880	1,297.770	1,142,037.600	

UGI CORP	7,050	37.160	261,978.000	
CUMMINS INC	4,850	229.030	1,110,795.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	25,300	78.140	1,976,942.000	
CDW CORP/DE	4,650	132.230	614,869.500	
SIGNATURE BANK	1,650	115.200	190,080.000	
COSTAR GROUP INC	1,310	884.380	1,158,537.800	
SVB FINANCIAL GROUP	1,710	353.790	604,980.900	
AMERCO	290	407.440	118,157.600	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,150	201.990	636,268.500	
MERCADOLIBRE INC	1,480	1,513.430	2,239,876.400	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,500	157.800	394,500.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	9,016	104.410	941,360.560	
IPG PHOTONICS CORP	1,170	203.520	238,118.400	
DEXCOM INC	3,000	318.210	954,630.000	
NORDSON CORP	1,730	204.370	353,560.100	
COPART INC	6,850	115.210	789,188.500	
DIAMONDBACK ENERGY INC	5,150	43.520	224,128.000	
SEAGEN INC	3,950	169.120	668,024.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,510	475.500	1,193,505.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,710	591.540	1,011,533.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,800	95.560	267,568.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	11,100	16.240	180,264.000	
KINDER MORGAN INC	67,381	14.750	993,869.750	
HCA HEALTHCARE INC	9,000	153.050	1,377,450.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,220	533.890	651,345.800	
CABOT OIL & GAS CORP	12,400	17.770	220,348.000	
T-MOBILE US INC	18,327	131.900	2,417,331.300	
ZILLOW GROUP INC - C	4,550	108.050	491,627.500	
COCA-COLA CO/THE	133,600	52.700	7,040,720.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	6,500	43.960	285,740.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,550	88.960	493,728.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,500	22.270	211,565.000	
CSX CORP	25,250	91.290	2,305,072.500	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,130	200.000	626,000.000	
EXPEDIA GROUP INC	4,375	123.730	541,318.750	
AUTOLIV INC	2,750	91.350	251,212.500	
AMAZON.COM INC	13,880	3,195.340	44,351,319.200	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,240	85.260	1,725,662.400	
EXXON MOBIL CORP	138,405	40.190	5,562,496.950	
FLIR SYSTEMS INC	4,200	39.130	164,346.000	
AES CORP	21,900	21.040	460,776.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,350	233.450	315,157.500	
EOG RESOURCES INC	19,300	51.430	992,599.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5,200	104.320	542,464.000	
ABIOMED INC	1,520	271.900	413,288.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,950	103.200	510,840.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,140	114.090	1,156,872.600	
FORD MOTOR CO	126,323	9.090	1,148,276.070	
DISCOVERY INC - A	4,690	27.480	128,881.200	
EXACT SCIENCES CORP	4,850	118.190	573,221.500	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	22.680	110,837.160	
LIBERTY BROADBAND-A	850	157.140	133,569.000	
DISCOVERY INC-C	10,389	24.550	255,049.950	
AERCAP HOLDINGS NV	4,000	38.660	154,640.000	
FORTINET INC	4,800	123.790	594,192.000	
MARKEL CORP	460	1,004.290	461,973.400	
NEXTERA ENERGY INC	64,080	75.130	4,814,330.400	
MASIMO CORP	1,700	254.410	432,497.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	47,208	23.520	1,110,332.160	
INSULET CORP	2,220	251.480	558,285.600	
US BANCORP	44,150	44.210	1,951,871.500	
UNITED RENTALS INC	2,350	232.910	547,338.500	
F5 NETWORKS INC	1,900	164.550	312,645.000	
FASTENAL CO	18,600	48.580	903,588.000	
FISERV INC	18,583	115.530	2,146,893.990	
GENERAL ELECTRIC CO	288,050	10.400	2,995,720.000	
GENERAL MOTORS CO	42,600	45.060	1,919,556.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	7,950	152.060	1,208,877.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,760	235.400	2,532,904.000	
ALPHABET INC-CL A	9,820	1,787.020	17,548,536.400	
ALPHABET INC-CL C	9,887	1,793.190	17,729,269.530	
OWENS CORNING	3,350	74.300	248,905.000	
GENERAL MILLS INC	20,050	60.130	1,205,606.500	
FIRSTENERGY CORP	18,068	26.720	482,776.960	
GENUINE PARTS CO	4,850	98.360	477,046.000	
IHS MARKIT LTD	12,584	92.580	1,165,026.720	

FIFTH THIRD BANCORP	23,000	26.280	604,440.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,160	194.470	1,392,405.200	
HALLIBURTON CO	27,600	17.560	484,656.000	
HOME DEPOT INC	35,200	275.990	9,714,848.000	
ASSURANT INC	1,900	133.790	254,201.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,800	12.460	396,228.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,290	164.530	212,243.700	
HERSHEY CO/THE	4,740	148.050	701,757.000	
HUMANA INC	4,350	406.490	1,768,231.500	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,300	158.940	1,478,142.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,360	292.740	690,866.400	
HENRY SCHEIN INC	4,500	63.680	286,560.000	
HP INC	47,300	22.270	1,053,371.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	41,900	11.220	470,118.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,978	42.230	252,450.940	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,500	42.590	276,835.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	42.060	124,077.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	13,200	33.030	435,996.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	21,753	32.840	714,368.520	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	29,150	124.350	3,624,802.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	12,200	50.690	618,418.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,350	85.010	369,793.500	
ZOETIS INC	15,600	161.470	2,518,932.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	7,979	143.500	1,144,986.500	
CHENIERE ENERGY INC	7,650	58.780	449,667.000	
ALLEGION PLC	2,900	114.280	331,412.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	21.820	283,070.860	
WASTE CONNECTIONS INC	8,507	104.380	887,960.660	
JUNIPER NETWORKS INC	10,500	22.210	233,205.000	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,400	139.150	333,960.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,670	116.500	427,555.000	
JOHNSON & JOHNSON	86,200	144.000	12,412,800.000	
ABBVIE INC	57,772	104.890	6,059,705.080	
HOLOGIC INC	8,350	69.510	580,408.500	

KIMBERLY-CLARK CORP	11,250	141.370	1,590,412.500	
KROGER CO	25,500	32.430	826,965.000	
KLA CORP	5,030	254.130	1,278,273.900	
LOCKHEED MARTIN CORP	8,260	374.340	3,092,048.400	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,780	267.600	743,928.000	
LOWE'S COS INC	24,450	154.670	3,781,681.500	
ELI LILLY & CO	28,185	147.440	4,155,596.400	
LAM RESEARCH CORP	4,820	456.540	2,200,522.800	
JONES LANG LASALLE INC	1,650	133.960	221,034.000	
LOEWS CORP	8,300	43.410	360,303.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,249	49.160	307,200.840	
MCDONALD'S CORP	24,300	218.330	5,305,419.000	
3M CO	18,850	176.890	3,334,376.500	
FACEBOOK INC-CLASS A	78,750	277.810	21,877,537.500	
S&P GLOBAL INC	7,900	341.570	2,698,403.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,110	271.010	571,831.100	
CONCHO RESOURCES INC	6,200	62.020	384,524.000	
PHILLIPS 66	14,150	65.230	923,004.500	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,250	28.620	436,455.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,050	186.480	755,244.000	
METLIFE INC	25,550	47.450	1,212,347.500	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	21,700	45.110	978,887.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,870	272.560	509,687.200	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	45.920	220,416.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,658	173.460	981,436.680	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	800	1,126.680	901,344.000	
BAKER HUGHES CO	21,373	19.780	422,757.940	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,760	255.930	962,296.800	
MERCK & CO. INC.	82,621	79.860	6,598,113.060	
DUPONT DE NEMOURS INC	24,218	64.540	1,563,029.720	
MASCO CORP	8,700	54.240	471,888.000	
M & T BANK CORP	4,289	120.980	518,883.220	
MARSH & MCLENNAN COS	16,850	114.360	1,926,966.000	
BLACK KNIGHT INC	5,000	90.530	452,650.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,500	113.720	284,300.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	9,122	128.350	1,170,808.700	

WORKDAY INC-CLASS A	5,680	223.860	1,271,524.800	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,100	260.680	547,428.000	
SQUARE INC - A	11,800	212.520	2,507,736.000	
TRANSUNION	6,150	92.850	571,027.500	
VISTRA CORP	14,250	19.590	279,157.500	
BEIGENE LTD-ADR	1,450	285.890	414,540.500	
NETAPP INC	7,450	53.260	396,787.000	
NIKE INC -CL B	40,600	134.250	5,450,550.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,450	242.720	2,050,984.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,000	133.010	1,064,080.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,150	92.710	384,746.500	
ALLY FINANCIAL INC	12,550	30.670	384,908.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,220	306.030	1,597,476.600	
APTIV PLC	8,700	121.860	1,060,182.000	
NEWMONT CORP	26,461	58.480	1,547,439.280	
MCKESSON CORP	5,250	180.000	945,000.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,700	82.410	716,967.000	
XYLEM INC	5,870	97.140	570,211.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	51,000	75.900	3,870,900.000	
NUCOR CORP	9,900	55.070	545,193.000	
SUNRUN INC	3,900	66.750	260,325.000	
WESTERN UNION CO	12,946	22.520	291,543.920	
GODADDY INC - CLASS A	5,700	79.500	453,150.000	
NEWELL BRANDS INC	12,542	21.070	264,259.940	
EVERGY INC	7,400	55.770	412,698.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	30,224	16.560	500,509.440	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	820	226.580	185,795.600	
OKTA INC	3,860	236.040	911,114.400	
COUPA SOFTWARE INC	2,180	326.940	712,729.200	
LIBERTY BROADBAND-C	3,600	157.970	568,692.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	13,355	31.320	418,278.600	
LINDE PLC	17,196	257.430	4,426,766.280	
WIX.COM LTD	1,780	258.620	460,343.600	
EQUITABLE HOLDINGS INC	13,300	26.000	345,800.000	
KKR & CO INC	16,300	38.710	630,973.000	
PAYCHEX INC	10,700	93.370	999,059.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,410	443.150	1,067,991.500	
ALTRIA GROUP INC	61,150	40.370	2,468,625.500	
P G & E CORP	35,500	12.730	451,915.000	

PFIZER INC	181,913	37.230	6,772,620.990	
CIGNA CORP	12,160	212.500	2,584,000.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	7,851	69.820	548,156.820	
ALTICE USA INC- A	10,900	34.330	374,197.000	
XCEL ENERGY INC	17,450	67.620	1,179,969.000	
STERIS PLC	2,850	191.690	546,316.500	
FOX CORP - CLASS B	5,433	28.730	156,090.090	
FOX CORP - CLASS A	10,849	29.160	316,356.840	
STRYKER CORP	11,120	232.810	2,588,847.200	
DOW INC	24,068	55.400	1,333,367.200	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,800	59.810	167,468.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	5,180	471.610	2,442,939.800	
PARKER HANNIFIN CORP	4,170	272.850	1,137,784.500	
UBER TECHNOLOGIES INC	31,500	50.720	1,597,680.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,350	110.070	588,874.500	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	80,917	138.610	11,215,905.370	
EXELON CORP	32,272	41.740	1,347,033.280	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,350	123.830	910,150.500	
TELADOC HEALTH INC	2,300	196.450	451,835.000	
INGERSOLL-RAND INC	11,358	44.800	508,838.400	
NVR INC	110	4,120.220	453,224.200	
CONOCOPHILLIPS	35,500	42.780	1,518,690.000	
TWILIO INC - A	4,050	319.050	1,292,152.500	
DOCUSIGN INC	5,750	226.870	1,304,502.500	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,610	416.770	670,999.700	
PEPSICO INC	45,400	144.600	6,564,840.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,300	113.200	147,160.000	
DROPBOX INC-CLASS A	8,000	19.540	156,320.000	
MONGODB INC	1,620	270.020	437,432.400	
SNAP INC - A	29,500	46.030	1,357,885.000	
CORTEVA INC	24,818	38.410	953,259.380	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,800	78.090	999,552.000	
AMCOR PLC	52,200	11.480	599,256.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	4,650	150.830	701,359.500	
ROKU INC	3,350	275.340	922,389.000	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,000	153.730	922,380.000	
ACCENTURE PLC-CL A	20,850	250.120	5,215,002.000	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	12,600	40.670	512,442.000	
PENTAIR PLC	5,505	53.100	292,315.500	
QUALCOMM INC	36,450	143.830	5,242,603.500	
INVESCO LTD	12,000	17.010	204,120.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,350	149.930	352,335.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,200	51.400	472,880.000	
DATADOG INC - CLASS A	4,350	96.420	419,427.000	
PINTEREST INC- CLASS A	13,100	69.720	913,332.000	
AVALARA INC	2,500	169.030	422,575.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,320	514.050	1,706,646.000	
REPUBLIC SERVICES INC	7,400	97.040	718,096.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,350	2,052.670	2,771,104.500	
ROSS STORES INC	11,800	109.540	1,292,572.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,100	132.770	411,587.000	
RESMED INC	4,850	209.640	1,016,754.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,350	124.800	542,880.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,600	65.510	235,836.000	
MODERNA INC	8,800	127.030	1,117,864.000	
RALPH LAUREN CORP	1,450	87.980	127,571.000	
PERKINELMER INC	3,730	129.260	482,139.800	
CARRIER GLOBAL CORP	26,637	37.810	1,007,144.970	
OTIS WORLDWIDE CORP	13,718	67.340	923,770.120	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,800	43.870	254,446.000	
AVANTOR INC	15,500	26.350	408,425.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	4,700	28.630	134,561.000	
DYNATRACE INC	6,100	38.420	234,362.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,330	873.100	1,161,223.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	32,135	15.620	501,948.700	
IAC/INTERACTIVECORP	2,530	142.480	360,474.400	
MATCH GROUP INC	8,170	139.630	1,140,777.100	
CHEVRON CORP	61,018	91.310	5,571,553.580	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	6,500	108.980	708,370.000	
ZSCALER INC	2,400	149.740	359,376.000	
EDISON INTERNATIONAL	12,350	62.790	775,456.500	
TESLA INC	24,270	585.760	14,216,395.200	

SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,000	328.790	328,790.000	
NORTONLIFELOCK INC	17,850	18.110	323,263.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,022	187.710	942,679.620	
SYNOPSYS INC	5,040	225.420	1,136,116.800	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,685	642.800	3,011,518.000	
VIATRIS INC	38,621	17.050	658,488.050	
CBRE GROUP INC - A	10,850	61.130	663,260.500	
TWITTER INC	25,950	46.590	1,209,010.500	
SOUTHERN CO/THE	34,750	60.650	2,107,587.500	
SYSCO CORP	16,000	71.240	1,139,840.000	
TRAVELERS COS INC/THE	8,403	134.440	1,129,699.320	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	55.610	239,123.000	
STEEL DYNAMICS INC	6,600	37.650	248,490.000	
SCHLUMBERGER LTD	46,002	21.880	1,006,523.760	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,050	50.550	255,277.500	
AT&T INC	233,291	29.030	6,772,437.730	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,700	47.730	224,331.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	12,900	28.650	369,585.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,690	735.810	1,979,328.900	
SEMPRA ENERGY	9,670	130.460	1,261,548.200	
TIFFANY & CO	3,650	131.720	480,778.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,650	58.480	447,372.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	29,750	158.990	4,729,952.500	
SALESFORCE.COM INC	29,421	247.630	7,285,522.230	
WESTROCK CO	8,530	44.060	375,831.800	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	24,484	45.970	1,125,529.480	
TERADYNE INC	5,500	109.400	601,700.000	
UNION PACIFIC CORP	21,980	205.640	4,519,967.200	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,588	41.420	894,174.960	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	49,479	73.910	3,656,992.890	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	23,050	168.890	3,892,914.500	
IQVIA HOLDINGS INC	6,244	168.810	1,054,049.640	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	59.330	258,085.500	
AMEREN CORPORATION	8,050	78.990	635,869.500	
UNITEDHEALTH GROUP INC	31,016	337.940	10,481,547.040	
VERISIGN INC	3,370	200.520	675,752.400	

VALERO ENERGY CORP	13,142	56.620	744,100.040	
ULTA BEAUTY INC	1,760	281.290	495,070.400	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8,688	36.560	317,633.280	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,500	132.110	330,275.000	
ANTHEM INC	8,300	312.800	2,596,240.000	
WALT DISNEY CO/THE	59,162	147.130	8,704,505.060	
WELLS FARGO & CO	127,422	28.460	3,626,430.120	
WASTE MANAGEMENT INC	14,000	119.190	1,668,660.000	
WILLIAMS COS INC	40,200	21.460	862,692.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,700	139.370	515,669.000	
WHIRLPOOL CORP	1,950	200.960	391,872.000	
WALMART INC	46,400	151.600	7,034,240.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,750	150.020	1,012,635.000	
WYNN RESORTS LTD	3,050	101.220	308,721.000	
WABTEC CORP	5,861	73.820	432,659.020	
TJX COMPANIES INC	39,400	63.220	2,490,868.000	
WATERS CORP	2,050	228.270	467,953.500	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,760	377.000	663,520.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	24,700	39.000	963,300.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,173	209.550	874,452.150	
WESTERN DIGITAL CORP	9,750	45.850	447,037.500	
WEC ENERGY GROUP INC	10,480	95.740	1,003,355.200	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	16,800	59.350	997,080.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	55,200	211.000	11,647,200.000	
PPL CORP	24,800	29.110	721,928.000	
PULTEGROUP INC	8,900	44.360	394,804.000	
PPG INDUSTRIES INC	7,850	147.780	1,160,073.000	
NORTHERN TRUST CORP	6,400	96.140	615,296.000	
NVIDIA CORP	20,100	530.450	10,662,045.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	13,843	139.790	1,935,112.970	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,300	55.810	295,793.000	
TYSON FOODS INC-CL A	9,800	65.000	637,000.000	
NETFLIX INC	14,400	491.360	7,075,584.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12,920	453.400	5,857,928.000	

NRG ENERGY INC	7,950	32.510	258,454.500	
GLOBE LIFE INC	3,225	96.020	309,664.500	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,700	130.340	742,938.000	
TEXTRON INC	7,150	46.870	335,120.500	
NEWS CORP - CLASS A	13,137	17.710	232,656.270	
OGE ENERGY CORP	6,750	33.650	227,137.500	
OMNICOM GROUP	7,150	63.000	450,450.000	
ORACLE CORP	72,033	57.760	4,160,626.080	
MASTERCARD INC - A	29,200	339.070	9,900,844.000	
ONEOK INC	14,400	37.230	536,112.000	
CENTURYLINK INC	31,152	10.460	325,849.920	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,420	418.800	1,432,296.000	
YUM! BRANDS INC	9,800	107.180	1,050,364.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	3,700	176.410	652,717.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,050	46.800	283,140.000	
BANK OF AMERICA CORP	255,601	28.990	7,409,872.990	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,210	386.240	467,350.400	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,850	80.400	470,340.000	
AMERICAN EXPRESS CO	22,600	120.590	2,725,334.000	
ANALOG DEVICES INC	12,199	137.750	1,680,412.250	
ADVANCED MICRO DEVICES	38,300	87.190	3,339,377.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	28,322	39.710	1,124,666.620	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,500	136.160	748,880.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,900	81.480	480,732.000	
AVERY DENNISON CORP	2,750	150.300	413,325.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,900	78.410	1,403,539.000	
EMERSON ELECTRIC CO	19,700	78.160	1,539,752.000	
AON PLC-CLASS A	7,620	206.580	1,574,139.600	
AMGEN INC	19,250	224.810	4,327,592.500	
EATON CORP PLC	13,086	121.900	1,595,183.400	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,580	204.810	1,142,839.800	
APPLIED MATERIALS INC	30,200	82.660	2,496,332.000	
CME GROUP INC	11,800	174.770	2,062,286.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,694	13.150	153,776.100	
ECOLAB INC	8,450	224.810	1,899,644.500	
EQUIFAX INC	4,050	164.740	667,197.000	

GILEAD SCIENCES INC	41,150	60.030	2,470,234.500	
KEURIG DR PEPPER INC	11,500	30.760	353,740.000	
HORMEL FOODS CORP	9,600	47.200	453,120.000	
STATE STREET CORP	11,743	71.590	840,681.370	
SCHWAB (CHARLES) CORP	50,290	49.700	2,499,413.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	16,900	75.970	1,283,893.000	
CAMPBELL SOUP CO	6,000	48.980	293,880.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,550	95.560	434,798.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,450	53.780	508,221.000	
FEDEX CORP	8,200	287.410	2,356,762.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,104	87.760	1,325,527.040	
FMC CORP	4,200	115.670	485,814.000	
CERNER CORP	10,050	74.100	744,705.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,824	112.870	318,744.880	
CITRIX SYSTEMS INC	3,800	122.440	465,272.000	
INTEL CORP	138,600	47.450	6,576,570.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	12,400	22.800	282,720.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	11,650	45.830	533,919.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	10,300	212.230	2,185,969.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,600	6.550	226,630.000	
ILLUMINA INC	4,850	317.030	1,537,595.500	
SEALED AIR CORP	5,000	44.530	222,650.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,820	729.820	2,787,912.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,050	119.720	484,866.000	
SNAP-ON INC	1,630	177.000	288,510.000	
CARMAX INC	5,350	95.370	510,229.500	
COMERICA INC	4,500	51.490	231,705.000	
INGREDION INC	2,150	79.950	171,892.500	
DUKE ENERGY CORP	24,178	94.600	2,287,238.800	
TARGET CORP	16,280	179.770	2,926,655.600	
DOVER CORP	4,800	123.880	594,624.000	
WW GRAINGER INC	1,490	414.580	617,724.200	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,250	105.860	449,905.000	
CINTAS CORP	2,940	361.090	1,061,604.600	
CONAGRA BRANDS INC	15,800	35.940	567,852.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,750	73.190	347,652.500	
CLOROX COMPANY	4,050	203.090	822,514.500	

ENTERGY CORP	6,650	111.510	741,541.500	
MICROSOFT CORP	235,900	215.230	50,772,757.000	
INCYTE CORP	6,000	83.250	499,500.000	
CVS HEALTH CORP	42,969	67.870	2,916,306.030	
MEDTRONIC PLC	43,898	114.590	5,030,271.820	
MICRON TECHNOLOGY INC	36,650	64.230	2,354,029.500	
BLACKROCK INC	5,000	715.110	3,575,550.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	15,800	24.070	380,306.000	
HASBRO INC	4,400	92.320	406,208.000	
KELLOGG CO	8,400	63.480	533,232.000	
KEYCORP	32,600	16.330	532,358.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,150	189.500	596,925.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	46,811	57.460	2,689,760.060	
COOPER COS INC/THE	1,770	340.710	603,056.700	
CHUBB LTD	14,869	151.420	2,251,463.980	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	93.010	251,127.000	
ALLSTATE CORP	10,250	104.140	1,067,435.000	
EBAY INC	25,650	51.340	1,316,871.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	36,500	211.390	7,715,735.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	4,550	99.900	454,545.000	
XILINX INC	8,000	137.490	1,099,920.000	
DISH NETWORK CORP-A	8,200	35.910	294,462.000	
ZIONS BANCORP NA	5,200	39.460	205,192.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7,450	245.940	1,832,253.000	
TRIMBLE INC	8,250	60.450	498,712.500	
LENNAR CORP-A	9,000	77.710	699,390.000	
LEAR CORP	1,800	146.600	263,880.000	
PROGRESSIVE CORP	19,300	88.430	1,706,699.000	
PACCAR INC	11,487	87.740	1,007,869.380	
BIOGEN INC	5,620	243.780	1,370,043.600	
IDEXX LABORATORIES INC	2,770	454.230	1,258,217.100	
STARBUCKS CORP	38,350	98.660	3,783,611.000	
PTC INC	3,700	108.610	401,857.000	
PERRIGO CO PLC	4,200	48.030	201,726.000	
EVERSOURCE ENERGY	10,980	87.930	965,471.400	
INTUIT INC	8,570	354.240	3,035,836.800	
BORGWARNER INC	8,200	39.500	323,900.000	
BEST BUY CO INC	7,600	112.630	855,988.000	

	BALL CORP	10,584	96.360	1,019,874.240	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	47,097	33.600	1,582,459.200	
	ELECTRONIC ARTS INC	9,570	124.170	1,188,306.900	
	VULCAN MATERIALS CO	4,350	142.330	619,135.500	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,550	226.710	1,938,370.500	
	VF CORP	10,900	85.720	934,348.000	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	18,375	35.065	644,319.370	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,900	130.550	248,045.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,070	173.900	533,873.000	
	CARNIVAL CORP	15,300	21.580	330,174.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	149,090	51.750	7,715,407.500	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	7,200	23.900	172,080.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	7,500	52.900	396,750.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	4.090	36,810.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,300	4.220	170,066.000	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 1,043,158,544.690 (108,373,741,208)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	666,500	2.629	1,752,228.500	
	UNILEVER PLC	38,410	45.860	1,761,482.600	
	BARCLAYS PLC	568,800	1.395	793,476.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	279,500	1.076	300,881.750	
	PRUDENTIAL PLC	84,900	12.120	1,028,988.000	
	NATWEST GROUP PLC	159,791	1.606	256,704.240	
	EVRAZ PLC	15,000	3.922	58,830.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,064	22.490	136,379.360	
	BAE SYSTEMS PLC	106,500	5.042	536,973.000	
	AVIVA PLC	128,966	3.241	417,978.800	
	AVEVA GROUP PLC	2,000	33.750	67,500.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	165,100	13.836	2,284,323.600	
	INFORMA PLC	49,900	5.402	269,559.800	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	156,500	1.593	249,304.500	
	AUTO TRADER GROUP PLC	31,900	5.482	174,875.800	
	DCC PLC	3,150	56.860	179,109.000	
	OCADO GROUP PLC	15,200	22.180	337,136.000	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,450	108.500	265,825.000	

HALMA PLC	12,250	22.200	271,950.000	
GVC HOLDINGS PLC	19,100	10.425	199,117.500	
JD SPORTS FASHION PLC	14,600	7.332	107,047.200	
M&G PLC	83,700	1.934	161,917.650	
RELX PLC	63,146	17.420	1,100,003.320	
DIAGEO PLC	76,900	29.330	2,255,477.000	
RIO TINTO PLC	37,000	49.225	1,821,325.000	
STANDARD CHARTERED PLC	86,800	4.637	402,491.600	
TESCO PLC	320,700	2.278	730,554.600	
SMITH & NEPHEW PLC	29,050	14.525	421,951.250	
GLENCORE PLC	330,725	2.135	706,263.230	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,250	14.335	146,933.750	
SMITHS GROUP PLC	12,383	14.675	181,720.520	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	41,983	2.971	124,731.490	
PEARSON PLC	23,563	6.500	153,159.500	
SAINSBURY (J) PLC	54,225	2.165	117,397.120	
NEXT PLC	4,450	65.180	290,051.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	117,700	1.572	185,024.400	
WHITBREAD PLC	6,861	31.620	216,944.820	
BUNZL PLC	11,205	23.160	259,507.800	
VODAFONE GROUP PLC	870,183	1.249	1,086,858.560	
CRODA INTERNATIONAL PLC	4,261	59.500	253,529.500	
KINGFISHER PLC	68,211	2.709	184,783.590	
WPP PLC	40,900	7.494	306,504.600	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	22,827	8.992	205,260.380	
SEVERN TRENT PLC	7,833	23.880	187,052.040	
RENTOKIL INITIAL PLC	61,200	4.908	300,369.600	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	23,450	65.160	1,528,002.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	16,550	10.195	168,727.250	
SCHRODERS PLC	4,150	32.340	134,211.000	
SSE PLC	33,900	13.800	467,820.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	34,000	6.290	213,860.000	
ASTRAZENECA PLC	43,150	77.700	3,352,755.000	
FERGUSON PLC	7,487	83.240	623,217.880	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	195,500	2.563	501,066.500	
3I GROUP PLC	31,391	10.760	337,767.160	
ASHTEAD GROUP PLC	14,650	31.500	461,475.000	
SAGE GROUP PLC/THE	35,114	6.098	214,125.170	
NATIONAL GRID PLC	114,434	8.738	999,924.290	

