【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2021年8月31日提出
【計算期間】	第2計算期間 （自　2020年6月6日　至　2021年6月7日）
【ファンド名】	ダイワつみたてインデックスバランス３０
【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
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、内外の株式および債券に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※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。

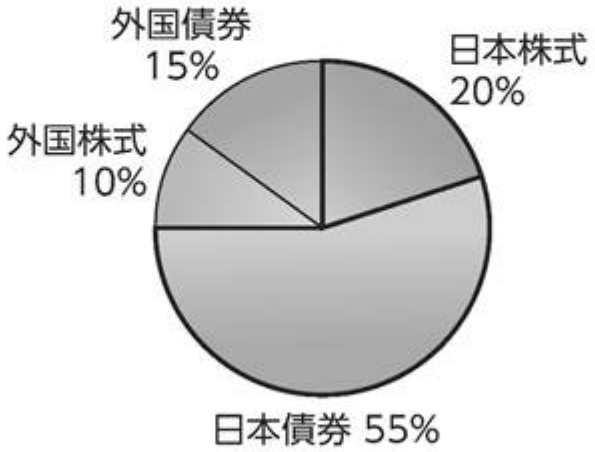
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜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	20%	10%	30%
債 券	55%	15%	70%
合 計	75%	25%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

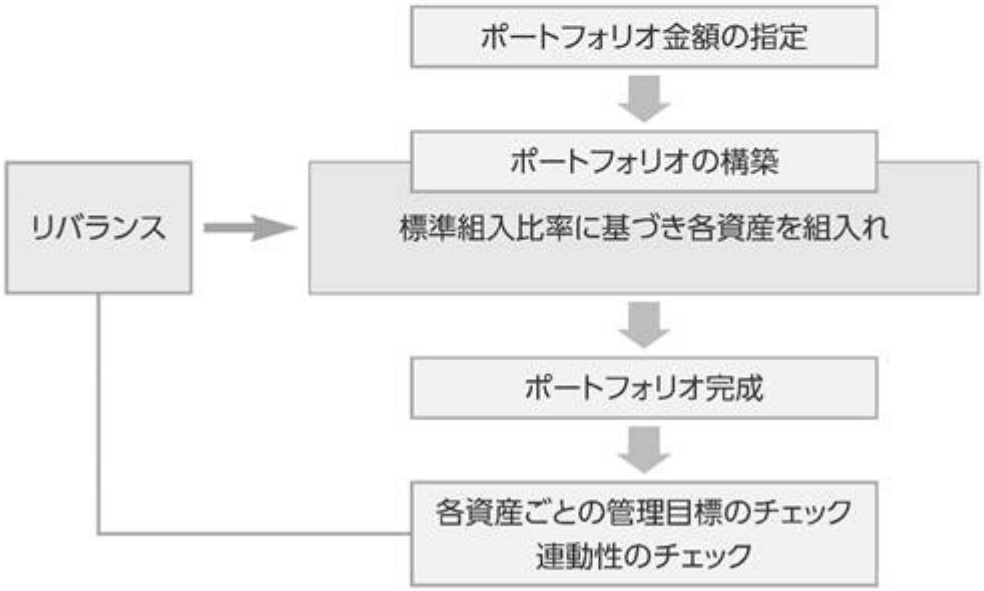
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

- 市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。
- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

（注）第1計算期間は、2020年6月5日（休業日の場合翌営業日）までとします。

〈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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

主な投資制限

●株式への実質投資割合には、制限を設けません。
●外貨建資産への実質投資割合は、信託財産総額の75％以下とします。

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

各マザーファンドの運用プロセス

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

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

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

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

3．外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

4．外国債券インデックスマザーファンド

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

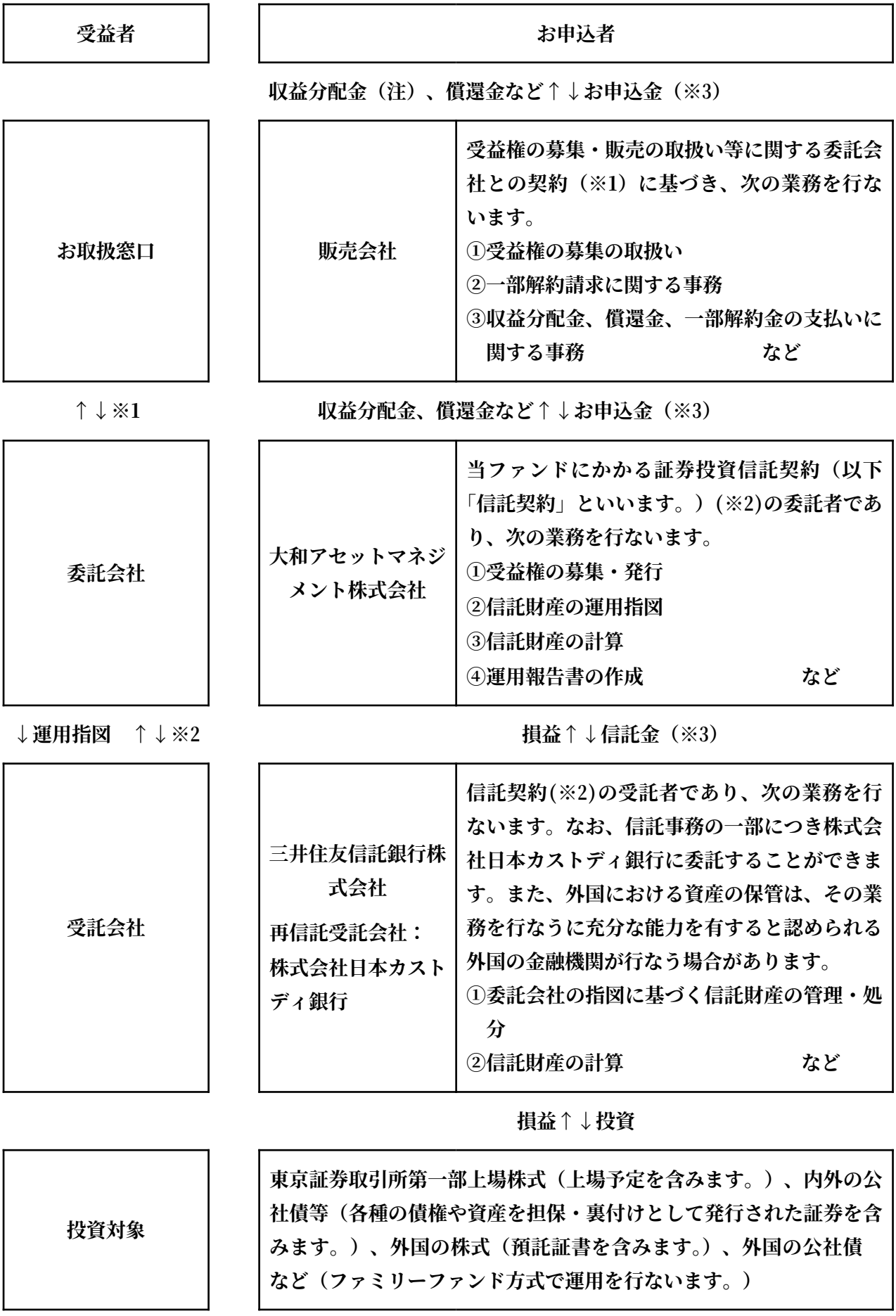
（注）リスクモデルでは、個別債券をキャッシュフロー（利金と償還金）ごとに分解し、ポートフォリオをキャッシュフローの集合体として分析するなどの手法を採用することで、イールドカーブの変化などの債券価格変動要因がポートフォリオの価値に与える影響の測定・管理やポートフォリオの効率的な複製を行なうことなどができます。

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

(2)【ファンドの沿革】

2019年6月12日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



（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6月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 （金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）
2020年 4月 1日	大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

① 主要投資対象

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

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

（東証株価指数）

2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）

3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
（ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース））

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

② 投資態度

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

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

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）受益証券：信託財産の純資産総額の55%
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15%

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

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

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

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

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

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑧、⑨および⑩に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　委託会社は、信託金を、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することができます。

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

3．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

14．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

18．投資証券、新投資口予約権証券、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．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

21．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。）

22．外国法人が発行する譲渡性預金証書

23．受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

24．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。）

25．外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前23.の有価証券に表示されるべき権利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21.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および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前16．および前21.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（新投資口予約権証券、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

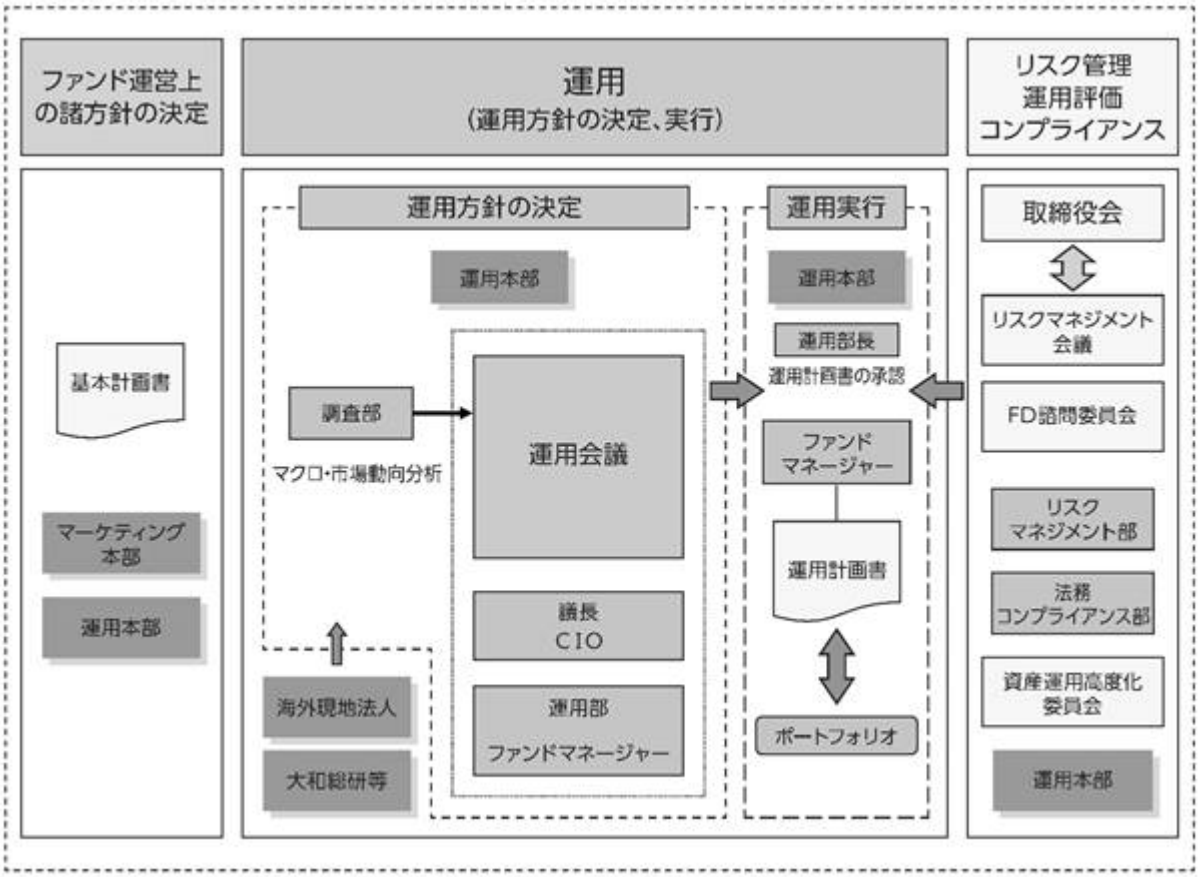
6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3)【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（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6月30日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

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

②　原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、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　マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

②　株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

③　新株引受権証券等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属すると

みなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

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

④　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。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　信用取引（信託約款）

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2．株式分割により取得する株券
3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

5．信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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みます。）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

⑧　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。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

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

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、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、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益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)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

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

ロ．委託会社は、わが国の金融商品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ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、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、わが国の金融商品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金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

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

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建で、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。

⑨　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。

⑩　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。

⑪　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。

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、公社債および投資信託証券を次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。

3．投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

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

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

⑬　外貨建資産（信託約款）

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

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

⑭　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑮　外国為替予約取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．前イ．の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．前ロ．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約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の買予約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為替の売予約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の売予約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。

ニ．前ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

⑯　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑰　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資には、制限を設けません。

(注）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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

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

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

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　外貨建資産への投資は、行ないません。

④　先物取引等

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

(注）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数とは

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

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

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

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

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

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

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

４．外国債券インデックスマザーファンド

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

(2) 投資対象
① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
1．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

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

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

なお、当ファンドにおいては、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。このため、当ファンドの基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カントリー・リスク

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

④ その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

① 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付け、ご換金の申込みを取消すことがあります。

② 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することができます。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

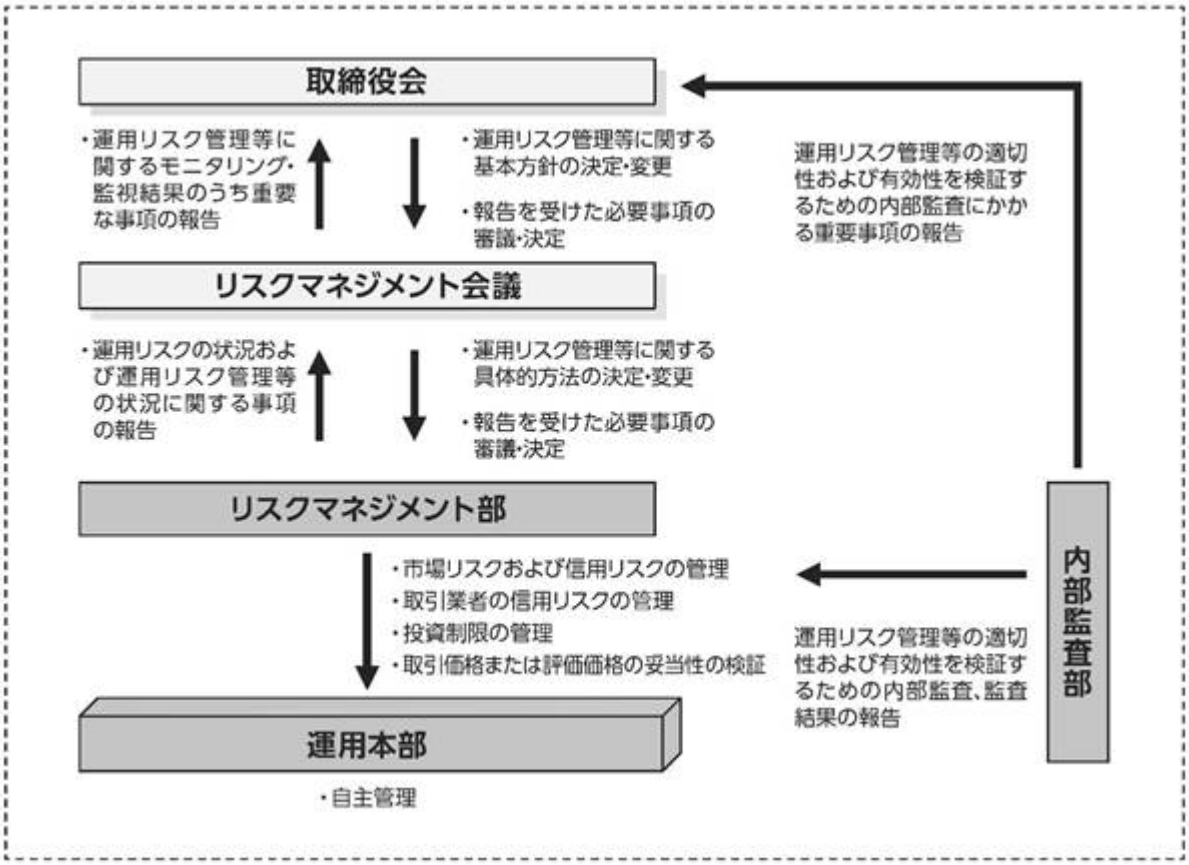
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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。



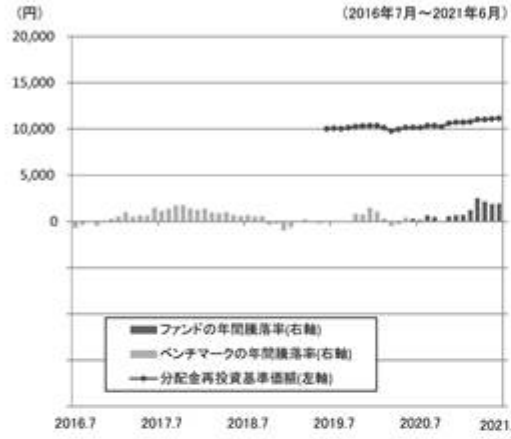
※ 流動性リスクに対する管理体制

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。

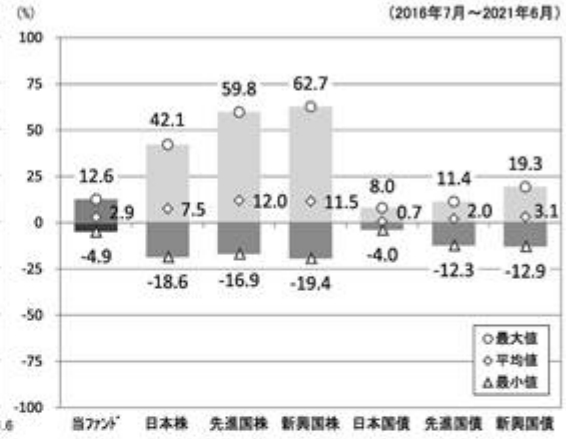
参考情報

●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0.154%（税抜0.14%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.0625% （税抜）	年率0.0625% （税抜）	年率0.015% （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および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、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。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

＜注1＞個別元本について

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

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

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6月30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6月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	67,503,347	99.70
内 日本	67,503,347	99.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	202,494	0.30
純資産総額	67,705,841	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6月30日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	28,845,873	1.2883 37,164,197	1.2899 37,208,291	54.96
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	10,231,849	1.3222 13,528,976	1.3123 13,427,255	19.83
3	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	3,251,349	3.1085 10,107,072	3.1058 10,098,039	14.91
4	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,787,868	3.7111 6,635,032	3.7865 6,769,762	10.00

(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	99.70%

合計	99.70%

(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1計算期間末(2020年6月5日)	60,266,944	60,266,944	1.0273	1.0273
2020年6月末日	60,233,067	－	1.0166	－
7月末日	57,768,790	－	1.0151	－
8月末日	59,220,327	－	1.0360	－
9月末日	56,284,321	－	1.0367	－
10月末日	60,571,951	－	1.0247	－
11月末日	61,938,440	－	1.0608	－
12月末日	64,305,969	－	1.0715	－
2021年1月末日	61,389,969	－	1.0727	－
2月末日	68,533,554	－	1.0767	－
3月末日	70,838,219	－	1.1035	－
4月末日	72,038,313	－	1.1034	－
5月末日	72,449,922	－	1.1104	－
第2計算期間末(2021年6月7日)	73,816,414	73,816,414	1.1147	1.1147
6月末日	67,705,841	－	1.1157	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

第2計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	8.5

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	66,744,581	9,080,108
第2計算期間	26,052,246	18,495,143

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

（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6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		175,803,932,620	98.01
	内 日本	175,803,932,620	98.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,560,892,631	1.99
純資産総額		179,364,825,251	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		3,516,830,000	1.96
	内 日本	3,516,830,000	1.96