	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,296,465	0.372	856,466.620	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	31,760	6.744	214,189.440	
	IMPERIAL BRANDS PLC	30,400	14.130	429,552.000	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,150	46.850	194,427.500	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	75,360	26.770	2,017,387.200	
	BHP GROUP PLC	68,727	17.378	1,194,337.800	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,500	21.260	244,490.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	669,650	4.048	2,711,078.020	
	ANGLO AMERICAN PLC	40,383	22.655	914,876.860	
	MONDI PLC	15,650	16.895	264,406.750	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	73,400	1.836	134,762.400	
	COMPASS GROUP PLC	58,939	14.180	835,755.020	
	PERSIMMON PLC	10,600	26.960	285,776.000	
	BT GROUP PLC	290,100	1.213	351,891.300	
	COCA-COLA HBC AG-DI	6,550	21.830	142,986.500	
	BURBERRY GROUP PLC	13,289	17.215	228,770.130	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	5,636	47.730	269,006.280	
	INTERTEK GROUP PLC	5,200	55.020	286,104.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	10,499	79.200	831,520.800	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	135,000	13.394	1,808,190.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	122,318	13.040	1,595,026.720	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,700	26.320	150,024.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,150	28.470	175,090.500	
	ANTOFAGASTA PLC	12,800	12.370	158,336.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	2.710	192,036.020	
	EXPERIAN PLC	29,654	25.850	766,555.900	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 49,505,477.980 (6,858,983,974)	
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	11.440	394,680.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,400	201.300	281,820.000	
	ICL GROUP LTD	23,600	15.550	366,980.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	950	427.400	406,030.000	
	BANK HAPOALIM BM	35,700	22.200	792,540.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	51,200	19.150	980,480.000	

	NICE LTD	2,200	796.200	1,751,640.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,100	72.800	298,480.000	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 5,272,650.000 (165,244,851)	
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	2.890	256,632.000	
	BHP GROUP LTD	95,750	38.720	3,707,440.000	
	SOUTH32 LTD	151,600	2.460	372,936.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	30,550	22.730	694,401.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	56,500	18.570	1,049,205.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	102,450	23.320	2,389,134.000	
	WESTPAC BANKING CORP	117,348	20.430	2,397,419.640	
	SANTOS LTD	53,100	6.250	331,875.000	
	AUSNET SERVICES	65,000	1.860	120,900.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	92,450	23.090	2,134,670.500	
	RIO TINTO LTD	12,250	102.000	1,249,500.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	53,500	5.190	277,665.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	4.300	258,000.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	29.310	99,654.000	
	COLES GROUP LTD	43,045	17.940	772,227.300	
	WISETECH GLOBAL LTD	4,500	29.950	134,775.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	25,000	12.850	321,250.000	
	EVOLUTION MINING LTD	53,000	5.100	270,300.000	
	AFTERPAY LTD	7,000	94.700	662,900.000	
	TPG TELECOM LTD	12,000	7.770	93,240.000	
	OIL SEARCH LTD	64,200	3.650	234,330.000	
	SEEK LTD	10,700	26.060	278,842.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	23,500	9.230	216,905.000	
	NEWCREST MINING LTD	26,000	27.090	704,340.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	57,450	80.710	4,636,789.500	
	AMPOL LTD	7,950	30.630	243,508.500	
	ORICA LTD	13,100	16.880	221,128.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	46,450	10.270	477,041.500	
	CIMIC GROUP LTD	2,800	25.560	71,568.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	41,300	37.560	1,551,228.000	
	COCA-COLA AMATIL LTD	15,700	12.650	198,605.000	

	TABCORP HOLDINGS LTD	72,763	3.930	285,958.590	
	CROWN RESORTS LTD	11,600	9.950	115,420.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	30,500	5.520	168,360.000	
	TELSTRA CORP LTD	134,500	3.110	418,295.000	
	AMP LTD	102,000	1.740	177,480.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	14,250	39.020	556,035.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	11,084	137.490	1,523,939.160	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	18,450	33.180	612,171.000	
	CSL LTD	14,750	303.000	4,469,250.000	
	WESFARMERS LTD	37,000	49.890	1,845,930.000	
	COCHLEAR LTD	2,050	222.210	455,530.500	
	BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	17.300	281,990.000	
	SUNCORP GROUP LTD	41,257	10.180	419,996.260	
	ASX LTD	6,250	77.240	482,750.000	
	COMPUTERSHARE LTD	15,900	14.210	225,939.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	70,936	5.320	377,379.520	
	SONIC HEALTHCARE LTD	14,350	33.260	477,281.000	
	AGL ENERGY LTD	19,000	13.720	260,680.000	
	BRAMBLES LTD	50,400	11.100	559,440.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,750	63.680	366,160.000	
	REA GROUP LTD	1,600	141.370	226,192.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	3,800	60.980	231,724.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 40,966,311.470 (3,150,719,015)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	8,300	24.230	201,109.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	700	1,620.320	1,134,224.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	9,287	75.930	705,161.910	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	14,900	51.010	760,049.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,650	143.700	668,205.000	
	BCE INC	4,930	57.030	281,157.900	
	FRANCO-NEVADA CORP	6,200	169.450	1,050,590.000	
	SUNCOR ENERGY INC	50,130	22.410	1,123,413.300	
	METRO INC/CN	8,200	60.060	492,492.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	11,000	73.480	808,280.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	39,900	64.890	2,589,111.000	

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,650	111.140	1,628,201.000	
TORONTO-DOMINION BANK	59,400	70.900	4,211,460.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	9,100	30.510	277,641.000	
ROYAL BANK OF CANADA	46,750	108.160	5,056,480.000	
TC ENERGY CORP	31,050	59.310	1,841,575.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	17,829	34.070	607,434.030	
BARRICK GOLD CORP	58,600	29.450	1,725,770.000	
CAE INC	7,900	33.470	264,413.000	
THOMSON REUTERS CORP	5,712	103.700	592,334.400	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,300	35.660	188,998.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,650	59.990	278,953.500	
HYDRO ONE LTD	10,500	29.670	311,535.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,960	64.300	383,228.000	
WSP GLOBAL INC	3,700	95.640	353,868.000	
PARKLAND CORP	4,400	39.590	174,196.000	
QUEBECOR INC -CL B	5,300	32.950	174,635.000	
EMERA INC	7,700	54.430	419,111.000	
SSR MINING INC	7,200	22.990	165,528.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,000	32.810	131,240.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	11,600	60.900	706,440.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	7,800	84.190	656,682.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	18,900	20.440	386,316.000	
B2GOLD CORP	34,700	7.030	243,941.000	
AIR CANADA	4,100	24.860	101,926.000	
KINROSS GOLD CORP	40,300	9.330	375,999.000	
BANK OF MONTREAL	21,100	96.770	2,041,847.000	
POWER CORP OF CANADA	18,100	29.690	537,389.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,500	1,343.000	4,700,500.000	
NUTRIEN LTD	18,819	64.300	1,210,061.700	
CANOPY GROWTH CORP	7,400	37.500	277,500.000	
CRONOS GROUP INC	5,500	10.840	59,620.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,800	52.020	457,776.000	
CAMECO CORP	12,800	13.230	169,344.000	
TELUS CORP	10,800	25.240	272,592.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	15,100	20.870	315,137.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	166.260	299,268.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	38,900	31.370	1,220,293.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	445.200	400,680.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,200	80.030	736,276.000	

	WESTON (GEORGE) LTD	2,537	97.500	247,357.500	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	7,000	38.160	267,120.000	
	BLACKBERRY LTD	16,000	7.990	127,840.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	19,250	59.180	1,139,215.000	
	ENBRIDGE INC	66,500	41.690	2,772,385.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	43,425	53.290	2,314,118.250	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	63,800	22.420	1,430,396.000	
	BAUSCH HEALTH COS INC	10,500	25.320	265,860.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,500	421.800	1,898,100.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	3,300	58.470	192,951.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,300	34.930	220,059.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,350	141.580	3,305,893.000	
	CGI INC - CLASS A	7,900	97.680	771,672.000	
	ONEX CORPORATION	2,600	71.300	185,380.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	15,100	22.680	342,468.000	
	IGM FINANCIAL INC	2,400	34.910	83,784.000	
	TMX GROUP LTD	1,900	126.330	240,027.000	
	OPEN TEXT CORP	8,700	58.190	506,253.000	
	CI FINANCIAL CORP	7,000	17.450	122,150.000	
	SAPUTO INC	8,000	36.010	288,080.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	18.040	348,172.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	28,300	43.000	1,216,900.000	
	YAMANA GOLD INC	32,300	6.660	215,118.000	
	FORTIS INC	15,000	52.940	794,100.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,800	88.690	337,022.000	
	LUNDIN MINING CORP	19,400	10.320	200,208.000	
	CENOVUS ENERGY INC	31,400	6.960	218,544.000	
	DOLLARAMA INC	9,700	52.730	511,481.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,200	39.670	87,274.000	
	ALTAGAS LTD	9,100	19.070	173,537.000	
	KEYERA CORP	7,400	23.460	173,604.000	
	INTER PIPELINE LTD	12,800	13.510	172,928.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 64,939,978.990 (5,191,951,320)	
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	23.060	968,520.000	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	62,900	25.680	1,615,272.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	43,675	4.510	196,974.250	
	KEPPEL CORP LTD	51,300	5.240	268,812.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	7.550	105,700.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	7.870	126,707.000	
	CAPITALAND LTD	82,900	3.140	260,306.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	91,300	0.920	83,996.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	21.000	56,700.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	116,400	10.150	1,181,460.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	209,000	0.845	176,605.000	
	VENTURE CORP LTD	8,600	19.170	164,862.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	290,950	2.420	704,099.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	50,000	4.020	201,000.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,300	9.220	251,706.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	65,900	4.290	282,711.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 6,645,430.250 (516,283,476)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	120,000	13.160	1,579,200.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	819.000	229,320.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,150	53.900	277,585.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	22,980	302.500	6,951,450.000	
	SIKA AG-REG	4,710	230.600	1,086,126.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	82,000.000	246,000.000	
	ABB LTD-REG	60,100	24.150	1,451,415.000	
	SWISS RE AG	9,750	83.740	816,465.000	
	NESTLE SA-REG	97,200	102.300	9,943,560.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	590	966.400	570,176.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,260	249.800	314,748.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	79,970	11.715	936,848.550	
	JULIUS BAER GROUP LTD	7,400	52.440	388,056.000	
	SGS SA-REG	200	2,588.000	517,600.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	690	242.000	166,980.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,450	132.350	191,907.500	
	TEMENOS AG - REG	2,120	115.100	244,012.000	

	ALCON INC	16,130	57.820	932,636.600	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	970	229.400	222,518.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,862	372.300	1,810,122.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,570	158.900	249,473.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	18.375	104,737.500	
	NOVARTIS AG-REG	72,600	81.060	5,884,956.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	100	1,972.000	197,200.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	17,160	76.780	1,317,544.800	
	SWISSCOM AG-REG	830	481.100	399,313.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,010	95.900	96,859.000	
	GEBERIT AG-REG	1,190	543.200	646,408.000	
	GIVAUDAN-REG	300	3,643.000	1,092,900.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	340	1,035.500	352,070.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,822	223.700	407,581.400	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,500	78.360	430,980.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,400	551.800	1,324,320.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	44.420	67,518.400	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	17,290	48.070	831,130.300	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,040	409.100	425,464.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,800	202.600	364,680.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,510	81.800	205,318.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	7,725.000	262,650.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 43,537,829.650 (5,005,544,275)	
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	3,520	411.600	1,448,832.000	
	ERICSSON LM-B SHS	99,630	106.150	10,575,724.500	
	VOLVO AB-B SHS	50,850	199.900	10,164,915.000	
	SKF AB-B SHARES	13,300	215.000	2,859,500.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	7,600	205.200	1,559,520.000	
	SWEDISH MATCH AB	5,650	692.000	3,909,800.000	
	TELE2 AB-B SHS	16,800	110.800	1,861,440.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	57,400	93.400	5,361,160.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	52,850	88.220	4,662,427.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	31,800	156.320	4,970,976.000	