(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6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	667,700	7,151.09 4,774,786,060	9,710.00 6,483,367,000	3.61
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	413,000	8,326.69 3,438,927,014	10,815.00 4,466,595,000	2.49
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	513,400	6,472.09 3,322,775,064	7,775.00 3,991,685,000	2.23
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	64,700	47,519.14 3,074,488,619	56,070.00 3,627,729,000	2.02
5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,445,200	444.89 1,977,651,862	600.10 2,667,564,520	1.49
6	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	451,200	4,332.44 1,954,798,662	5,470.00 2,468,064,000	1.38
7	任天堂	日本	株式	その他製品	37,700	60,566.92 2,283,373,228	64,620.00 2,436,174,000	1.36
8	信越化学	日本	株式	化学	119,300	14,544.38 1,735,145,144	18,580.00 2,216,594,000	1.24
9	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	756,800	2,260.25 1,710,561,990	2,894.50 2,190,557,600	1.22
10	日本電産	日本	株式	電気機器	158,600	9,863.48 1,564,349,293	12,875.00 2,041,975,000	1.14
11	武田薬品	日本	株式	医薬品	548,300	3,916.12 2,147,213,719	3,719.00 2,039,127,700	1.14
12	日立	日本	株式	電気機器	316,800	3,761.00 1,191,487,085	6,361.00 2,015,164,800	1.12
13	HOYA	日本	株式	精密機器	129,700	11,770.71 1,526,661,802	14,730.00 1,910,481,000	1.07
14	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	38,600	27,591.52 1,065,032,903	48,080.00 1,855,888,000	1.03
15	本田技研	日本	株式	輸送用機器	518,500	2,570.18 1,332,642,924	3,550.00 1,840,675,000	1.03
16	KDDI	日本	株式	情報・通信業	518,800	2,824.31 1,465,256,858	3,465.00 1,797,642,000	1.00
17	ダイキン工業	日本	株式	機械	84,000	19,625.43 1,648,536,533	20,690.00 1,737,960,000	0.97
18	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	449,300	3,099.29 1,392,513,398	3,830.00 1,720,819,000	0.96

19	村田製作所	日本	株式	電気機器	193,500	6,926.49 1,340,277,575	8,482.00 1,641,267,000	0.92
20	ファナック	日本	株式	電気機器	57,800	20,613.12 1,191,438,419	26,795.00 1,548,751,000	0.86
21	伊藤忠	日本	株式	卸売業	454,100	2,783.54 1,264,008,619	3,200.00 1,453,120,000	0.81
22	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	882,700	1,391.94 1,228,673,252	1,587.50 1,401,286,250	0.78
23	セブン&アイ･HLDGS	日本	株式	小売業	253,900	3,419.87 868,305,336	5,297.00 1,344,908,300	0.75
24	三井物産	日本	株式	卸売業	517,800	1,893.34 980,371,873	2,500.50 1,294,758,900	0.72
25	SMC	日本	株式	機械	19,300	58,379.25 1,126,719,590	65,650.00 1,267,045,000	0.71
26	第一三共	日本	株式	医薬品	518,000	3,235.54 1,676,011,106	2,394.50 1,240,351,000	0.69
27	富士通	日本	株式	電気機器	59,300	14,490.83 859,306,389	20,800.00 1,233,440,000	0.69
28	三菱商事	日本	株式	卸売業	395,100	2,633.60 1,040,539,165	3,028.00 1,196,362,800	0.67
29	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	571,300	1,631.03 931,808,980	1,934.50 1,105,179,850	0.62
30	デンソー	日本	株式	輸送用機器	145,100	4,693.18 680,981,085	7,579.00 1,099,712,900	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	98.01%
合計	98.01%

(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
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.18%
建設業	2.25%
食料品	3.32%
繊維製品	0.49%

パルプ・紙	0.23%
化学	7.24%
医薬品	5.18%
石油・石炭製品	0.41%
ゴム製品	0.68%
ガラス・土石製品	0.75%
鉄鋼	0.77%
非鉄金属	0.70%
金属製品	0.61%
機械	5.27%
電気機器	17.81%
輸送用機器	7.74%
精密機器	2.68%
その他製品	2.39%
電気・ガス業	1.18%
陸運業	3.31%
海運業	0.34%
空運業	0.45%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	8.61%
卸売業	4.66%
小売業	4.56%
銀行業	4.84%
証券、商品先物取引業	0.75%
保険業	1.78%
その他金融業	1.07%
不動産業	1.97%
サービス業	5.55%
合計	98.01%

(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　０３０９月	買建	181	3,542,504,450	3,516,830,000	1.96%

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

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資状況（2021年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		28,144,474,100	88.67
	内 日本	28,144,474,100	88.67
地方債証券		1,656,908,100	5.22
	内 日本	1,656,908,100	5.22
特殊債券		730,383,500	2.30
	内 日本	730,383,500	2.30
社債券		927,494,100	2.92
	内 日本	927,494,100	2.92
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		280,713,076	0.88
純資産総額		31,739,972,876	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6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	137　5年国債	日本	国債証券	540,000,000	100.65 543,524,700	100.49 542,646,000	0.100000 2023/09/20	1.71
2	138　5年国債	日本	国債証券	510,000,000	100.73 513,723,700	100.57 512,907,000	0.100000 2023/12/20	1.62

3	141 5年国債	日本	国債証券	430,000,000	100.85 433,687,800	100.74 433,199,200	0.100000 2024/09/20	1.36
4	139 5年国債	日本	国債証券	430,000,000	100.77 433,325,300	100.62 432,696,100	0.100000 2024/03/20	1.36
5	135 5年国債	日本	国債証券	420,000,000	100.54 422,282,300	100.37 421,587,600	0.100000 2023/03/20	1.33
6	347 10年国債	日本	国債証券	400,000,000	101.26 405,043,250	101.14 404,560,000	0.100000 2027/06/20	1.27
7	143 5年国債	日本	国債証券	380,000,000	100.96 383,648,000	100.85 383,264,200	0.100000 2025/03/20	1.21
8	136 5年国債	日本	国債証券	380,000,000	100.57 382,191,300	100.43 381,649,200	0.100000 2023/06/20	1.20
9	352 10年国債	日本	国債証券	360,000,000	101.17 364,234,800	101.19 364,309,200	0.100000 2028/09/20	1.15
10	360 10年国債	日本	国債証券	350,000,000	100.66 352,316,800	100.69 352,415,000	0.100000 2030/09/20	1.11
11	419 2年国債	日本	国債証券	350,000,000	100.41 351,454,200	100.31 351,116,500	0.100000 2022/12/01	1.11
12	359 10年国債	日本	国債証券	340,000,000	100.80 342,747,430	100.76 342,587,400	0.100000 2030/06/20	1.08
13	361 10年国債	日本	国債証券	330,000,000	99.98 329,948,940	100.56 331,867,800	0.100000 2030/12/20	1.05
14	334 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	102.60 328,332,800	102.17 326,963,200	0.600000 2024/06/20	1.03
15	345 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	101.21 323,872,800	101.07 323,430,400	0.100000 2026/12/20	1.02
16	145 5年国債	日本	国債証券	320,000,000	101.02 323,290,810	100.95 323,052,800	0.100000 2025/09/20	1.02
17	348 10年国債	日本	国債証券	310,000,000	101.25 313,905,900	101.15 313,586,700	0.100000 2027/09/20	0.99
18	351 10年国債	日本	国債証券	300,000,000	101.27 303,820,100	101.19 303,570,000	0.100000 2028/06/20	0.96
19	140 5年国債	日本	国債証券	300,000,000	100.80 302,408,800	100.68 302,055,000	0.100000 2024/06/20	0.95
20	353 10年国債	日本	国債証券	290,000,000	101.25 293,643,400	101.16 293,369,800	0.100000 2028/12/20	0.92
21	147 5年国債	日本	国債証券	286,000,000	100.49 287,421,480	100.52 287,490,060	0.005000 2026/03/20	0.91
22	354 10年国債	日本	国債証券	280,000,000	101.12 283,142,000	101.12 283,141,600	0.100000 2029/03/20	0.89

23	358 10年国債	日本	国債証券	275,000,000	100.88 277,443,600	100.87 277,395,250	0.100000 2030/03/20	0.87
24	343 10年国債	日本	国債証券	270,000,000	101.06 272,888,660	101.02 272,764,800	0.100000 2026/06/20	0.86
25	362 10年国債	日本	国債証券	265,000,000	100.20 265,551,780	100.43 266,150,100	0.100000 2031/03/20	0.84
26	337 10年国債	日本	国債証券	260,000,000	101.74 264,544,800	101.49 263,897,400	0.300000 2024/12/20	0.83
27	144 5年国債	日本	国債証券	260,000,000	100.97 262,546,000	100.91 262,384,200	0.100000 2025/06/20	0.83
28	350 10年国債	日本	国債証券	250,000,000	101.37 253,431,900	101.18 252,952,500	0.100000 2028/03/20	0.80
29	349 10年国債	日本	国債証券	250,000,000	101.38 253,460,000	101.17 252,925,000	0.100000 2027/12/20	0.80
30	13 40年国債	日本	国債証券	252,000,000	93.46 235,537,990	91.67 231,015,960	0.500000 2060/03/20	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	88.67%
地方債証券	5.22%
特殊債券	2.30%
社債券	2.92%
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6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		203,276,476,495	91.04
	内 香港	2,159,825,752	0.97
	内 シンガポール	649,742,674	0.29
	内 イスラエル	420,383,758	0.19
	内 ノルウェー	445,034,073	0.20
	内 スウェーデン	2,603,472,024	1.17
	内 デンマーク	1,807,510,814	0.81
	内 イギリス	9,342,265,821	4.18
	内 アイルランド	462,187,908	0.21
	内 オランダ	2,816,990,942	1.26
	内 ベルギー	618,173,696	0.28
	内 フランス	7,399,605,027	3.31
	内 ドイツ	6,148,977,555	2.75
	内 スイス	6,367,033,573	2.85
	内 ポルトガル	121,922,897	0.05
	内 スペイン	1,594,768,425	0.71
	内 イタリア	1,614,505,626	0.72
	内 フィンランド	685,895,067	0.31
	内 オーストリア	127,293,650	0.06
	内 カナダ	7,345,687,460	3.29
	内 アメリカ	146,279,042,542	65.51
	内 オーストラリア	4,099,768,771	1.84
	内 ニュージーランド	166,388,440	0.07
投資証券		4,945,814,194	2.21
	内 香港	96,252,503	0.04
	内 シンガポール	91,284,439	0.04
	内 イギリス	115,346,436	0.05
	内 フランス	108,350,669	0.05
	内 カナダ	24,297,476	0.01
	内 アメリカ	4,036,121,867	1.81
	内 オーストラリア	453,487,742	0.20
	内 その他	20,673,062	0.01

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,066,509,353	6.75
純資産総額	223,288,800,042	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）		15,032,625,693	6.73
	内 イギリス	709,620,912	0.32
	内 ドイツ	2,480,492,587	1.11
	内 カナダ	622,552,280	0.28
	内 アメリカ	10,724,855,634	4.80
	内 オーストラリア	495,104,280	0.22
為替予約取引（買建）		10,112,582,504	4.53
	内 日本	10,112,582,504	4.53

(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6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	584,700	12,940.84 7,566,517,113	15,075.37 8,814,569,658	3.95
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	249,500	23,998.84 5,987,734,827	30,011.41 7,487,847,294	3.35
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	14,900	353,416.77 5,265,910,862	381,295.32 5,681,300,286	2.54
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	30,905.00 2,583,661,007	38,911.99 3,253,042,882	1.46

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	200,588.02 2,053,420,278	278,702.51 2,853,077,642	1.28
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	200,595.76 2,096,226,379	270,417.86 2,825,866,647	1.27
7	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	26,670	65,496.75 1,746,799,550	75,278.44 2,007,676,016	0.90
8	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	21,470	59,019.97 1,267,158,922	88,582.32 1,901,862,423	0.85
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	105,870	13,631.30 1,443,153,859	17,044.80 1,804,533,103	0.81
10	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	91,200	16,045.60 1,463,362,310	18,138.43 1,654,225,491	0.74
11	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	58,900	23,402.70 1,378,420,946	26,091.35 1,536,780,574	0.69
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	47,550	25,819.43 1,227,715,722	30,543.30 1,452,334,001	0.65
13	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	32,916	37,607.04 1,237,874,490	44,021.89 1,449,024,795	0.65
14	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	98,900	12,291.43 1,215,628,737	13,961.81 1,380,823,504	0.62
15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	37,400	30,681.74 1,147,498,059	35,190.97 1,316,142,622	0.59
16	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	85,467	15,288.90 1,306,702,946	14,861.95 1,270,206,452	0.57
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	30,750	37,645.85 1,157,612,370	40,693.44 1,251,323,280	0.56
18	PAYPAL HOLDINGS INC	アメリカ	株式	情報技術	38,600	23,676.06 913,897,975	32,373.40 1,249,613,271	0.56
19	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	269,301	3,265.86 879,525,674	4,521.61 1,217,675,764	0.55

20	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	16,512.35 1,038,006,284	19,233.17 1,209,036,123	0.54
21	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	14,410	48,945.25 705,302,858	77,619.04 1,118,490,395	0.50
22	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	16,620	52,835.23 878,122,868	65,325.13 1,085,703,744	0.49
23	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	146,705	4,546.49 666,998,982	6,924.51 1,015,861,648	0.45
24	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	24,130	36,335.29 876,771,819	41,873.44 1,010,406,107	0.45
25	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	5,744.52 911,603,882	6,252.19 992,160,539	0.44
26	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	15,370	54,594.23 839,114,369	58,994.43 906,744,389	0.41
27	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	143,504	6,673.61 957,702,674	6,174.78 886,106,662	0.40
28	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	141,200	5,272.34 744,456,186	6,275.41 886,088,598	0.40
29	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	31,821	27,173.48 864,688,574	27,181.66 864,947,915	0.39
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	146,250	4,768.09 697,337,053	5,850.78 855,677,716	0.38

(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	91.04%
投資証券	2.21%
合計	93.25%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.08%
素材	4.05%
資本財・サービス	9.06%
一般消費財・サービス	10.73%
生活必需品	6.53%
ヘルスケア	11.87%
金融	12.90%
情報技術	21.21%
コミュニケーション・サービス	8.52%
公益事業	2.68%
不動産	0.40%
合計	91.04%

(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 202109	買建	453	10,634,997,884	10,724,855,634	4.80%
	イギリス	FTSE 100 IDX FUT 202109	買建	66	715,903,765	709,620,912	0.32%
	オーストラリア	SPI 200 FUTURES 202109	買建	33	500,026,937	495,104,280	0.22%
	カナダ	S&P/TSX 60 IX FUT 202109	買建	29	619,521,225	622,552,280	0.28%
	ドイツ	SWISS MKT IX FUTR 202109	買建	40	571,717,717	577,296,440	0.26%
		EURO STOXX 50 202109	買建	353	1,918,661,468	1,903,196,147	0.85%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2021年7月	買建	2,710,000	420,634,527	415,050,863	0.19%
		ユーロ買/円売 2021年7月	買建	9,560,000	1,276,158,517	1,257,971,720	0.56%
		カナダ・ドル買/円売 2021年7月	買建	4,810,000	435,470,933	428,788,893	0.19%

		米ドル買/円売 2021年7月	買建	65,850,000	7,218,374,430	7,281,080,595	3.26%
		豪ドル買/円売 2021年7月	買建	3,940,000	333,143,009	327,483,738	0.15%
		スイス・フラン買/円売 2021年7月	買建	3,350,000	407,575,962	402,206,695	0.18%

(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6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		222,069,178,382	98.57
	内 ユーロ	89,831,895,071	39.87
	内 シンガポール	921,393,480	0.41
	内 マレーシア	1,065,792,983	0.47
	内 イスラエル	995,776,006	0.44
	内 ノルウェー	544,206,797	0.24
	内 スウェーデン	771,841,418	0.34
	内 デンマーク	1,075,132,128	0.48
	内 イギリス	14,587,197,660	6.47
	内 ポーランド	1,361,559,298	0.60
	内 カナダ	4,550,575,711	2.02
	内 アメリカ	99,861,250,880	44.32
	内 メキシコ	1,780,789,756	0.79
	内 オーストラリア	4,721,767,194	2.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,229,578,049	1.43
純資産総額		225,298,756,431	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)		1,758,827,694	0.78
	内 日本	1,758,827,694	0.78
為替予約取引(売建)		6,199,803	△0.00
	内 日本	6,199,803	△0.00

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

(注2) 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6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	95.68 1,132,119,906	96.85 1,146,041,499	1.125000 2031/02/15	0.51
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	99.33 1,076,495,188	94.87 1,028,145,195	0.875000 2030/11/15	0.46
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,000,000	98.10 1,084,800,858	92.94 1,027,785,810	0.625000 2030/08/15	0.46
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	105.20 899,147,528	103.62 885,654,709	1.625000 2026/05/15	0.39
5	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,864,000	189.46 963,267,411	172.40 876,570,665	4.500000 2041/04/25	0.39
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	116.60 863,880,484	111.09 823,072,483	2.875000 2028/08/15	0.37
7	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	128.09 857,400,628	122.37 819,087,180	2.500000 2030/05/25	0.36
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,500,000	99.60 826,107,241	98.24 814,803,201	0.250000 2025/06/30	0.36
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,800,000	98.33 848,162,975	93.29 804,665,890	0.625000 2030/05/15	0.36
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	115.31 841,579,263	109.48 799,044,887	2.625000 2029/02/15	0.35
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	116.28 835,850,445	110.98 797,690,946	2.875000 2028/05/15	0.35
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.27 768,453,168	100.26 776,142,221	1.250000 2028/03/31	0.34

13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,350,000	114.92 807,009,534	110.05 772,780,478	2.750000 2028/02/15	0.34
14	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	5,730,000	101.88 768,180,500	101.23 763,287,343	－ 2023/04/14	0.34
15	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	3,571,000	173.86 816,952,663	162.14 761,850,752	4.000000 2037/01/04	0.34
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,400,000	111.71 790,585,075	107.54 761,087,639	2.375000 2027/05/15	0.34
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	7,000,000	96.94 750,376,009	97.27 752,982,346	0.750000 2028/01/31	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,668,000	102.86 758,457,697	102.01 752,175,497	1.625000 2022/11/15	0.33
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	4,920,000	119.56 774,032,244	113.82 736,873,000	1.500000 2031/05/25	0.33
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	5,086,000	110.45 739,182,400	108.34 725,055,253	2.250000 2024/05/25	0.32
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,162,000	107.84 734,835,688	105.91 721,664,343	2.375000 2024/08/15	0.32
22	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	5,101,000	108.38 727,488,961	106.46 714,608,833	1.000000 2025/11/25	0.32
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,287,000	103.67 720,793,473	102.58 713,166,948	2.000000 2022/11/30	0.32
24	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	3,448,000	163.79 743,117,997	156.36 709,418,064	5.500000 2031/01/04	0.31
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	4,499,000	123.39 730,454,012	119.36 706,615,041	2.750000 2027/10/25	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	6,500,000	99.51 715,283,965	97.91 703,747,707	0.250000 2025/09/30	0.31
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	5,900,000	111.12 725,003,947	106.84 697,093,334	2.250000 2027/08/15	0.31
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	4,899,000	109.92 708,607,342	107.93 695,753,810	1.750000 2024/11/25	0.31
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国 債 証券	4,950,000	110.17 717,592,911	106.68 694,874,835	0.750000 2028/11/25	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国 債 証券	5,921,000	107.71 705,277,335	105.73 692,287,211	2.250000 2024/11/15	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	98.57%
合計	98.57%

(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	6,389,700	0.00%
		米ドル買/円売 2021年7月	買建	4,430,000	489,597,558	489,863,183	0.22%
		カナダ・ドル買/円売 2021年7月	買建	235,000	21,055,295	20,949,944	0.01%
		ユーロ買/円売 2021年7月	買建	6,338,000	840,683,774	833,966,716	0.37%
		英ポンド買/円売 2021年7月	買建	526,000	80,729,317	80,561,475	0.04%
		豪ドル買/円売 2021年7月	買建	524,000	44,139,179	43,554,513	0.02%
		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	21,789,600	0.01%
		米ドル買/円売 2021年8月	買建	2,368,000	261,798,857	261,752,563	0.12%
		マレーシア・リンギット売/円買 2021年7月	売建	233,000	6,193,140	6,199,803	△0.00%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワつみたてインデックスバランス30