	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	28,200	182.650	5,150,730.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	20,700	139.050	2,878,335.000	
	SKANSKA AB-B SHS	11,550	207.500	2,396,625.000	
	SANDVIK AB	38,450	196.200	7,543,890.000	
	INVESTOR AB-B SHS	15,600	595.000	9,282,000.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	22,950	439.700	10,091,115.000	
	SECURITAS AB-B SHS	10,950	142.900	1,564,755.000	
	TELIA CO AB	86,200	36.820	3,173,884.000	
	ALFA LAVAL AB	11,000	222.300	2,445,300.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	13,250	382.000	5,061,500.000	
	ASSA ABLOY AB-B	34,150	206.800	7,062,220.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,600	448.200	1,165,320.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,200	220.000	1,144,000.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	10,400	239.100	2,486,640.000	
	LUNDIN ENERGY AB	6,350	215.000	1,365,250.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	21,200	273.700	5,802,440.000	
	BOLIDEN AB	9,300	299.000	2,780,700.000	
	EPIROC AB-A	22,250	144.550	3,216,237.500	
	EPIROC AB-B	13,500	137.450	1,855,575.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	14,150	91.340	1,292,461.000	
	NORDEA BANK ABP	111,100	74.530	8,280,283.000	
	EQT AB	8,100	191.050	1,547,505.000	
	EVOLUTION GAMING GROUP	4,400	690.200	3,036,880.000	
	KINNEVIK AB - B	8,300	409.700	3,400,510.000	
	HEXAGON AB-B SHS	9,900	712.600	7,054,740.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,700	264.200	1,505,940.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 149,959,130.000 (1,832,500,569)	
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	59,500	419.250	24,945,375.000	
	DANSKE BANK A/S	22,700	104.000	2,360,800.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	105	11,520.000	1,209,600.000	
	H LUNDBECK A/S	2,300	193.950	446,085.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	6,800	1,234.000	8,391,200.000	
	GN STORE NORD A/S	4,300	501.400	2,156,020.000	
	CARLSBERG AS-B	3,650	939.800	3,430,270.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,250	359.300	2,604,925.000	

	COLOPLAST-B	4,050	929.800	3,765,690.000	
	DSV PANALPINA A/S	7,160	1,020.500	7,306,780.000	
	DEMANT A/S	3,425	218.700	749,047.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	220	12,415.000	2,731,300.000	
	TRYG A/S	4,000	181.100	724,400.000	
	PANDORA A/S	3,500	649.200	2,272,200.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,450	609.800	2,103,810.000	
	GENMAB A/S	2,290	2,319.000	5,310,510.000	
	ORSTED A/S	6,600	1,126.500	7,434,900.000	
	AMBU A/S-B	5,600	201.500	1,128,400.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 79,071,312.500 (1,321,281,632)	
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	6.180	256,470.000	
	MERCURY NZ LTD	23,000	6.000	138,000.000	
	A2 MILK CO LTD	26,200	14.670	384,354.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	62,089	4.650	288,713.850	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	38,900	7.655	297,779.500	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	20,400	33.950	692,580.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	14,000	15.000	210,000.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 2,267,897.350 (165,805,975)	
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	36.480	1,521,216.000	
	DNB ASA	33,100	163.550	5,413,505.000	
	ORKLA ASA	24,450	86.040	2,103,678.000	
	TELENOR ASA	25,400	153.400	3,896,360.000	
	EQUINOR ASA	33,823	146.850	4,966,907.550	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,710	364.000	2,078,440.000	
	MOWI ASA	14,100	183.150	2,582,415.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	192.000	1,411,200.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,100	342.000	1,060,200.000	
	ADEVINTA ASA	8,100	144.900	1,173,690.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 26,207,611.550	

				(308,201,512)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	32,270	49.510	1,597,687.700	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,500	25.140	163,410.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	63,950	9.484	606,501.800	
	COMMERZBANK AG	32,935	5.392	177,585.520	
	VOLKSWAGEN AG	1,010	160.900	162,509.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	6,120	145.920	893,030.400	
	SIEMENS AG-REG	25,050	112.680	2,822,634.000	
	E.ON SE	74,200	9.140	678,188.000	
	UNIPER SE	6,650	28.260	187,929.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,000	73.090	803,990.000	
	GEA GROUP AG	5,050	28.800	145,440.000	
	CONTINENTAL AG	3,590	116.950	419,850.500	
	BASF SE	30,120	60.920	1,834,910.400	
	ALLIANZ SE-REG	13,470	198.140	2,668,945.800	
	THYSSENKRUPP AG	11,450	5.564	63,707.800	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,800	89.860	521,188.000	
	RWE AG	21,200	34.870	739,244.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,650	10.070	97,175.500	
	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	46.940	55,389.200	
	BRENNTAG AG	5,000	63.860	319,300.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	13,550	38.070	515,848.500	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	33.520	111,286.400	
	HOCHTIEF AG	710	80.850	57,403.500	
	SAP SE	34,192	100.140	3,423,986.880	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,610	235.800	1,087,038.000	
	ZALANDO SE	4,950	80.460	398,277.000	
	HEIDELBERGCEMENT AG	4,900	60.500	296,450.000	
	KION GROUP AG	2,100	70.100	147,210.000	
	COVESTRO AG	5,600	47.450	265,720.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	364.000	440,440.000	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,000	55.000	275,000.000	
	DELIVERY HERO SE	4,150	99.000	410,850.000	
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	111.500	139,375.000	
	METRO AG	5,000	7.860	39,300.000	
	NEMETSCHEK SE	2,000	65.050	130,100.000	

SCOUT24 AG	3,600	63.050	226,980.000	
AROUNDTOWN SA	37,000	6.000	222,000.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,600	38.340	329,724.000	
KNORR-BREMSE AG	2,300	107.680	247,664.000	
TEAMVIEWER AG	4,450	39.560	176,042.000	
SIEMENS ENERGY AG	13,125	24.920	327,075.000	
KION GROUP AG-RTS	2,100	0.000	0.000	
BEIERSDORF AG	3,290	94.900	312,221.000	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	2,350	48.260	113,411.000	
MERCK KGAA	4,250	133.400	566,950.000	
ADIDAS AG	6,170	271.200	1,673,304.000	
PUMA SE	2,710	82.120	222,545.200	
HENKEL AG & CO KGAA	3,400	80.150	272,510.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	109,250	15.155	1,655,683.750	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,920	70.820	490,074.400	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	28,100	56.590	1,590,179.000	
QIAGEN N.V.	7,298	40.670	296,809.660	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	41,300	29.605	1,222,686.500	
HANNOVER RUECK SE	2,000	139.100	278,200.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	32,400	40.580	1,314,792.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,260	137.050	857,933.000	
LANXESS AG	2,500	59.480	148,700.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,710	204.400	349,524.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	11,000	41.000	451,000.000	
SYMRISE AG	4,220	105.350	444,577.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.394	80,917.200	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,950	55.500	108,225.000	
VONOVIA SE	17,050	56.560	964,348.000	
LEG IMMOBILIEN AG	2,300	118.000	271,400.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	30,210	43.230	1,305,978.300	
NN GROUP NV	9,050	34.420	311,501.000	
ARCELORMITTAL	23,300	15.294	356,350.200	
HEINEKEN NV	8,550	89.240	763,002.000	
AEGON NV	58,244	3.058	178,110.150	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZEN	36,233	23.810	862,707.730	

AKZO NOBEL N.V.	6,538	89.640	586,066.320	
KONINKLIJKE DSM NV	5,700	137.000	780,900.000	
WOLTERS KLUWER	8,900	69.760	620,864.000	
ING GROEP NV	126,250	8.416	1,062,520.000	
KONINKLIJKE KPN NV	114,650	2.538	290,981.700	
ASML HOLDING NV	13,930	366.350	5,103,255.500	
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,050	9.498	123,948.900	
GALAPAGOS NV	1,390	105.100	146,089.000	
ADYEN NV	600	1,616.000	969,600.000	
UNILEVER NV	47,950	50.260	2,409,967.000	
JUST EAT TAKEAWAY	4,000	88.180	352,720.000	
PROSUS NV	16,100	93.240	1,501,164.000	
VOPAK	2,300	45.740	105,202.000	
RANDSTAD NV	3,700	51.420	190,254.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,750	78.300	293,625.000	
ALTICE EUROPE NV	20,500	4.500	92,250.000	
JCDECAUX SA	2,700	17.890	48,303.000	
TOTAL SE	81,050	37.700	3,055,585.000	
MICHELIN (CGDE)	5,700	108.250	617,025.000	
AIR LIQUIDE SA	15,577	138.100	2,151,183.700	
KERING	2,500	606.200	1,515,500.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	18,200	117.450	2,137,590.000	
BOUYGUES SA	7,400	33.780	249,972.000	
BNP PARIBAS	36,450	43.825	1,597,421.250	
PEUGEOT SA	19,150	19.990	382,808.500	
NATIXIS	29,550	2.657	78,514.350	
THALES SA	3,500	79.860	279,510.000	
DANONE	20,000	52.780	1,055,600.000	
CARREFOUR SA	19,800	13.750	272,250.000	
SUEZ	11,225	16.175	181,564.370	
VIVENDI	26,891	25.390	682,762.490	
L'OREAL	8,230	309.300	2,545,539.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	16,850	40.300	679,055.000	
LEGRAND SA	8,817	71.420	629,710.140	
PERNOD RICARD SA	6,937	159.700	1,107,838.900	
EURAZEO SE	1,254	52.000	65,208.000	
SOCIETE GENERALE SA	26,950	17.328	466,989.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,100	496.000	4,513,600.000	

ACCOR SA	6,150	30.240	185,976.000	
CAPGEMINI SE	5,320	119.750	637,070.000	
VALEO SA	7,700	33.520	258,104.000	
PUBLICIS GROUPE	7,050	38.460	271,143.000	
BUREAU VERITAS SA	9,700	21.540	208,938.000	
EIFFAGE	2,740	84.180	230,653.200	
SODEXO SA	2,700	73.200	197,640.000	
IPSEN	1,150	80.000	92,000.000	
ORPEA	1,800	104.850	188,730.000	
AMUNDI SA	1,950	67.850	132,307.500	
TELEPERFORMANCE	1,920	275.000	528,000.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	78.900	236,700.000	
FAURECIA	2,250	42.720	96,120.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	4,400	67.510	297,044.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	900	293.600	264,240.000	
SEB SA	650	149.500	97,175.000	
ESSILORLUXOTTICA	9,250	120.950	1,118,787.500	
DASSAULT AVIATION SA	100	895.000	89,500.000	
WORLDLINE SA	7,814	78.260	611,523.640	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,000	35.160	105,480.000	
AXA SA	63,850	19.732	1,259,888.200	
EDENRED	7,950	48.670	386,926.500	
RENAULT SA	5,800	34.115	197,867.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,020	823.400	839,868.000	
STMICROELECTRONICS NV	21,050	33.210	699,070.500	
REMY COINTREAU	750	149.400	112,050.000	
ATOS SE	3,200	76.360	244,352.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	4,360	155.300	677,108.000	
WENDEL	780	93.800	73,164.000	
ORANGE	65,900	10.690	704,471.000	
ALSTOM	6,300	45.190	284,697.000	
CNP ASSURANCES	4,850	13.480	65,378.000	
SANOFI	37,075	85.210	3,159,160.750	
VINCI SA	17,000	87.980	1,495,660.000	
AIRBUS SE	19,400	90.000	1,746,000.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	17,500	19.795	346,412.500	
CREDIT AGRICOLE SA	37,600	9.864	370,886.400	
BIOMERIEUX	1,340	119.300	159,862.000	
ENGIE	60,223	12.520	753,991.960	

EDF	20,250	12.990	263,047.500	
SES	11,000	7.900	86,900.000	
SAFRAN SA	10,420	123.000	1,281,660.000	
ILIAD SA	490	173.600	85,064.000	
ARKEMA	2,220	97.480	216,405.600	
ADP	910	108.500	98,735.000	
SCOR SE	4,950	29.020	143,649.000	
GETLINK SE	14,200	14.230	202,066.000	
BOLLORE	28,600	3.256	93,121.600	
UCB SA	4,130	90.540	373,930.200	
KBC GROUP NV	8,250	59.680	492,360.000	
COLRUYT SA	1,600	49.180	78,688.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,600	82.920	298,512.000	
SOLVAY SA	2,450	96.500	236,425.000	
UMICORE	6,350	38.310	243,268.500	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	24,900	57.250	1,425,525.000	
AGEAS	5,790	41.850	242,311.500	
PROXIMUS	4,950	17.995	89,075.250	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	35.060	50,837.000	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	95.500	100,275.000	
SOFINA	550	263.000	144,650.000	
ARGENX SE	1,450	235.000	340,750.000	
PRYSMIAN SPA	7,850	26.900	211,165.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	37,243	14.470	538,906.210	
MEDIOBANCA SPA	18,865	7.730	145,826.450	
TENARIS SA	13,300	6.704	89,163.200	
UNICREDIT SPA	69,656	9.094	633,451.660	
TELECOM ITALIA SPA	262,982	0.401	105,508.370	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.428	73,714.960	
INTESA SANPAOLO	550,737	1.944	1,070,963.170	
ATLANTIA SPA	17,257	15.270	263,514.390	
POSTE ITALIANE SPA	16,000	8.800	140,800.000	
MONCLER SPA	6,300	41.010	258,363.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,450	45.310	156,319.500	
ENI SPA	84,100	8.582	721,746.200	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	9.554	186,303.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	4.345	47,795.000	
DIASORIN SPA	850	172.800	146,880.000	

INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	8,300	10.740	89,142.000	
NEXI SPA	12,050	15.890	191,474.500	
LEONARDO SPA	13,175	5.986	78,865.550	
ENEL SPA	267,134	8.502	2,271,173.260	
SNAM SPA	66,600	4.701	313,086.600	
TERNA SPA	46,300	6.332	293,171.600	
EXOR NV	3,530	58.720	207,281.600	
CNH INDUSTRIAL NV	32,800	9.194	301,563.200	
FINECOBANK SPA	19,700	13.115	258,365.500	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	36,000	13.226	476,136.000	
FERRARI NV	4,145	178.550	740,089.750	
TELEFONICA SA	157,227	3.736	587,400.070	
ENDESA SA	10,350	24.290	251,401.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	220,512	3.958	872,786.490	
IBERDROLA SA	194,434	11.470	2,230,157.980	
BANKINTER SA	21,500	4.174	89,741.000	
REPSOL SA	49,400	8.486	419,208.400	
GRIFOLS SA	9,800	24.430	239,414.000	
BANCO SANTANDER SA	547,750	2.465	1,350,203.750	
AMADEUS IT GROUP SA	14,600	60.340	880,964.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	19.910	187,154.000	
MAPFRE SA	30,650	1.579	48,396.350	
CAIXABANK SA	117,500	2.203	258,852.500	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	26.820	238,054.320	
AENA SME SA	2,250	143.800	323,550.000	
CELLNEX TELECOM SA	10,455	51.440	537,805.200	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	36,000	28.280	1,018,080.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	7,700	28.860	222,222.000	
ENAGAS SA	7,950	20.780	165,201.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	13,900	17.130	238,107.000	
FERROVIAL SA	16,270	23.610	384,134.700	
UPM-KYMMENE OYJ	17,550	28.300	496,665.000	
NOKIA OYJ	186,400	3.418	637,115.200	
WARTSILA OYJ ABP	14,700	8.052	118,364.400	

	STORA ENSO OYJ-R SHS	18,850	14.505	273,419.250	
	ELISA OYJ	4,600	45.420	208,932.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	15,300	36.030	551,259.000	
	FORTUM OYJ	13,850	19.285	267,097.250	
	KONE OYJ-B	11,250	69.620	783,225.000	
	NESTE OYJ	13,900	57.500	799,250.000	
	ORION OYJ-CLASS B	3,200	39.990	127,968.000	
	VERBUND AG	2,000	59.000	118,000.000	
	OMV AG	4,450	29.520	131,364.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	9,450	24.980	236,061.000	
	VOESTALPINE AG	4,250	26.930	114,452.500	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	4,400	16.760	73,744.000	
	ANDRITZ AG	2,100	34.940	73,374.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,550	35.580	268,629.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	5,000	72.000	360,000.000	
	JERONIMO MARTINS	7,700	14.170	109,109.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	88,300	4.600	406,180.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	15,050	9.558	143,847.900	
	KERRY GROUP PLC-A	5,150	116.400	599,460.000	
	CRH PLC	25,350	34.150	865,702.500	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,960	154.000	763,840.000	
ユーロ　小計				ユーロ 135,724,829.440 (16,881,454,286)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	47,500	41.200	1,957,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	77,000	61.750	4,754,750.000	
	MTR CORP	52,500	42.850	2,249,625.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	44,500	105.300	4,685,850.000	
	SINO LAND CO	104,000	10.500	1,092,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	95,669	57.500	5,500,967.500	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	15,500	46.500	720,750.000	
	CLP HOLDINGS LTD	56,000	73.000	4,088,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	48,507	32.300	1,566,776.100	
	HONG KONG & CHINA GAS	377,358	12.100	4,566,031.800	
	HANG SENG BANK LTD	26,100	137.600	3,591,360.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	52,500	41.400	2,173,500.000	

	WH GROUP LTD	321,000	6.560	2,105,760.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	41,900	386.200	16,181,780.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	66,000	20.050	1,323,300.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,800	92.900	1,003,320.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	20.000	450,000.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	45,240	16.440	743,745.600	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	26,000	34.700	902,200.000	
	SJM HOLDINGS LTD	58,000	9.110	528,380.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	38,200	23.550	899,610.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	43.750	3,988,643.750	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20,000	40.050	801,000.000	
	PCCW LTD	147,000	4.670	686,490.000	
	AIA GROUP LTD	419,400	88.500	37,116,900.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	57,000	37.650	2,146,050.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	60,900	27.750	1,689,975.000	
	SANDS CHINA LTD	82,400	33.100	2,727,440.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	47,000	101.200	4,756,400.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	125,500	25.200	3,162,600.000	
	WYNN MACAU LTD	54,000	13.720	740,880.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 118,901,084.750 (1,593,274,536)	
合計				151,364,986,629 [151,364,986,629]	

(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
新株予約権証券	スイス・フラン	CIF -CW	34,320.000	スイス・フラン 7,550.400	
	スイス・フラン　小計			スイス・フラン 7,550.400 (868,069)	
新株予約権証券　合計				868,069 [868,069]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	

		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,587	770,019.690	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	10,137	867,220.350	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,950	507,028.500	
		VORNADO REALTY TRUST	5,397	217,661.010	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,650	1,042,914.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	12,350	731,120.000	
		EQUINIX INC	2,918	2,044,117.360	
		AMERICAN TOWER CORP	14,500	3,394,305.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	22,243	325,192.660	
		INVITATION HOMES INC	17,700	509,052.000	
		VICI PROPERTIES INC	15,400	395,472.000	
		VENTAS INC	12,200	584,380.000	
		WEYERHAEUSER CO	24,114	692,312.940	
		AGNC INVESTMENT CORP	18,100	281,817.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	13,750	2,298,587.500	
		IRON MOUNTAIN INC	9,710	258,480.200	
		VEREIT INC	33,500	245,890.000	
		SUN COMMUNITIES INC	3,250	450,482.500	
		PROLOGIS INC	24,402	2,454,841.200	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,120	668,016.800	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,200	312,768.000	
		DUKE REALTY CORP	12,150	466,438.500	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,170	542,521.700	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,360	208,553.200	
		WELLTOWER INC	13,850	893,879.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	17,650	527,382.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,750	465,000.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,800	340,518.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	45,100	368,016.000	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5,350	205,386.500	
		REALTY INCOME CORP	11,200	690,368.000	
		PUBLIC STORAGE	5,220	1,148,556.600	
		REGENCY CENTERS CORP	5,300	248,517.000	
		UDR INC	9,750	382,395.000	
		WP CAREY INC	5,800	405,362.000	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7,600	272,460.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,900	1,216,897.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,250	467,500.000	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17,250	337,582.500	

アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 28,239,012.210 (2,933,750,978)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,662	144,073.960	
	SEGRO PLC	38,450	346,588.300	
	BRITISH LAND CO PLC	29,550	138,914.550	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 629,576.810 (87,227,867)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	21,500	305,300.000	
	TRANSURBAN GROUP	89,500	1,267,320.000	
	SYDNEY AIRPORT	42,500	285,600.000	
	APA GROUP	38,100	402,717.000	
	SCENTRE GROUP	159,922	460,575.360	
	DEXUS	33,150	325,533.000	
	GPT GROUP	63,160	299,378.400	
	MIRVAC GROUP	126,100	329,121.000	
	STOCKLAND	78,000	360,360.000	
	GOODMAN GROUP	52,900	984,469.000	
	VICINITY CENTRES	123,273	205,865.910	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 5,226,239.670 (401,950,093)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,800	74,880.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,100	50,925.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,400	123,216.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	85,399.000	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 334,420.000 (26,736,879)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	3,737	0.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101,000	305,020.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	158,032	314,483.680	

		SUNTEC REIT	63,000	96,390.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	91,800	179,928.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	65,500	135,585.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 1,031,406.680 (80,129,985)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,200	265,272.000	
		ICADE	950	56,905.000	
		GECINA SA	1,400	177,940.000	
		KLEPIERRE	6,250	121,125.000	
		COVIVIO	1,500	108,000.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 729,242.000 (90,703,120)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	70,500	4,829,250.000	
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92,000	716,680.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	122,000	1,263,920.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 6,809,850.000 (91,251,990)	
投資証券　合計				3,711,750,912 [3,711,750,912]	
合計				3,712,618,981 [3,712,618,981]	

新株予約権証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入新株予約権証券時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式　591銘柄 投資証券　39銘柄	97.4%	-%	2.6%	71.7%
イギリス・ポンド	株式　83銘柄 投資証券　3銘柄	98.7%	-%	1.3%	4.5%
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	88.7%	-%	11.3%	2.3%
カナダ・ドル	株式 82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	86.6%	-%	13.4%	0.4%
スイス・フラン	株式 39銘柄 新株予約権証券 1銘柄	100%	0.0%	-%	3.2%
スウェーデン・クローナ	株式 36銘柄	100%	-%	-%	1.2%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	100%	-%	-%	0.9%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	-%	0.2%
ユーロ	株式 240銘柄 投資証券 5銘柄	99.5%	-%	0.5%	10.9%
香港・ドル	株式 31銘柄 投資証券 3銘柄	94.6%	-%	5.4%	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12月2日現在	2020年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,082,925,447	635,260,286
コール・ローン	1,729,159,455	1,397,690,109
国債証券	187,330,033,946	215,573,016,059

派生商品評価勘定	4,341,690	162,494
未収入金	2,827,376,943	21,902,130
未収利息	1,281,708,922	1,222,948,097
前払費用	46,960,770	58,449,028
流動資産合計	194,302,507,173	218,909,428,203
資産合計	194,302,507,173	218,909,428,203
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,600,751	69,348
未払金	3,832,899,493	2,087,434
未払解約金	3,405,669	71,815,810
その他未払費用	987	―
流動負債合計	3,837,906,900	73,972,592
負債合計	3,837,906,900	73,972,592
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	66,118,107,712	72,688,498,430
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	124,346,492,561	146,146,957,181
元本等合計	190,464,600,273	218,835,455,611
純資産合計	190,464,600,273	218,835,455,611
負債純資産合計	194,302,507,173	218,909,428,203

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12月3日 至　2020年11月30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12月2日現在	2020年11月30日現在
1．※1　期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	61,445,933,589円	66,118,107,712円
期中追加設定元本額	8,771,520,025円	13,500,674,811円
期中一部解約元本額	4,099,345,902円	6,930,284,093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	653,486,435円	601,675,980円

ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	22,093,366円	12,401,222円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	128,330,909円	102,686,952円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	41,751,987円	29,631,947円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	442,528,295円	339,511,943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）	31,239,348円	90,339,707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）	413,208,724円	462,489,583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）	1,427,469,459円	1,814,096,236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）	787,285,961円	654,015,808円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	2,452,065円	1,055,376円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	314,458円	957,155円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	600,033,543円	691,990,376円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	772,093,354円	989,492,660円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	14,937,740円	49,115,601円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	45,506,848,020円	48,408,053,236円
ダイワ・ライフ・バランス３０	786,129,849円	819,754,500円
ダイワ・ライフ・バランス５０	407,847,078円	459,770,424円
ダイワ・ライフ・バランス７０	255,622,913円	279,428,323円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	420,775,557円	459,816,979円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	323,134,588円	336,784,366円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	107,264,235円	108,589,082円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	9,559,864円	8,547,742円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	21,464,206円	19,902,336円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	3,128,858円	4,844,467円
ダイワつみたてインデックス外国債券	59,508,551円	163,786,187円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	125,482円	3,047,233円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	40,800円	977,653円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	199,958円	951,206円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	198,065,881円	174,483,363円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	149,085,433円	131,594,279円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	4,935,026,873円	4,234,846,474円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	282,957,531円	250,419,145円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	144,999,465円	142,610,494円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	32,445,382円	34,513,413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）	1,312,096,170円	4,864,458,623円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,710,869,559円	5,832,536,410円
ダイワライフスタイル２５	34,837,008円	33,396,711円
ダイワライフスタイル５０	61,720,946円	59,767,812円
ダイワライフスタイル７５	17,127,861円	16,157,426円

計	66,118,107,712円	72,688,498,430円
2. 期末日における受益権の総数	66,118,107,712口	72,688,498,430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12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30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12月2日現在	2020年11月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	11,319,542,417	6,708,826,689
合計	11,319,542,417	6,708,826,689

（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12月2日まで、及び2019年12月3日から2020年11月30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12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	792,943,342	－	794,138,360	△1,195,018	5,665,440	－	5,665,440	0
アメリカ・ドル	692,834,338	－	693,818,820	△984,482	－	－	－	－
オーストラリア・ドル	88,958,190	－	89,162,240	△204,050	－	－	－	－
デンマーク・クローネ	11,150,814	－	11,157,300	△6,486	－	－	－	－
マレーシア・リンギット	－	－	－	－	5,665,440	－	5,665,440	0
買　建	2,973,436,433	－	2,977,372,390	3,935,957	2,102,427,594	－	2,102,520,740	93,146

アメリカ・ドル	823,263,537	－	824,358,700	1,095,163	650,675,209	－	650,674,400	△809
イギリス・ポンド	252,244,214	－	252,213,690	△30,524	56,666,132	－	56,662,860	△3,272
オーストラリア・ドル	6,661,404	－	6,668,100	6,696	28,675,523	－	28,678,740	3,217
カナダ・ドル	71,898,106	－	72,050,790	152,684	37,572,016	－	37,561,640	△10,376
シンガポール・ドル	54,130,613	－	54,182,700	52,087	25,689,605	－	25,688,910	△695
スウェーデン・クローナ	25,859,325	－	25,859,330	5	16,083,586	－	16,069,300	△14,286
デンマーク・クローネ	－	－	－	－	29,879,064	－	29,877,480	△1,584
ノルウェー・クローネ	42,874,854	－	42,731,410	△143,444	－	－	－	－
ポーランド・ズロチ	45,895,875	－	46,015,630	119,755	－	－	－	－
マレーシア・リンギット	15,757,800	－	15,738,000	△19,800	－	－	－	－
メキシコ・ペソ	72,071,067	－	71,975,920	△95,147	－	－	－	－
ユーロ	1,501,277,606	－	1,503,729,120	2,451,514	1,257,186,459	－	1,257,307,410	120,951
南アフリカ・ランド	61,502,032	－	61,849,000	346,968	－	－	－	－
合計	3,766,379,775	－	3,771,510,750	2,740,939	2,108,093,034	－	2,108,186,180	93,146