2021年6月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,157円
純資産総額	67百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.5%
3カ月間	1.1%
6カ月間	4.1%
1年間	9.7%
3年間	－
5年間	－
設定来	11.6%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第１期 20年6月	第２期 21年6月										
分配金	0円	0円										

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内債券	282	54.5%
国内株式・先物	2,133	19.8%
外国債券	834	14.7%
外国株式・先物	1,233	9.8%
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		2.1%
合計	4,546	－

通貨別構成	比率
日本円	75.1%
米ドル	13.9%
ユーロ	7.1%
英ポンド	1.4%
カナダ・ドル	0.7%
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	0.2%
その他	0.6%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	0.9
最終利回り(%)	0.2
修正デュレーション	9.1
残存年数	10.0

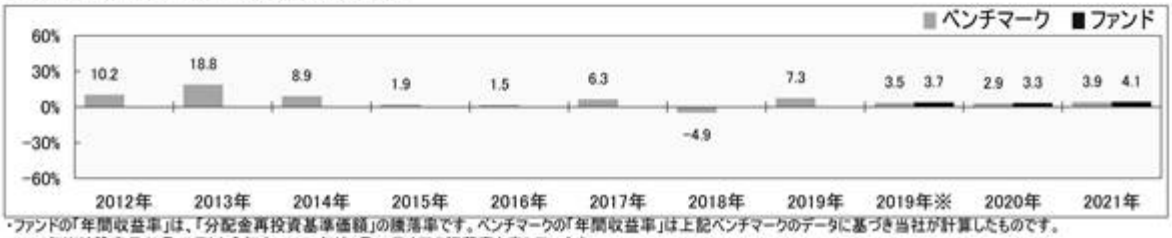
債券格付別構成	比率
AAA	89.3%
AA	4.4%
A	3.7%
BBB	－
BB以下・無格付	2.6%
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
トヨタ自動車	日本	0.7%
ソニーグループ	日本	0.5%
S&P500 EMINI FUT 202109	アメリカ	0.5%
ソフトバンクグループ	日本	0.4%
キーエンス	日本	0.4%
APPLE INC	アメリカ	0.4%
TOPIX先物　0309月	日本	0.4%
MICROSOFT CORP	アメリカ	0.3%
三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.3%
リクルートホールディングス	日本	0.3%
合計		4.2%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.6%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。
・2019年※は設定日（6月12日）から年末、2021年は6月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

継続申込期間においては、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。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

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、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

２【換金（解約）手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、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、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約請求の受付けを中止することができるほか、すでに受付けた一部解約請求を取消すことができるものとします。一部解約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請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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請求を受付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または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6月6日から翌年6月5日までとします。ただし、第1計算期間は2019年6月12日から2020年6月5日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

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

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

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

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

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2期計算期間（2020年6月6日から2021年6月7日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワつみたてインデックスバランス３０

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2020年6月5日現在	第2期 2021年6月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	208,038	271,469
親投資信託受益証券	60,089,839	73,599,687
流動資産合計	60,297,877	73,871,156
資産合計	60,297,877	73,871,156
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	3,120	5,533
未払委託者報酬	26,318	46,479
その他未払費用	1,495	2,730
流動負債合計	30,933	54,742
負債合計	30,933	54,742
純資産の部		
元本等		
元本	※1 58,664,473	※1 66,221,576
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,602,471	7,594,838
（分配準備積立金）	582,893	5,163,469
元本等合計	60,266,944	73,816,414
純資産合計	60,266,944	73,816,414
負債純資産合計	60,297,877	73,871,156

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2019年6月12日 至　2020年6月5日	第2期 自　2020年6月6日 至　2021年6月7日
営業収益		
有価証券売買等損益	360,539	5,343,548
営業収益合計	360,539	5,343,548
営業費用		
支払利息	2	1
受託者報酬	3,150	10,437
委託者報酬	27,210	87,678
その他費用	1,677	5,074
営業費用合計	32,039	103,190
営業利益	328,500	5,240,358
経常利益	328,500	5,240,358
当期純利益	328,500	5,240,358
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 254,391	503,501
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－	1,602,471
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,262,518	1,832,206
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,262,518	1,832,206
剰余金減少額又は欠損金増加額	242,938	576,696
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	242,938	576,696
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,602,471	7,594,838

(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2期 自　2020年6月6日 至　2021年6月7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 2021年6月5日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2021年6月7日としております。このため、当計算期間は367日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第1期 2020年6月5日現在	第2期 2021年6月7日現在
1．※1　期首元本額	1,000,000円	58,664,473円
期中追加設定元本額	66,744,581円	26,052,246円
期中一部解約元本額	9,080,108円	18,495,143円
2．計算期間末日における受益権の総数	58,664,473口	66,221,576口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第1期 自　2019年6月12日 至　2020年6月5日	第2期 自　2020年6月6日 至　2021年6月7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（582,893円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,019,580円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は1,602,473円（1万口当たり273.16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（4,736,856円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,431,370円）及び分配準備積立金（426,613円）より分配対象額は7,594,839円（1万口当たり1,146.88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2期 自　2020年6月6日 至　2021年6月7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2期 2021年6月7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1期 2020年6月5日現在	第2期 2021年6月7日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	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	549,510	4,642,285
合計	549,510	4,642,285

（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1期 2020年6月5日現在	第2期 2021年6月7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2期 自　2020年6月6日 至　2021年6月7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1期 2020年6月5日現在	第2期 2021年6月7日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0273円 (10,273円)	1.1147円 (11,147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	11,345,121	15,002,788	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,997,402	7,411,959	
	外国債券インデックスマザーファンド	3,543,248	11,014,895	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	31,180,661	40,170,045	
親投資信託受益証券　合計			73,599,687	
合計			73,599,687	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在

		金　額（円）	金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		24,328,710,118	10,072,495,627
株式	※2※3	149,144,512,780	174,866,104,090
派生商品評価勘定		278,504,000	67,344,050
未収入金		15,790,100	3,340,339
未収配当金		1,337,070,499	1,263,935,353
未収利息		2,344,037	777,911
その他未収収益	※4	41,074,510	21,689,416
差入委託証拠金		50,430,000	－
流動資産合計		175,198,436,044	186,295,686,786
資産合計		175,198,436,044	186,295,686,786
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		－	6,109,200
前受金		281,953,600	46,511,300
未払金		－	1,028,592,562
未払解約金		360,378,460	119,973,790
受入担保金		22,490,327,285	6,186,378,660
その他未払費用		94,194	－
流動負債合計		23,132,753,539	7,387,565,512
負債合計		23,132,753,539	7,387,565,512
純資産の部			
元本等			
元本	※1	142,967,103,545	135,290,116,425
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		9,098,578,960	43,618,004,849
元本等合計		152,065,682,505	178,908,121,274
純資産合計		152,065,682,505	178,908,121,274
負債純資産合計		175,198,436,044	186,295,686,786

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6月6日 至　2021年6月7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	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
1．※1　期首	2019年6月12日	2020年6月6日
期首元本額	137,444,906,555円	142,967,103,545円
期中追加設定元本額	39,885,826,371円	22,103,199,354円
期中一部解約元本額	34,363,629,381円	29,780,186,474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	3,459,619,359円	3,020,415,388円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	7,067,562,385円	6,160,322,539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	2,679,347円	927,435円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	55,902,878円	25,923,401円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	780,865,658円	521,906,795円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	40,741,510円	26,728,376円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,092,230,752円	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）	93,179,177円	170,445,291円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	55,564,362円	31,727,729円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	14,731,618円	－円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	23,839,256円	78,025,372円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	1,785,224,710円	3,563,503,924円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,416,435,560円	2,947,213,251円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	92,819,882円	362,201,377円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	65,943,708,454円	65,387,758,940円
ダイワ・ライフ・バランス３０	3,207,496,333円	2,833,165,324円
ダイワ・ライフ・バランス５０	3,747,158,396円	3,784,745,264円
ダイワ・ライフ・バランス７０	3,285,045,086円	3,586,455,783円
年金ダイワ日本株式インデックス	5,135,540,799円	5,709,475,498円

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	14,196,344円	－円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	54,321,811円	47,633,461円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	32,719,659円	42,973,738円
ダイワつみたてインデックス日本株式	606,007,503円	1,072,133,635円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	11,880,333円	11,345,121円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	7,017,784円	8,324,391円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	10,576,222円	13,219,729円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	154,206,269円	117,698,161円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	158,516,417円	132,702,147円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	8,947,553,507円	6,606,433,275円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	829,736,353円	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）	121,831,903円	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）	223,747,786円	151,803,123円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	175,248,838円	166,023,105円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	11,103,093,364円	10,046,182,581円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	5,164,042,624円	1,415,940,844円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	2,053,074,608円	2,505,181,766円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,343,456,889円	1,218,516,655円
ダイワライフスタイル２５	202,546,742円	159,348,831円
ダイワライフスタイル５０	714,641,249円	609,687,340円

	ダイワライフスタイル７５	552,989,820円	500,939,808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）	12,185,351,998円	10,826,278,446円
	計	142,967,103,545円	135,290,116,425円
2.	期末日における受益権の総数	142,967,103,545口	135,290,116,425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　21,577,014,350円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　5,904,615,900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　520,800,000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　967,420,000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38,235,875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20,492,575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　2020年6月6日 至　2021年6月7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	2021年6月7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	2020年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年6月7日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	636,961,961	26,841,374,069
新株予約権証券	0	―
合計	636,961,961	26,841,374,069

（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2020年6月5日まで、及び2020年9月24日から2021年6月7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	2020年6月5日 現在				2021年6月7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	2,499,201,400	－	2,777,800,000	278,598,600	4,623,033,700	－	4,684,400,000	61,366,300
合計	2,499,201,400	－	2,777,800,000	278,598,600	4,623,033,700	－	4,684,400,000	61,366,300

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
1口当たり純資産額	1.0636円	1.3224円
（1万口当たり純資産額）	(10,636円)	(13,224円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)　株式