（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12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	2.8807円	3.0106円
（1万口当たり純資産額）	(28,807円)	(30,106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% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,191,754.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,297,410.480	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,516,147.160	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,606,854.730	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,858,904.840	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,526,001.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,865,419.350	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,854,916.080	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,398,729.830	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,654,222.280	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,296,511.360	
		8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,265,592.680	

		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	761,367.180	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,102,077.900	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	977,859.890	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	955,990.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	1,000,676.340	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	645,791.630	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	1,072,278.060	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,466,184.880	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,748,829.600	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,346,001.580	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	826,148.360	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	795,284.460	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,445,731.800	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,687,979.380	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,645,395.600	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,856,781.300	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,597,921.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,586,871.920	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,586,630.390	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,241,135.780	

		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	2,033,536.560	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	2,122,670.550	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	2,185,769.450	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,924,411.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	2,158,963.290	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,765,448.520	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,805,125.540	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	2,048,958.900	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,496,046.320	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,947,001.160	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,603,283.640	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	3,036,303.860	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,747,859.900	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,615,147.860	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,645,285.660	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,579,265.900	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,200,679.460	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,377,982.780	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	5,047,875.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,936,707.020	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,238,432.790	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,527,000.000	2,567,457.270	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	6,152,188.750	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	3,099,615.310	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,809,000.000	3,885,751.350	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,953,098.680	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,250,576.960	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,727,798.200	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,671,579.720	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	1,326,000.000	1,360,184.280	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,908,479.210	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220731	4,179,000.000	4,307,922.150	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	6,189,403.390	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,373,000.000	4,351,675.950	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,518,350.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,544,602.640	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,378,331.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	2,159,000.000	2,846,835.810	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,642,720.960	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,518,298.730	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,195,923.200	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,366,000.000	4,643,284.660	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,649,431.330	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,648,000.000	4,419,479.040	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,050,386.080	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,735,928.910	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	3,729,000.000	3,969,632.370	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,142,594.900	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	4,148,231.010	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,590,425.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,092,790.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,716,386.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	4,028,622.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,859,480.200	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,478,168.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,589,142.950	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,767,884.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	3,031,620.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,604,675.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,500,000.000	4,536,035.000	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,632,975.800	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	3,400,000.000	3,454,978.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211231	4,000,000.000	4,080,600.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,657,400.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	6,140,000.000	6,790,410.200	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,070,892.300	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,639,836.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,701,272.650	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,074,895.600	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,441,588.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,837,924.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,966,816.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	7,149,440.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,656,560.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,072,870.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,181,170.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,072,180.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,626,692.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,075,930.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,550,936.000	

		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,556,375.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,984,506.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,205,530.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,450,000.000	4,390,125.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,282,496.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,120,780.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,579,100.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,677,125.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,588,475.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	6,122,600.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	4,460,295.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,769,850.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,433,984.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	3,022,460.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,667,335.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	5,650,000.000	6,500,551.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,481,731.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,838,264.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,979,693.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	5,060,498.000	

		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,057,209.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,189,072.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,721,492.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,558,785.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,655,250.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,112,857.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,953,812.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,660,350.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,657,600.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,329,760.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,114,071.500	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,812,267.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,635,345.800	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,794,325.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,853,656.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	4,006,404.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,817,175.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,227,340.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,821,075.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,312,160.000	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,106,240.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	6,900,000.000	8,200,719.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	6,447,328.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,371,460.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,160,460.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,872,716.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,895,920.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,686,325.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,079,320.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,610,592.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,085,410.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,289,680.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,786,125.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	6,295,791.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,774,400.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,531,231.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,600,485.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,743,550.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,806,782.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,497,614.000	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	6,094,383.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,425,876.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,741,710.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	3,093,552.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,585,155.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,276,540.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,688,650.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	3,021,788.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,102,960.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,802,885.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,699,200.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	7,414,740.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,580,500.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	5,351,778.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,945,012.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,148,720.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	3,071,820.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,665,625.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,141,300.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,966,033.000	

		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,047,650.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,550,000.000	2,582,359.500	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,200,130.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	6,356,376.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	5,371,155.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20211130	1,500,000.000	1,520,910.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,133,900.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,145,770.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,089,640.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,687,875.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,648,625.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20211231	1,500,000.000	1,524,255.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,114,200.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	4,700,000.000	4,910,372.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,500,000.000	2,536,025.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,310,007.500	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	3,600,000.000	3,829,752.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,392,000.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,964,462.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20220228	200,000.000	202,460.000	

		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	311,013.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,380,336.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	1,200,000.000	1,209,228.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,512,300.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20220331	200,000.000	200,616.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	13,200,000.000	13,227,324.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,609,360.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,670,130.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,496,010.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,706,750.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,200,000.000	3,199,616.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	5,700,000.000	5,684,382.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	5,168,184.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,814,450.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220531	500,000.000	499,820.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,488,765.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,990,610.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,510,505.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	5,500,000.000	5,497,635.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,470,675.000	

		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,486,595.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	998,630.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,386,162.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220731	3,500,000.000	3,497,935.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	800,000.000	798,904.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	9,810,100.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,936,300.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	7,700,000.000	7,333,018.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,800,000.000	5,570,668.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,481,380.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,000,000.000	2,997,990.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,996,640.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	6,468,475.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220930	3,000,000.000	2,998,230.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,942,160.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,484,390.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,191,936.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 897,323,813.560 (93,222,970,991)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	

		2% United Kingdom Gilt 20250907	1,621,000.000	1,776,470.110	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,785,089.240	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,586,888.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,341,042.400	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,940,000.000	2,247,955.600	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	2,750,000.000	3,212,550.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,510,000.000	1,969,915.800	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,010,000.000	2,163,061.500	
		0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,042,480.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,500,000.000	2,787,450.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,060,000.000	1,491,473.000	
		1% United Kingdom Gilt 20240422	2,600,000.000	2,692,118.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,110,000.000	1,366,931.700	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,051,832.500	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,800,000.000	1,899,072.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	2,600,000.000	2,674,360.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	940,000.000	1,021,968.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,306,394.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,313,018.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	650,000.000	590,284.500	

		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,505,430.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,000,000.000	997,300.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	1,038,268.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	900,000.000	898,767.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,304,849.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,386,773.700	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,635,984.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,788,509.440	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,547,862.620	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,257,000.000	2,127,698.760	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,915,807.480	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,666,000.000	3,001,082.420	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,589,526.400	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	4,231,624.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,830,000.000	2,635,053.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,530,547.750	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,345,975.940	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,453,007.160	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,260,000.000	1,926,489.600	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,574,000.000	3,287,487.880	

	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,604,415.500	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,824,314.080	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,313,407.700	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,278,847.480	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,682,646.840	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,586,000.000	3,330,615.860	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,206,692.760	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,368,685.230	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 104,078,024.550 (14,420,010,301)	
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	2,000,000.000	2,681,980.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20220131	2,000,000.000	2,127,620.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,971,540.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,254,320.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,232,360.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,450,167.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,970,406.000	
	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,022,390.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,100,000.000	2,940,147.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	2,020,572.000	

	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,557,210.000	
	0.75% Israel Government Bond - Fixed 20220731	1,000,000.000	1,010,450.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,900,000.000	1,936,062.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	600,000.000	603,978.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	700,000.000	706,643.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	1,000,000.000	998,300.000	
イスラエル・シュケル　小計			イスラエル・シュケル 29,484,145.000 (924,033,104)	
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	3,162,000.000	3,453,599.640	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	3,568,000.000	4,026,987.520	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,789,000.000	3,541,890.550	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	3,473,000.000	3,783,347.280	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	3,404,000.000	4,102,466.760	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	3,498,000.000	3,960,155.760	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,762,156.080	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	3,248,000.000	3,928,813.280	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,497,185.340	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,568,308.510	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	1,008,667.440	

	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,075,926.240	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	3,678,000.000	4,117,778.460	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,567,178.480	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	800,000.000	816,808.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,249,008.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,850,000.000	1,928,736.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,600,000.000	3,039,686.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	4,870,000.000	5,605,077.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	990,000.000	1,176,842.700	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	3,000,261.200	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	900,000.000	922,986.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,406,528.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,700,000.000	2,725,866.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,500,000.000	1,454,475.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	2,500,000.000	2,494,900.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,505,950.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	2,700,000.000	2,715,687.000	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 75,437,273.040 (5,801,880,670)	
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	622,306.800	

		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	586,000.000	866,770.180	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,401,315.650	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,771,852.420	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,645,623.320	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	2,111,818.570	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,818,413.500	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,461,000.000	2,219,244.390	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,292,156.250	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,512,904.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,846,303.410	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,252,491.320	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	1,023,951.990	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,279,853.600	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,445,990.400	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,774,080.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,328,856.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,445,770.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,362,205.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	2,110,000.000	2,559,303.400	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,386,603.200	

		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,276,524.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,462,034.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,630,469.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20211101	800,000.000	808,280.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	1,600,000.000	1,660,496.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	1,100,000.000	1,117,369.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220501	5,000.000	5,093.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,902,802.700	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220801	2,300,000.000	2,301,633.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20221101	700,000.000	700,280.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	900,000.000	880,461.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	500,000.000	494,980.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	500,000.000	499,405.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,500,300.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 54,207,941.100 (4,333,924,891)	
	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	905,478.800	
		3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	788,000.000	827,494.560	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	683,804.800	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	958,042.070	

		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	512,000.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	713,474.300	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	724,768.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	728,250.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	568,802.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	908,848.000	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	488,340.000	
		1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	510,050.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	650,000.000	751,003.500	
		1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	464,400.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	623,590.000	
		2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	516,117.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	418,169.500	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	470,000.000	554,759.800	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 11,857,392.330 (921,200,810)	
	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	4,655,000.000	7,308,908.600	
		3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	8,962,488.050	
		1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,471,912.250	
		2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,570,805.600	

	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,723,238.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,869,956.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,977,422.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	3,000,000.000	3,041,970.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 56,926,701.300 (695,644,290)	
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	13,662,000.000	26,252,899.200	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	7,812,438.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,162,589.180	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,735,161.300	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,490,920.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,450,510.700	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	4,300,000.000	4,377,099.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,200,000.000	2,416,040.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 71,697,657.380 (1,198,067,855)	
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	8,555,869.560	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,448,193.750	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,693,073.750	

	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,508,336.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,687,774.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,828,790.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	4,166,431.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	5,045,040.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 38,933,508.560 (457,858,061)	
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	2,547,612.060	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,835,403.210	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,520,094.800	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	3,320,000.000	3,424,580.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	4,051,509.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	3,101,092.400	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	5,517,600.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,666,356.000	
	Poland Government Bond 20220725	3,200,000.000	3,198,464.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	1,000,000.000	1,013,990.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,300,000.000	1,302,860.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,154,037.150	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,924,223.750	

	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	4,125,595.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	5,186,498.610	
ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 49,569,915.980 (1,373,582,372)	
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	2,373,000.000	2,511,156.060	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,336,629.480	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,668,019.220	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,449,357.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	900,847.500	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	791,841.130	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,036,935.900	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,520,882.330	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,271,546.180	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	691,284.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,135,218.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,877,280.120	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,203,759.630	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,349,564.000	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,364,118.420	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,030,319.100	

		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	702,819.000	
		3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	358,934.400	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	1,600,000.000	1,645,120.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	804,187.500	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,291,745.000	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,229,686.500	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,284,096.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	2,500,000.000	2,611,250.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,372,476.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	710,010.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	700,823.500	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	2,065,989.700	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,351,080.000	
		3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	419,660.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,354,379.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,786,977.500	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	700,000.000	699,986.000	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	500,000.000	496,485.000	
マレーシア・リンギット　小計				マレーシア・リンギット 42,024,463.170 (1,072,884,545)	
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	20,912,903.000	

	8% Mexican Bonos 20471107	18,300,000.000	20,526,744.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	29,000,000.000	29,831,430.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	26,462,268.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	7,200,000.000	7,556,256.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	32,936,290.110	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	28,453,324.830	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	31,272,139.520	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,998,535.400	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	35,381,008.080	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	16,894,000.000	20,095,750.880	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	15,015,000.000	17,243,226.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	28,599,000.000	29,485,854.990	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	21,576,947.360	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	9,069,982.560	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 342,802,660.730 (1,779,145,809)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	614,000.000	688,828.180	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	300,326.760	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	1,111,000.000	1,181,948.460	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	204,182.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	496,317.600	
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	777,931.000	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	860,424.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	439,600.700	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	541,460.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	544,365.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	205,468.000	

		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	324,889.300	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	427,464.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	520,805.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,502,611.200	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,220,178.640	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	1,090,630.240	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	409,632.000	
		Austria Government Bond 20230715	900,000.000	917,172.000	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,780,000.000	1,910,794.400	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	1,225,756.800	
		Austria Government Bond 20220920	400,000.000	405,328.000	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	900,000.000	987,930.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,063,770.400	
		Austria Government Bond 20240715	800,000.000	820,816.000	
		Austria Government Bond 20300220	680,000.000	708,016.000	
		Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,017,270.000	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	842,667.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	404,544.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,815,432.470	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	2,026,936.920	

		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,412,176.080	
		1% Belgium Government Bond 20260622	2,283,000.000	2,493,401.280	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,667,905.440	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	1,098,585.600	
		0.2% Belgium Government Bond 20231022	1,490,000.000	1,529,827.700	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,529,248.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,099,854.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	780,000.000	1,281,438.600	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	498,936.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,340,000.000	1,477,323.200	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	850,000.000	1,012,222.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,678,260.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	835,518.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,278,425.800	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	698,860.800	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,246,668.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,189,896.840	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,741,840.860	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	3,167,697.540	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,357,901.500	