銘　柄	株　式　数	評価額（円）		備考
		単　価	金　額	
極　洋	3,100	2,942.00	9,120,200	
日本水産	83,200	548.00	45,593,600	
マルハニチロ	14,000	2,448.00	34,272,000	
ホウスイ	500	953.00	476,500	
カネコ種苗	2,700	1,500.00	4,050,000	
サカタのタネ	10,500	3,775.00	39,637,500	

ホクト	7,900	1,954.00	15,436,600	貸付株式数	2,200株 (100株)
ホクリヨウ	2,300	741.00	1,704,300		
ヒノキヤグループ	2,300	2,538.00	5,837,400		
ショーボンドＨＤ	12,700	4,640.00	58,928,000	貸付株式数	300株
ミライト・ホールディングス	30,600	1,959.00	59,945,400		
タマホーム	5,700	2,154.00	12,277,800	貸付株式数	2,100株
サンヨーホームズ	1,500	719.00	1,078,500	貸付株式数	300株
日本アクア	4,100	578.00	2,369,800	貸付株式数	1,400株
ファーストコーポレーション	3,000	774.00	2,322,000	貸付株式数	1,100株
ベステラ	1,800	1,709.00	3,076,200	貸付株式数	600株
キャンディル	1,700	548.00	931,600		
スペースバリューＨＤ	11,500	736.00	8,464,000		
住石ホールディングス	21,600	131.00	2,829,600	貸付株式数	2,700株
日鉄鉱業	2,100	6,260.00	13,146,000		
三井松島ＨＬＤＧＳ	3,600	952.00	3,427,200		
ＩＮＰＥＸ	323,800	809.00	261,954,200		
石油資源開発	11,800	2,021.00	23,847,800		
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,200	1,335.00	5,607,000		
ダイセキ環境ソリューション	1,600	970.00	1,552,000		
第一カッター興業	2,300	1,394.00	3,206,200		
明豊ファシリティワークス	3,100	835.00	2,588,500	貸付株式数	1,100株
安藤・間	56,800	845.00	47,996,000		
東急建設	27,000	761.00	20,547,000		
コムシスホールディングス	31,400	3,170.00	99,538,000		
ビーアールホールディングス	12,200	504.00	6,148,800	貸付株式数	1,300株
高松コンストラクショングループ	5,400	2,073.00	11,194,200	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,800	9,800.00	27,440,000	貸付株式数	500株
ソネック	1,000	937.00	937,000	貸付株式数	300株
ヤマウラ	4,100	913.00	3,743,300		
オリエンタル白石	31,600	285.00	9,006,000		
大成建設	63,300	3,855.00	244,021,500		
大　林　組	202,800	933.00	189,212,400		
清水建設	190,300	953.00	181,355,900		
飛島建設	5,700	1,066.00	6,076,200		

長谷工コーポレーションヨン	66,600	1,560.00	103,896,000		
松井建設	7,800	729.00	5,686,200	貸付株式数	2,900株
錢　高　組	900	4,370.00	3,933,000		
鹿島建設	149,200	1,523.00	227,231,600		
不動テトラ	5,100	1,894.00	9,659,400		
大末建設	2,500	1,014.00	2,535,000	貸付株式数	500株
鉄建建設	3,900	1,890.00	7,371,000		
西松建設	15,000	3,390.00	50,850,000	貸付株式数	100株
三井住友建設	50,700	481.00	24,386,700		
大豊建設	5,000	4,100.00	20,500,000		
前田建設	50,800	999.00	50,749,200		
佐田建設	5,100	488.00	2,488,800	貸付株式数	1,700株
ナカノフドー建設	4,900	398.00	1,950,200	貸付株式数	1,700株
奥　村　組	11,200	2,976.00	33,331,200		
東鉄工業	8,400	2,388.00	20,059,200		
イチケン	1,500	1,844.00	2,766,000		
富士ピー・エス	2,400	565.00	1,356,000	貸付株式数	700株
淺沼組	2,500	4,545.00	11,362,500		
戸田建設	84,100	775.00	65,177,500		
熊　谷　組	9,700	2,874.00	27,877,800		
北野建設	1,200	2,378.00	2,853,600	貸付株式数	100株
植　木　組	1,800	1,503.00	2,705,400	貸付株式数	600株
矢作建設	9,200	711.00	6,541,200		
ピーエス三菱	6,400	653.00	4,179,200		
日本ハウスＨＬＤＧＳ	13,800	340.00	4,692,000		
大東建託	22,200	11,760.00	261,072,000		
新日本建設	8,400	878.00	7,375,200		
ＮＩＰＰＯ	16,800	2,957.00	49,677,600		
東亜道路	1,300	4,590.00	5,967,000		
前田道路	12,600	2,240.00	28,224,000		
日本道路	2,000	7,880.00	15,760,000		
東亜建設	5,700	2,488.00	14,181,600	貸付株式数	2,600株
日本国土開発	19,900	577.00	11,482,300		
若築建設	3,500	1,394.00	4,879,000		
東洋建設	23,200	567.00	13,154,400		
五洋建設	87,100	797.00	69,418,700		
世紀東急	9,800	870.00	8,526,000		
福　田　組	2,400	4,900.00	11,760,000		
日本ドライケミカル	1,600	1,901.00	3,041,600	貸付株式数	500株
住友林業	48,200	2,221.00	107,052,200		

日本基礎技術	6,300	513.00	3,231,900		
巴コーポレーション	8,400	384.00	3,225,600	貸付株式数	2,900株
大和ハウス	187,900	3,355.00	630,404,500		
ライト工業	11,800	1,833.00	21,629,400		
積水ハウス	220,600	2,256.00	497,673,600		
日特建設	5,200	771.00	4,009,200	貸付株式数	1,000株
北陸電気工事	3,300	1,222.00	4,032,600		
ユアテック	11,800	739.00	8,720,200		
日本リーテック	4,400	1,730.00	7,612,000	貸付株式数	1,600株
四電工	1,100	3,410.00	3,751,000		
中電工	9,100	2,338.00	21,275,800	貸付株式数	1,400株
関　電　工	32,900	915.00	30,103,500		
きんでん	40,900	1,877.00	76,769,300		
東京エネシス	6,700	978.00	6,552,600		
トーエネック	1,900	3,705.00	7,039,500		
住友電設	5,700	2,313.00	13,184,100		
日本電設工業	11,000	1,826.00	20,086,000	貸付株式数	2,300株
協和エクシオ	30,800	2,731.00	84,114,800		
新日本空調	5,400	2,073.00	11,194,200	貸付株式数	800株
日本工営	3,800	3,155.00	11,989,000		
九電工	14,300	3,450.00	49,335,000		
三機工業	15,000	1,420.00	21,300,000		
日揮ホールディングス	67,600	1,099.00	74,292,400		
中外炉工業	2,400	2,054.00	4,929,600		
ヤマト	6,200	788.00	4,885,600		
太平電業	4,500	2,657.00	11,956,500		
高砂熱学	18,400	1,881.00	34,610,400		
三晃金属	800	2,508.00	2,006,400		
ＮＥＣネッツエスアイ	21,200	1,768.00	37,481,600		
朝日工業社	1,400	2,973.00	4,162,200		
明星工業	13,100	750.00	9,825,000		
大　氣　社	9,800	3,400.00	33,320,000	貸付株式数	700株
ダイダン	4,500	2,633.00	11,848,500	貸付株式数	800株
日比谷総合設備	6,600	1,836.00	12,117,600	貸付株式数	500株
ニップン	19,400	1,577.00	30,593,800	貸付株式数	2,800株
日清製粉Ｇ本社	74,000	1,666.00	123,284,000		
日東富士製粉	500	7,060.00	3,530,000		
昭和産業	5,700	2,984.00	17,008,800		
鳥越製粉	6,400	793.00	5,075,200	貸付株式数	200株
中部飼料	8,100	1,176.00	9,525,600	貸付株式数	3,100株

フィード・ワン	9,200	752.00	6,918,400		
東洋精糖	1,500	1,188.00	1,782,000		
日本甜菜糖	3,500	1,643.00	5,750,500		
ＤＭ三井製糖ホールディ	5,100	1,858.00	9,475,800	貸付株式数	2,200株
塩水港精糖	10,300	227.00	2,338,100	貸付株式数	3,000株
日新製糖	3,000	1,728.00	5,184,000		
ＬＩＦＵＬＬ	22,500	356.00	8,010,000	貸付株式数	8,500株
ミクシィ	16,100	2,671.00	43,003,100		
ジェイエイシーリクルートメント	4,400	1,860.00	8,184,000		
日本M&Aセンター	101,900	2,689.00	274,009,100		
メンバーズ	2,100	3,180.00	6,678,000		
中広	1,100	351.00	386,100	貸付株式数	300株
ＵＴグループ	9,000	2,928.00	26,352,000	貸付株式数	2,900株
アイティメディア	2,400	1,702.00	4,084,800	貸付株式数	200株
タケエイ	7,100	1,281.00	9,095,100		
Ｅ・Ｊホールディングス	3,400	1,102.00	3,746,800		
夢真ビーネックスグループ	16,900	1,269.00	21,446,100		
コシダカホールディングス	16,900	661.00	11,170,900	貸付株式数	5,900株
アルトナー	1,600	840.00	1,344,000	貸付株式数	100株
パソナグループ	6,800	1,935.00	13,158,000		
ＣＤＳ	1,500	1,527.00	2,290,500		
リンクアンドモチベーション	11,500	598.00	6,877,000	貸付株式数	400株
ＧＣＡ	8,100	1,033.00	8,367,300		
エス・エム・エス	21,200	3,050.00	64,660,000		
サニーサイドアップＧ	2,000	825.00	1,650,000	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	61,900	2,172.00	134,446,800	貸付株式数	24,900株
リニカル	3,600	758.00	2,728,800	貸付株式数	1,300株
クックパッド	21,600	262.00	5,659,200		
エスクリ	2,500	496.00	1,240,000		
アイ・ケイ・ケイ	3,100	680.00	2,108,000	貸付株式数	1,200株
森永製菓	15,300	3,475.00	53,167,500	貸付株式数	6,000株
中　村　屋	1,600	3,745.00	5,992,000		
江崎グリコ	18,000	4,225.00	76,050,000		
名糖産業	3,200	1,526.00	4,883,200		
井村屋グループ	3,800	2,311.00	8,781,800		
不　二　家	4,100	2,172.00	8,905,200	貸付株式数	500株
山崎製パン	49,100	1,621.00	79,591,100		
第一屋製パン	1,800	948.00	1,706,400	貸付株式数	400株

モロゾフ	1,100	5,420.00	5,962,000	貸付株式数	400株
亀田製菓	3,800	4,475.00	17,005,000		
寿スピリッツ	6,300	7,500.00	47,250,000	貸付株式数	2,500株
カルビー	29,900	2,486.00	74,331,400		
森永乳業	12,300	5,720.00	70,356,000		
六甲バター	4,400	1,614.00	7,101,600	貸付株式数	200株
ヤクルト	44,900	5,990.00	268,951,000		
明治ホールディングス	43,200	6,660.00	287,712,000		
雪印メグミルク	15,700	2,148.00	33,723,600		
プリマハム	9,400	2,978.00	27,993,200		
日本ハム	25,100	4,500.00	112,950,000		
林兼産業	2,800	625.00	1,750,000		
丸大食品	6,400	1,692.00	10,828,800		
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,000	3,275.00	19,650,000		
柿安本店	2,200	2,536.00	5,579,200	貸付株式数	800株
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	42,400	706.00	29,934,400		
学情	2,300	1,467.00	3,374,100	貸付株式数	800株
スタジオアリス	3,300	2,213.00	7,302,900	貸付株式数	1,200株
クロスキャット	1,800	986.00	1,774,800	貸付株式数	100株
シミックホールディングス	3,100	1,473.00	4,566,300		
エプコ	1,500	941.00	1,411,500		
システナ	22,800	1,946.00	44,368,800		
ＮＪＳ	1,500	2,110.00	3,165,000		
デジタルアーツ	3,700	8,150.00	30,155,000	貸付株式数	1,400株
日鉄ソリューションズ	9,500	3,315.00	31,492,500		
綜合警備保障	24,500	5,090.00	124,705,000		
キューブシステム	3,700	1,032.00	3,818,400	貸付株式数	1,300株
いちご	71,700	350.00	25,095,000		
エイジア	1,200	2,035.00	2,442,000	貸付株式数	300株
日本駐車場開発	71,100	150.00	10,665,000		
コア	2,600	1,424.00	3,702,400		
カカクコム	46,100	3,440.00	158,584,000		
アイロムグループ	2,400	2,057.00	4,936,800	貸付株式数	800株
セントケア・ホールディング	4,800	1,020.00	4,896,000	貸付株式数	100株
サイネックス	1,700	695.00	1,181,500	貸付株式数	200株
ルネサンス	4,200	1,342.00	5,636,400	貸付株式数	100株
ディップ	9,900	3,505.00	34,699,500	貸付株式数	3,300株
ＳＢＳホールディングス	5,100	3,310.00	16,881,000		
デジタルホールディングス	4,700	2,294.00	10,781,800	貸付株式数	1,100株

新日本科学	7,900	771.00	6,090,900		
キャリアデザインセンター	1,500	1,069.00	1,603,500		
ベネフィット・ワン	22,700	3,235.00	73,434,500		
エムスリー	109,800	7,195.00	790,011,000		
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	4,900	402.00	1,969,800	貸付株式数	1,900株
ブラス	1,100	591.00	650,100	貸付株式数	300株
アウトソーシング	35,700	1,961.00	70,007,700	貸付株式数	14,000株
ウェルネット	6,300	515.00	3,244,500	貸付株式数	2,500株
ワールドホールディングス	2,200	2,757.00	6,065,400		
ディー・エヌ・エー	26,700	2,161.00	57,698,700		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	86,000	1,852.00	159,272,000		
ぐるなび	11,000	593.00	6,523,000	貸付株式数	4,300株
タカミヤ	7,500	557.00	4,177,500		
ジャパンベストレスキューＳ	5,000	712.00	3,560,000		
ファンコミュニケーションズ	16,400	381.00	6,248,400	貸付株式数	1,700株
ライク	1,800	2,157.00	3,882,600		
ビジネス・ブレークスルー	3,000	427.00	1,281,000		
エスプール	16,300	899.00	14,653,700		
ＷＤＢホールディングス	2,900	2,689.00	7,798,100		
手間いらず	900	6,370.00	5,733,000	貸付株式数	200株
ティア	3,600	478.00	1,720,800	貸付株式数	200株
ＣＤＧ	500	1,575.00	787,500		
バリューコマース	4,500	3,065.00	13,792,500		
インフォマート	63,000	930.00	58,590,000		
サッポロホールディングス	22,500	2,230.00	50,175,000		
アサヒグループホールディン	142,700	5,456.00	778,571,200	貸付株式数	59,000株
キリンＨＤ	276,900	2,241.00	620,532,900		
宝ホールディングス	48,700	1,512.00	73,634,400		
オエノンホールディングス	19,900	377.00	7,502,300		
養　命　酒	2,300	1,820.00	4,186,000		
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	50,000	1,858.00	92,900,000		
サントリー食品インター	43,800	4,275.00	187,245,000		
ダイドーグループＨＤ	3,800	4,935.00	18,753,000	貸付株式数	1,400株
伊　藤　園	19,900	6,510.00	129,549,000	貸付株式数	8,100株
キーコーヒー	6,900	2,077.00	14,331,300	貸付株式数	2,500株

ユニカフェ	2,500	999.00	2,497,500		
ジャパンフーズ	1,000	1,210.00	1,210,000		
日清オイリオグループ	8,500	3,090.00	26,265,000	貸付株式数	3,200株
不二製油グループ	16,100	2,700.00	43,470,000	貸付株式数	400株
かどや製油	700	4,030.00	2,821,000	貸付株式数	200株
Ｊ－オイルミルズ	6,200	1,900.00	11,780,000	貸付株式数	500株
ローソン	16,000	5,020.00	80,320,000	貸付株式数	3,500株
サンエー	4,700	4,330.00	20,351,000		
カワチ薬品	4,600	2,286.00	10,515,600	貸付株式数	1,500株
エービーシー・マート	9,900	6,640.00	65,736,000		
ハードオフコーポレーション	2,500	770.00	1,925,000		
高千穂交易	2,400	1,135.00	2,724,000	貸付株式数	900株
アスクル	11,200	1,807.00	20,238,400		
ゲオホールディングス	8,500	1,164.00	9,894,000	貸付株式数	2,100株
アダストリア	8,800	2,012.00	17,705,600	貸付株式数	3,500株
ジーフット	3,000	413.00	1,239,000	貸付株式数	1,600株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,000	408.00	408,000	貸付株式数	400株
オルバヘルスケアＨＬＤＧＳ	1,100	1,719.00	1,890,900	貸付株式数	400株
伊藤忠食品	1,600	5,100.00	8,160,000		
くら寿司	7,600	3,860.00	29,336,000	貸付株式数	2,800株
キャンドゥ	3,500	1,932.00	6,762,000	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,100	1,224.00	6,242,400	貸付株式数	1,000株
パルグループＨＬＤＧＳ	5,500	1,695.00	9,322,500		
ＪＡＬＵＸ	1,700	1,935.00	3,289,500	貸付株式数	700株
エディオン	27,000	1,070.00	28,890,000	貸付株式数	11,500株
あらた	5,000	4,145.00	20,725,000		
サーラコーポレーション	13,100	596.00	7,807,600	貸付株式数	2,200株
ワッツ	3,300	929.00	3,065,700	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	800	3,915.00	3,132,000		
ハローズ	2,600	2,714.00	7,056,400	貸付株式数	1,000株
ＪＰホールディングス	17,900	282.00	5,047,800		
フジオフードＧ本社	5,300	1,360.00	7,208,000	貸付株式数	2,000株 (100株)
あみやき亭	1,300	2,907.00	3,779,100	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,200	5,630.00	12,386,000	貸付株式数	800株
ひらまつ	11,800	210.00	2,478,000	貸付株式数	4,400株
フィールズ	5,700	470.00	2,679,000		

双日	352,400	350.00	123,340,000		
アルフレッサホールディングス	66,500	1,666.00	110,789,000		
大黒天物産	2,100	7,830.00	16,443,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,000	1,020.00	5,100,000	貸付株式数	1,900株
ファーマライズＨＤ	1,500	777.00	1,165,500	貸付株式数	600株
キッコーマン	47,000	7,150.00	336,050,000		
味　の　素	155,300	2,599.00	403,624,700		
キユーピー	36,700	2,605.00	95,603,500		
ハウス食品Ｇ本社	24,500	3,245.00	79,502,500		
カ　ゴ　メ	26,800	2,928.00	78,470,400	貸付株式数	10,400株
焼津水産化工	3,100	981.00	3,041,100	貸付株式数	600株
アリアケジャパン	6,000	6,450.00	38,700,000	貸付株式数	500株
ピエトロ	900	1,669.00	1,502,100		
エバラ食品工業	1,700	2,553.00	4,340,100		
やまみ	800	1,960.00	1,568,000		
ニチレイ	31,200	2,864.00	89,356,800		
横浜冷凍	17,300	886.00	15,327,800		
東洋水産	33,800	4,265.00	144,157,000		
イートアンドＨＬＤＧＳ	2,300	1,865.00	4,289,500	貸付株式数	900株
大冷	1,100	1,945.00	2,139,500		
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	4,000	777.00	3,108,000	貸付株式数	1,400株
日清食品ＨＤ	25,800	7,750.00	199,950,000		
永谷園ホールディングス	3,500	2,152.00	7,532,000		
一正蒲鉾	2,700	953.00	2,573,100	貸付株式数	1,000株
フジッコ	7,500	1,912.00	14,340,000	貸付株式数	1,200株
ロックフィールド	7,500	1,570.00	11,775,000	貸付株式数	2,700株
日本たばこ産業	349,700	2,200.00	769,340,000	貸付株式数	150,400株
ケンコーマヨネーズ	4,000	1,652.00	6,608,000	貸付株式数	1,000株
わらべや日洋ＨＤ	4,500	1,984.00	8,928,000	貸付株式数	1,600株
なとり	4,100	1,864.00	7,642,400		
イフジ産業	1,500	942.00	1,413,000	貸付株式数	200株
ピックルスコーポレーション	1,700	3,140.00	5,338,000		
北の達人コーポ	23,100	475.00	10,972,500	貸付株式数	8,900株 (8,900株)
ユーグレナ	34,000	846.00	28,764,000	貸付株式数	200株
スター・マイカ・ＨＬＤＧＳ	3,300	1,120.00	3,696,000		