		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	3,219,793.830	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,647,651.600	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,405,000.000	2,446,301.700	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	6,208,790.570	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,510,689.500	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,439,000.000	2,939,776.270	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,874,000.000	5,185,586.940	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,807,000.000	1,862,023.150	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,311,746.580	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,728,110.400	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,710,253.200	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,481,910.000	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,920,223.770	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,721,611.320	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,690,641.050	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,979,000.000	5,158,049.130	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,722,253.240	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,315,522.140	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,315,372.080	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,402,458.440	

		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,528,763.520	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,527,907.800	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	6,200,000.000	6,595,994.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,496,167.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,370,000.000	3,358,432.200	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,071,304.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,400,000.000	4,730,264.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,371,864.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,174,540.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,750,000.000	1,846,775.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,852,672.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,200,000.000	2,328,282.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,101,060.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	700,000.000	741,027.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,273,272.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211210	800,000.000	806,000.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220311	300,000.000	302,820.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220610	100,000.000	101,134.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220916	100,000.000	101,352.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,171,681.200	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,129,988.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,838,125.100	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,943,985.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,971,417.600	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,752,343.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,482,632.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,387,837.000	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,428,627.650	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,033,051.000	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	5,031,553.680	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	5,073,837.420	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,574,703.140	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,853,105.200	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	4,104,384.860	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,696,800.800	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,564,000.000	6,786,176.760	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,983,062.260	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,861,998.140	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,819,703.800	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,199,000.000	6,415,150.080	

		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	3,694,000.000	3,905,222.920	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,495,071.320	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,554,547.470	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,617,741.300	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,887,000.000	7,540,952.650	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,385,372.720	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,679,171.200	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,528,871.880	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,920,000.000	5,882,598.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,787,000.000	4,025,164.430	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	3,869,000.000	4,674,951.390	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,287,000.000	1,993,112.550	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,800,000.000	3,996,802.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,042,760.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,408,745.200	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,753,940.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	3,000,000.000	4,401,960.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,440,296.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,827,460.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,717,959.000	

		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,453,662.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,481,566.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,412,040.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,750,000.000	3,690,940.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,250,000.000	5,685,907.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,130,000.000	3,221,583.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,800,000.000	2,907,436.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,438,688.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,870,000.000	2,098,588.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,098,220.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,000,000.000	1,083,220.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	2,000,000.000	2,070,120.000	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	645,176.840	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,648,121.610	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,685,000.000	2,897,054.200	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	867,220.760	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,779,000.000	3,332,511.750	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,508,318.200	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,593,887.840	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,477,033.250	

		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,579,000.000	2,830,878.570	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,666,232.700	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,872,956.160	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,638,000.000	1,749,531.420	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,209,816.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,407,614.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,432,928.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,272,176.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,286,628.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	1,033,227.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,900,000.000	1,994,069.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	832,456.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	600,000.000	620,868.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,906,000.000	2,428,110.580	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,577,887.200	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,414,077.680	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	2,007,844.040	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	2,126,618.610	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,669,545.810	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,666,312.700	

		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,284,385.600	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,083,692.900	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,555,301.440	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	2,077,946.500	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,400,626.170	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,938,863.740	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,754,242.120	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,141,040.520	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,593,989.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,368,633.140	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,288,853.280	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,798,650.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,705,650.700	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,394,445.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	2,050,000.000	2,095,858.500	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,710,379.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	3,028,725.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,738,743.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,703,520.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,686,958.000	

		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,358,069.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,957,703.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,389,700.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	3,050,000.000	3,638,741.500	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,374,856.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,744,912.500	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,684,045.400	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,967,200.000	
		1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,550,000.000	1,587,262.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,318,608.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,354,858.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,339,043.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,660,837.500	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	2,050,195.000	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	747,385.200	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,327,092.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,449,828.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,800,000.000	2,235,960.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,603,995.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,049,740.000	

		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,502,561.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	2,081,900.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,400,000.000	2,654,760.000	
		0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,322,555.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	1,700,000.000	1,780,903.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	800,000.000	819,944.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,400,000.000	1,539,146.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,300,000.000	1,339,754.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	100,000.000	100,807.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	800,000.000	845,072.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,912,883.200	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,399,511.270	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,852,441.500	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,522,489.300	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,943,682.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,375,604.680	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,560,647.560	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,581,630.200	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,740,695.960	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,555,932.500	

		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,150,787.760	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	2,657,000.000	2,934,098.530	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,183,734.000	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,222,170.000	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,119,234.480	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	3,079,724.970	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,535,167.000	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,526,968.100	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,838,000.000	3,615,753.900	
		2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,637,253.540	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,478,186.780	
		5% Belgium Government Bond 20350328	2,104,000.000	3,686,334.240	
		4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	932,101.910	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,937,709.960	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,280,018.740	
		4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,436,966.720	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,167,979.800	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,441,253.460	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,556,557.350	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,684,982.950	

		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,074,880.710	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,300,554.950	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	690,318.720	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	689,029.980	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,213,127.960	
		0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	525,881.400	
		2% IRISH TREASURY 20450218	881,000.000	1,260,376.220	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,166,308.080	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	703,824.000	
		IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	354,525.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	881,032.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	888,157.500	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	450,000.000	526,405.500	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	1,200,000.000	1,352,676.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	798,690.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	250,000.000	266,800.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	836,296.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	500,000.000	524,290.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,209,351.000	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,673,000.000	2,878,731.100	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,137,027.500	
		3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	845,441.660	
		3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	943,652.240	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	831,304.240	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,102,105.690	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,028,297.340	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,054,296.240	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,019,244.520	

		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	813,766.680	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	489,171.390	
		1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	325,459.680	
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	470,110.760	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	651,586.650	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	578,366.280	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,984,550.440	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,234,878.250	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,435,744.520	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,474,592.640	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,083,179.290	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,927,843.840	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,827,727.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	3,030,000.000	3,329,970.000	
		0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,109,598.400	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,123,098.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	2,200,000.000	2,777,016.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,290,383.000	
		0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,632,512.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,900,000.000	2,124,485.000	

		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,910,831.000	
		0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,458,632.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,130,223.000	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,700,000.000	1,709,724.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	2,600,000.000	2,938,806.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,050,000.000	2,482,181.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,367,022.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,962,708.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,424,436.800	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,494,169.400	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	1,500,000.000	1,529,820.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,200,000.000	1,242,744.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,569,176.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,241,997.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	900,000.000	996,453.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,261,609.690	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,854,000.000	2,954,812.500	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,906,131.060	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,969,773.380	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	2,473,000.000	4,434,459.950	

		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,717,949.960	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,671,338.900	
		5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,126,844.500	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,214,204.300	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,179,040.260	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,515,293.900	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,566,070.580	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,265,204.500	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,367,869.490	
	ユーロ　小計			ユーロ 718,538,449.590 (89,371,812,360)	
国債証券　合計				215,573,016,059 [215,573,016,059]	
合計				215,573,016,059 [215,573,016,059]	

（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	249銘柄	100%	43.3%
イギリス・ポンド	国債証券	48銘柄	100%	6.7%
イスラエル・シュケル	国債証券	16銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	28銘柄	100%	2.7%
カナダ・ドル	国債証券	35銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券	18銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.6%
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	34銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	328銘柄	100%	41.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

ダイワライフスタイル５０

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	16,499,198
親投資信託受益証券	1,972,599,991
未収入金	15,457,000
流動資産合計	2,004,556,189
資産合計	2,004,556,189
負債の部	
流動負債	
未払解約金	17,824,648
未払受託者報酬	850,638
未払委託者報酬	7,656,129
その他未払費用	79,660
流動負債合計	26,411,075
負債合計	26,411,075
純資産の部	
元本等	
元本	※1 1,136,761,570
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	841,383,544
（分配準備積立金）	409,462,558
元本等合計	1,978,145,114
純資産合計	1,978,145,114
負債純資産合計	2,004,556,189

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2020年12月1日 至　2021年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	129,413,434
営業収益合計	129,413,434
営業費用	
支払利息	820
受託者報酬	850,638
委託者報酬	7,656,129
その他費用	79,666
営業費用合計	8,587,253
営業利益又は営業損失（△）	120,826,181
経常利益又は経常損失（△）	120,826,181
中間純利益又は中間純損失（△）	120,826,181
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	4,207,880
期首剰余金又は期首欠損金（△）	721,021,307
剰余金増加額又は欠損金減少額	39,997,127
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	39,997,127
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,253,191
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,253,191
中間剰余金又は中間欠損金（△）	841,383,544

(3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自　2020年12月1日 至　2021年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区　分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1．※1　期首元本額	1,137,055,569円
期中追加設定元本額	56,744,460円
期中一部解約元本額	57,038,459円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	1,136,761,570口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自　2020年12月1日 至　2021年5月31日
	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1．金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年5月31日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7402円 (17,402円)

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,198,497,140
株式　※2※3	170,475,397,590
派生商品評価勘定	25,512,800
未収入金	122,297,049

未収配当金		1,475,183,003
未収利息		642,829
その他未収収益	※4	32,499,790
流動資産合計		182,330,030,201
資産合計		182,330,030,201
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		45,132,850
前受金		30,381,300
未払解約金		142,157,590
受入担保金		6,693,143,887
流動負債合計		6,910,815,627
負債合計		6,910,815,627
純資産の部		
元本等		
元本	※1	135,257,495,084
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		40,161,719,490
元本等合計		175,419,214,574
純資産合計		175,419,214,574
負債純資産合計		182,330,030,201

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年12月1日 至　2021年5月31日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	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．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	2021年5月31日現在
1．※1　期首	2020年12月1日
期首元本額	142,709,508,970円
期中追加設定元本額	10,436,340,100円
期中一部解約元本額	17,888,353,986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	3,024,697,906円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	6,170,205,936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	927,558円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	26,358,549円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	528,395,182円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	26,962,746円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	761,667,628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）	170,450,590円

Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	30,249,161円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	74,276,684円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	3,515,637,149円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,931,246,980円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	357,093,022円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	65,437,395,775円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,831,642,597円
ダイワ・ライフ・バランス５０	3,770,140,591円
ダイワ・ライフ・バランス７０	3,564,655,345円
年金ダイワ日本株式インデックス	5,714,514,568円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	46,477,627円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	41,677,370円
ダイワつみたてインデックス日本株式	1,064,242,104円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	11,123,978円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	8,155,526円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	12,980,279円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	118,274,541円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	133,264,022円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	6,627,189,222円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	580,569,028円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	84,571,925円

	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	152,457,761円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	178,057,906円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	10,053,384,078円
	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	1,389,270,967円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	2,491,606,122円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,219,227,317円
	ダイワライフスタイル２５	159,951,812円
	ダイワライフスタイル５０	609,287,535円
	ダイワライフスタイル７５	500,360,587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）	10,838,847,410円
計		135,257,495,084円
2.	期末日における受益権の総数	135,257,495,084口
3. ※2	貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 6,386,087,680円
4. ※3	差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 923,420,000円
5. ※4	その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分31,507,625円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種　類	2021年5月31日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 株価指数 先物取引 買　建	4,975,723,700	－	4,956,245,000	△19,478,700
合計	4,975,723,700	－	4,956,245,000	△19,478,700

（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）

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	1.2969円
（1万口当たり純資産額）	(12,969円)

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	342,175,950
国債証券	80,513,188,400
地方債証券	3,812,142,600
特殊債券	2,885,269,100
社債券	2,680,207,800
未収入金	403,886,000
未収利息	195,262,066
前払費用	3,298,168
流動資産合計	90,835,430,084
資産合計	90,835,430,084
負債の部	
流動負債	
未払解約金	148,931,960
流動負債合計	148,931,960
負債合計	148,931,960
純資産の部	
元本等	
元本　※1	64,022,910,189
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	26,663,587,935
元本等合計	90,686,498,124
純資産合計	90,686,498,124
負債純資産合計	90,835,430,084

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年12月1日 至　2021年5月31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	2021年5月31日現在
1．※1　期首	2020年12月1日
期首元本額	63,632,169,674円
期中追加設定元本額	7,169,056,337円
期中一部解約元本額	6,778,315,822円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	60,062,736円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	481,590,836円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	56,121,397円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	695,670,689円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	9,125,486,523円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	10,380,978,451円

	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,740,356,884円
	ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	236,531,955円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	325,208,096円
	ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	64,291,472円
	ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	25,763,302,027円
	ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	3,971,019,297円
	ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	2,040,438,373円
	ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,029,521,748円
	ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,874,697,589円
	ダイワライフスタイル２５	473,891,773円
	ダイワライフスタイル５０	551,510,513円
	ダイワライフスタイル７５	152,229,830円
	計	64,022,910,189円
2.	期末日における受益権の総数	64,022,910,189口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年5月31日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4165円 (14,165円)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,775,377,403
コール・ローン	11,005,466,819
株式	198,641,609,061
投資証券	4,785,831,583
派生商品評価勘定	219,739,323
未収入金	295,508,842
未収配当金	276,633,566
差入委託証拠金	3,521,739,524
流動資産合計	220,521,906,121
資産合計	220,521,906,121
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,494,438
未払金	6,240,791,205
未払解約金	161,698,700
流動負債合計	6,411,984,343
負債合計	6,411,984,343
純資産の部	

元本等	
元本　※1	57,952,472,821
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	156,157,448,957
元本等合計	214,109,921,778
純資産合計	214,109,921,778
負債純資産合計	220,521,906,121

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年12月1日 至　2021年5月31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)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、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (3)投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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	2021年5月31日現在
1.　※1　期首	2020年12月1日
期首元本額	54,067,455,177円
期中追加設定元本額	7,151,665,336円
期中一部解約元本額	3,266,647,692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	382,703,567円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,677,337円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	80,631,930円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	10,231,964円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	270,219,782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）	27,605,727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）	509,743,583円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	2,481,421,067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）	492,937,597円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	11,942,651円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	17,218,409円

ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	3,069,962,748円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,041,275,263円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	126,917,510円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	35,554,825,113円
ダイワ・ライフ・バランス３０	535,332,000円
ダイワ・ライフ・バランス５０	949,044,526円
ダイワ・ライフ・バランス７０	719,607,277円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,624,914,989円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	11,297,099円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	8,287,172円
ダイワつみたてインデックス外国株式	590,994,011円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,976,858円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,044,179円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	2,557,564円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	124,687,887円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	234,177,623円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	1,781,979,203円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	90,149,674円
ダイワバランスファンド2020-07（適格機関投資家専用）	251,457,589円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	234,082,341円

ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	851,908,858円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	233,194,443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）	2,764,408,983円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,743,712,586円
ダイワライフスタイル２５	14,211,103円
ダイワライフスタイル５０	54,882,248円
ダイワライフスタイル７５	45,250,360円
計	57,952,472,821円
2. 期末日における受益権の総数	57,952,472,821口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種　類	2021年5月31日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				

株価指数 先物取引				
買　建	10,816,128,812	－	10,990,945,521	174,816,709
合計	10,816,128,812	－	10,990,945,521	174,816,709

（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	2021年5月31日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買　建	11,227,699,495	－	11,263,127,671	35,428,176
アメリカ・ドル	9,127,342,890	－	9,152,657,027	25,314,137
イギリス・ポンド	429,314,186	－	431,002,661	1,688,475
オーストラリア・ドル	238,521,931	－	238,515,600	△6,331
カナダ・ドル	289,759,784	－	291,485,013	1,725,229
スイス・フラン	282,796,192	－	284,093,871	1,297,679
ユーロ	859,964,512	－	865,373,499	5,408,987
合計	11,227,699,495	－	11,263,127,671	35,428,176

（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）

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.6946円 (36,946円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,890,167,822
コール・ローン	952,347,638
国債証券	221,706,401,044
派生商品評価勘定	1,492
未収入金	1,707,215,410
未収利息	1,239,410,500
前払費用	27,716,145
流動資産合計	227,523,260,051
資産合計	227,523,260,051
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	1,334,874
未払金	3,115,109,740
未払解約金	51,391,197
流動負債合計	3,167,835,811
負債合計	3,167,835,811
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	72,119,554,824
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	152,235,869,416
元本等合計	224,355,424,240
純資産合計	224,355,424,240
負債純資産合計	227,523,260,051

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年12月1日 至　2021年5月31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	2021年5月31日現在
1．※1　期首	2020年12月1日
期首元本額	72,688,498,430円
期中追加設定元本額	5,407,268,882円
期中一部解約元本額	5,976,212,488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	527,259,809円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	11,033,396円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	95,009,942円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	26,424,146円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	320,223,226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）	147,414,824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）	496,272,491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）	2,108,412,636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）	801,370,561円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	924,725円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	3,387,942円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	1,226,813,859円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,225,640,814円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	149,851,824円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	49,220,307,309円
ダイワ・ライフ・バランス３０	887,870,683円
ダイワ・ライフ・バランス５０	527,760,655円
ダイワ・ライフ・バランス７０	333,325,902円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	530,567,675円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	396,197,893円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	141,675,419円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	23,647,101円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	7,204,599円

	ダイワつみたてインデックス外国債券	300,455,358円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	3,501,105円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,143,692円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	1,212,559円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	172,531,874円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	138,878,570円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	4,172,319,047円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	245,616,231円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	144,584,513円
	ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	36,419,678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）	1,732,070,866円
	ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,847,324,590円
	ダイワライフスタイル２５	33,545,886円
	ダイワライフスタイル５０	63,786,169円
	ダイワライフスタイル７５	17,567,255円
計		72,119,554,824円
2.	期末日における受益権の総数	72,119,554,824口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

	(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2021年5月31日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買　建	1,077,837,149	－	1,076,503,767	△1,333,382
アメリカ・ドル	443,096,286	－	442,601,843	△494,443
イギリス・ポンド	16,804,713	－	16,804,659	△54
オーストラリア・ドル	20,163,888	－	20,045,460	△118,428
スウェーデン・クローナ	22,289,608	－	22,176,000	△113,608
デンマーク・クローネ	6,502,158	－	6,494,390	△7,768
マレーシア・リンギット	5,295,800	－	5,296,360	560
ユーロ	563,684,696	－	563,085,055	△599,641
合計	1,077,837,149	－	1,076,503,767	△1,333,382

（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）

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	3.1109円
（1万口当たり純資産額）	(31,109円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年5月31日

Ⅰ	資産総額	2,004,556,189円
Ⅱ	負債総額	26,411,075円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,978,145,114円
Ⅳ	発行済数量	1,136,761,570口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7402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

2021年5月31日

Ⅰ	資産総額	182,330,030,201円
Ⅱ	負債総額	6,910,815,627円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	175,419,214,574円
Ⅳ	発行済数量	135,257,495,084口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2969円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2021年5月31日

Ⅰ	資産総額	90,835,430,084円
Ⅱ	負債総額	148,931,960円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	90,686,498,124円
Ⅳ	発行済数量	64,022,910,189口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4165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

2021年5月31日

Ⅰ	資産総額	220,521,906,121円
Ⅱ	負債総額	6,411,984,343円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	214,109,921,778円
Ⅳ	発行済数量	57,952,472,821口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.6946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

2021年5月31日

Ⅰ	資産総額	227,523,260,051円
Ⅱ	負債総額	3,167,835,811円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	224,355,424,240円
Ⅳ	発行済数量	72,119,554,824口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1109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

2021年5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、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．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。

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。

2021年5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	45	95,256
追加型株式投資信託	747	20,710,140
株式投資信託　　合計	792	20,805,395
単位型公社債投資信託	63	187,956
追加型公社債投資信託	14	1,510,584
公社債投資信託　合計	77	1,698,540
総合計	869	22,503,935

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（2020年４月１日から2021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 （2020年３月31日）		当事業年度 （2021年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		2,741		4,860
有価証券		22,167		333
前払費用		205		237
未収委託者報酬		10,847		13,150
未収収益		63		49
関係会社短期貸付金		-		18,700
その他		62		207
流動資産計		36,088		37,539
固定資産				
有形固定資産	※1	217	※1	224
建物		7		6
器具備品		209		218
無形固定資産		2,362		1,937
ソフトウェア		2,028		1,882
ソフトウェア仮勘定		333		54
投資その他の資産		15,844		16,121
投資有価証券		9,153		10,159
関係会社株式		3,972		3,705
出資金		183		183
長期差入保証金		1,069		1,068

繰延税金資産	1,431	973
その他	33	30
固定資産計	18,424	18,283
資産合計	54,512	55,822

（単位:百万円）

	前事業年度 （2020年３月31日）		当事業年度 （2021年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		69		68
未払金		7,573		8,405
未払収益分配金		14		13
未払償還金		39		39
未払手数料		3,988		4,734
その他未払金	※2	3,530	※2	3,617
未払費用		3,830		3,777
未払法人税等		656		804
未払消費税等		590		631
賞与引当金		688		950
その他		5		88
流動負債計		13,414		14,725
固定負債				
退職給付引当金		2,574		2,452
役員退職慰労引当金		88		74
その他		5		3
固定負債計		2,667		2,530
負債合計		16,082		17,256
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		11,749		10,574

利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△363	947
評価・換算差額等合計	△363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	69,550	65,487
その他営業収益	583	419
営業収益計	70,134	65,906
営業費用		
支払手数料	31,120	27,965
広告宣伝費	745	624
調査費	8,858	8,245
調査費	1,188	1,134
委託調査費	7,670	7,110
委託計算費	1,410	1,501
営業雑経費	1,770	1,870
通信費	240	240
印刷費	524	478
協会費	56	51
諸会費	13	14
その他営業雑経費	936	1,084
営業費用計	43,906	40,207
一般管理費		
給料	5,793	5,991
役員報酬	374	351
給料・手当	4,335	4,293
賞与	395	395
賞与引当金繰入額	688	950
福利厚生費	838	893
交際費	62	32
旅費交通費	154	37

租税公課	451	472
不動産賃借料	1,299	1,302
退職給付費用	368	449
役員退職慰労引当金繰入額	37	28
固定資産減価償却費	925	661
諸経費	1,770	1,763
一般管理費計	11,702	11,631
営業利益	14,525	14,067

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	214	578
有価証券償還益	24	42
その他	991	68
営業外収益計	1,230	689
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	69
有価証券償還損	71	47
その他	54	24
営業外費用計	127	141
経常利益	15,629	14,616
特別損失		
システム刷新関連費用	537	547
関係会社整理損失	-	267
投資有価証券評価損	48	45
特別損失計	585	860
税引前当期純利益	15,043	13,756
法人税、住民税及び事業税	4,555	4,476
法人税等調整額	△78	△ 109
法人税等合計	4,477	4,366
当期純利益	10,566	9,389

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自　2020年４月１日 至　2021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	11,749	12,123	38,793

当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,564	△10,564	△10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,175	△1,175	△1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	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	△363	△363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

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

市場価格のない株式等以外のもの

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。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて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･参与及び上席参事についても、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。

（追加情報）

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44－２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2019年７月４日）第７-４項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（未適用の会計基準等）

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

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。

この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」912百万円、「その他」78百万円は、「その他」991百万円として組替えております。

（注記に関する表示方法の変更）

「会計上の見積りの開示に関する会計基準」（企業会計基準第31号　2020年3月31日。以下「見積り会計基準」という）が公表日以後終了する事業年度における年度末に係る財務諸表から適用できることになったことに伴い、当事業年度末から適用し、（重要な会計上の見積り）を開示しております。

見積り会計基準の適用については、見積り会計基準第11項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、会計基準第６項及び第７項に定める注記事項について、前事業年度における財務諸表に関する注記を省略しております。

（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 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
建物	34百万円	35百万円
器具備品	276百万円	259百万円

※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 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
未払金	3,397百万円	3,473百万円

３　保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2021年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,727百万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　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

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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
2020年６月23日定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年３月31日	2020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

2021年６月22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	9,388百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ １株当たり配当額	3,599円
④ 基準日	2021年３月31日
⑤ 効力発生日	2021年６月23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。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

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．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下３つのレベルに分類しております。

レベル１の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル２の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル３の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

前事業年度（2020年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表　　計上額	時価	差額
投資有価証券（※１）	60	60	－
資産合計	60	60	－

（※1）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券267百万円、投資有価証券8,426百万円は上記の表に含めておりません。

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、コマーシャル・ペーパー、未払金及び未払費用は、短期間（１年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

当事業年度（2021年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券（※１）	85	－	－	85
資産合計	85	－	－	85

（※１）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（１年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。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。

（注２）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中の投資有価証券には含めておりません。

（単位：百万円）

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,944	1,677
関連会社株式	2,027	2,027

（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（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、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2021年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,677百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（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、市場価格がないことから、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（2021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	85	55	30
（２）その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	△160
小計	2,561	2,721	△160
合計	9,826	8,474	1,352

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がないことから、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　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

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万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　2019年４月１日　至　2020年３月31日）	当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	△183	△ 378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

(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　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,574百万円	2,452百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,574	2,452
退職給付引当金	2,574	2,452
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,574	2,452

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
勤務費用	159百万円	155百万円
その他	27	108
確定給付制度に係る退職給付費用	187	263

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181百万円、当事業年度186百万円であります。

（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 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	788	750
賞与引当金	177	243
未払事業税	129	170
システム関連費用	198	155
投資有価証券評価損	47	128
出資金評価損	94	94
その他	399	298
繰延税金資産小計	1,835	1,841
評価性引当額	△173	△ 254
繰延税金資産合計	1,661	1,586
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	△71	△ 453
繰延税金負債合計	△230	△ 612
繰延税金資産の純額	1,431	973

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（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。

当事業年度（2021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　2019年４月１日　至　2020年３月31日）
該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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親会社

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	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(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	19,300 0	関係会社短期貸付金 ―	18,700 ―

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は１年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（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。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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）	1,727	－	－

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。

（ウ）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　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。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	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）

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 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注4）	14,917 527	未払手数料 長期差入保証金	3,321 1,054
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）	883	未払費用	179
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）	527	―	―

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。

(注５)大和プロパティ株式会社は、2020年10月1日付で大和証券株式会社を存続会社とする吸収合併により消滅しております。このため、取引金額は関連当事者であった期間の金額を記載しております。

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　2019年４月１日 至　2020年３月31日）		当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	
１株当たり純資産額	14,732.52円	１株当たり純資産額	14,784.79円
１株当たり当期純利益	4,050.66円	１株当たり当期純利益	3,599.54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　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
当期純利益（百万円）	10,556	9,389
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2020年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円 （2020年07月27日現在）	（注6）	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	
	日本生命保険相互会社	1,400,000百万円	（注9）	
	株式会社北海道銀行	93,524百万円	（注3）	
	三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円	（注8）	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
	株式会社山口銀行	10,005百万円	（注3）	

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
（注2）主として中小企業向け融資業を営んでいます。
（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
（注4）全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
（注5）協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
（注6）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
（注7）信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
（注8）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
（注9）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注10）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
（注11）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

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。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行ないます。

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。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について
・金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
・目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
①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
②請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
・使用開始日を記載することがあります。
・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
①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
②届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
・次の事項を記載することがあります。
①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
②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
③「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
・委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
・ファンドの形態等を記載することがあります。
・図案を採用することがあります。
・ファンドの管理番号等を記載することがあります。
・委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
・UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2021年５月21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	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の2020年４月１日から2021年３月31日までの第62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の2021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

2021年1月8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スタイル５０の2019年12月3日から2020年11月30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、ダイワライフスタイル５０の2020年11月30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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月1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	竹内　知明　　印

中間監査意見

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スタイル５０の2020年12月1日から2021年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワライフスタイル５０の2021年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。**
- **中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。