ＡＤワークスグループ	12,600	167.00	2,104,200	貸付株式数	4,900株
片倉工業	8,500	1,507.00	12,809,500	貸付株式数	1,700株
グ　ン　ゼ	4,600	4,535.00	20,861,000		
ヒューリック	135,100	1,272.00	171,847,200	貸付株式数	53,800株
神　栄	1,000	1,382.00	1,382,000	貸付株式数	300株
ラサ商事	3,300	913.00	3,012,900		
アルペン	5,200	2,702.00	14,050,400	貸付株式数	1,900株
ハブ	2,100	759.00	1,593,900	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	4,700	2,710.00	12,737,000		
クオールホールディングス	8,600	1,479.00	12,719,400		
アルコニックス	6,800	1,490.00	10,132,000	貸付株式数	400株
神戸物産	44,100	2,849.00	125,640,900	貸付株式数	17,500株
ソリトンシステムズ	3,300	1,650.00	5,445,000		
ジンズホールディングス	4,300	7,800.00	33,540,000	貸付株式数	1,300株
ビックカメラ	37,600	1,119.00	42,074,400		
ＤＣＭホールディングス	39,500	1,017.00	40,171,500		
ペッパーフードサービス	8,300	471.00	3,909,300	貸付株式数	3,300株 (300株)
ハイパー	1,200	545.00	654,000		
ＭｏｎｏｔａＲＯ	91,200	2,555.00	233,016,000		
東京一番フーズ	1,600	595.00	952,000	貸付株式数	400株
ＤＤホールディングス	3,200	571.00	1,827,200	貸付株式数	1,200株
あい　ホールディングス	9,100	2,269.00	20,647,900	貸付株式数	3,600株
ディーブイエックス	2,100	960.00	2,016,000	貸付株式数	800株
きちりホールディングス	1,400	606.00	848,400	貸付株式数	400株
アークランドサービスＨＤ	5,500	2,290.00	12,595,000	貸付株式数	2,000株
Ｊ．　フロント　リテイリング	76,600	1,159.00	88,779,400		
ドトール・日レスＨＤ	10,100	1,714.00	17,311,400		
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	26,500	5,090.00	134,885,000		
ブロンコビリー	3,300	2,403.00	7,929,900	貸付株式数	1,300株
ＺＯＺＯ	37,700	3,815.00	143,825,500		
トレジャー・ファクトリー	2,000	992.00	1,984,000		
物語コーポレーション	3,500	6,800.00	23,800,000	貸付株式数	1,300株
ココカラファイン	5,700	8,540.00	48,678,000		
三越伊勢丹ＨＤ	112,000	857.00	95,984,000		
東洋紡	25,100	1,353.00	33,960,300		
ユニチカ	18,500	370.00	6,845,000		
富士紡ホールディングス	3,100	4,225.00	13,097,500		
日清紡ホールディングス	38,600	928.00	35,820,800		

倉敷紡績	5,600	2,057.00	11,519,200	貸付株式数	1,200株
ダイワボウＨＤ	29,400	1,773.00	52,126,200		
シキボウ	3,700	948.00	3,507,600	貸付株式数	1,000株
日東紡績	9,700	3,555.00	34,483,500	貸付株式数	1,100株
トヨタ紡織	18,700	2,269.00	42,430,300		
マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	15,100	2,466.00	37,236,600	貸付株式数	1,400株
Ｈａｍｅｅ	1,800	1,651.00	2,971,800	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	2,900	2,827.00	8,198,300	貸付株式数	1,100株
ウエルシアＨＤ	34,000	3,415.00	116,110,000	貸付株式数	200株
クリエイトＳＤＨ	9,400	3,245.00	30,503,000	貸付株式数	3,700株
バイタルＫＳＫＨＤ	11,100	705.00	7,825,500		
八洲電機	4,500	982.00	4,419,000		
メディアスホールディングス	3,800	1,065.00	4,047,000	貸付株式数	1,400株
レスターホールディングス	6,500	1,854.00	12,051,000		
ジューテックＨＤ	1,400	1,017.00	1,423,800		
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	5,000	402.00	2,010,000	貸付株式数	2,500株
大光	3,000	680.00	2,040,000	貸付株式数	1,000株
ＯＣＨＩホールディングス	1,900	1,283.00	2,437,700		
ＴＯＫＡＩホールディングス	30,900	883.00	27,284,700		
黒谷	2,300	935.00	2,150,500	貸付株式数	600株
ミサワ	1,800	668.00	1,202,400		
ティーライフ	1,300	1,435.00	1,865,500	貸付株式数	300株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,200	740.00	888,000	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,700	461.00	783,700	貸付株式数	400株
三洋貿易	6,400	1,305.00	8,352,000		
チムニー	2,100	1,393.00	2,925,300	貸付株式数	600株
シュッピン	4,600	914.00	4,204,400		
ビューティガレージ	1,100	3,735.00	4,108,500	貸付株式数	200株
オイシックス・ラ・大地	8,500	3,285.00	27,922,500	貸付株式数	100株 (100株)
ウイン・パートナーズ	4,600	973.00	4,475,800	貸付株式数	1,000株
ネクステージ	11,500	1,623.00	18,664,500		
ジョイフル本田	18,300	1,354.00	24,778,200	貸付株式数	7,400株
鳥貴族ホールディングス	2,100	1,942.00	4,078,200	貸付株式数	700株
ホットランド	4,600	1,395.00	6,417,000	貸付株式数	1,800株

すかいらーくＨＤ	71,400	1,585.00	113,169,000	貸付株式数	28,500株 (2,800株)
ＳＦＰホールディングス	2,900	1,439.00	4,173,100	貸付株式数	1,500株
綿半ホールディングス	4,900	1,221.00	5,982,900	貸付株式数	1,400株
日本毛織	19,800	979.00	19,384,200	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	12,100	104.00	1,258,400	貸付株式数	4,300株
トーア紡コーポレーション	2,300	470.00	1,081,000	貸付株式数	1,000株
ダイドーリミテツド	7,600	176.00	1,337,600		
ヨシックス	1,300	2,318.00	3,013,400	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパーマーケ	18,400	1,098.00	20,203,200	貸付株式数	7,400株
三栄建築設計	2,800	2,068.00	5,790,400		
野村不動産ＨＬＤＧＳ	39,200	2,930.00	114,856,000		
三重交通グループＨＤ	12,400	489.00	6,063,600	貸付株式数	3,500株
サムティ	9,300	2,016.00	18,748,800		
日本商業開発	4,500	1,854.00	8,343,000	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーション	10,700	1,529.00	16,360,300	貸付株式数	900株
フィル・カンパニー	1,200	2,803.00	3,363,600		
ハウスコム	1,200	1,247.00	1,496,400		
日本管理センター	3,600	1,342.00	4,831,200		
サンセイランディック	1,800	897.00	1,614,600	貸付株式数	700株 (700株)
エストラスト	1,100	680.00	748,000		
フージャースＨＤ	10,400	765.00	7,956,000	貸付株式数	4,900株
オープンハウス	20,500	5,190.00	106,395,000		
東急不動産ＨＤ	174,000	707.00	123,018,000		
飯田ＧＨＤ	53,400	3,020.00	161,268,000		
イーグランド	1,200	1,077.00	1,292,400		
帝国繊維	7,200	2,093.00	15,069,600	貸付株式数	1,700株
日本コークス工業	57,800	106.00	6,126,800		
ゴルフダイジェスト・オン	3,900	1,320.00	5,148,000	貸付株式数	1,300株
ミタチ産業	1,100	650.00	715,000	貸付株式数	600株
ＢＥＥＮＯＳ	3,400	3,550.00	12,070,000	貸付株式数	200株
あさひ	5,000	1,401.00	7,005,000	貸付株式数	1,900株
日本調剤	3,900	1,615.00	6,298,500		
コスモス薬品	6,500	15,440.00	100,360,000		
シップヘルスケアＨＤ	22,700	2,613.00	59,315,100		
トーエル	3,100	783.00	2,427,300	貸付株式数	100株
ソフトクリエイトＨＤ	2,600	2,226.00	5,787,600	貸付株式数	600株

オンリー	1,100	466.00	512,600	貸付株式数	300株
セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ	250,300	4,984.00	1,247,495,200		
クリエイト・レストランツ・ホール	34,700	870.00	30,189,000	貸付株式数	14,400株 (800株)
明治電機工業	2,100	1,409.00	2,958,900		
ツルハホールディングス	14,000	13,610.00	190,540,000	貸付株式数	5,500株
デリカフーズＨＬＤＧＳ	3,500	630.00	2,205,000		
スターティアホールディングス	1,600	1,410.00	2,256,000	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,000	1,646.00	8,230,000	貸付株式数	300株
フェリシモ	1,600	1,388.00	2,220,800	貸付株式数	400株
トリドールホールディングス	15,800	1,780.00	28,124,000		
帝　人	59,800	1,803.00	107,819,400	貸付株式数	23,400株
東　レ	460,200	762.70	350,994,540		
ク　ラ　レ	100,400	1,126.00	113,050,400		
旭　化　成	421,200	1,270.50	535,134,600		
サカイオーベックス	1,700	3,025.00	5,142,500		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	6,000	776.00	4,656,000		
稲葉製作所	4,600	1,507.00	6,932,200	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングＧ	2,300	2,278.00	5,239,400		
トーカロ	16,600	1,448.00	24,036,800		
アルファＣＯ	2,200	1,137.00	2,501,400		
ＳＵＭＣＯ	82,000	2,617.00	214,594,000	貸付株式数	30,700株
川田テクノロジーズ	1,300	3,790.00	4,927,000		
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	2,100	5,980.00	12,558,000		
信和	3,500	732.00	2,562,000		
ビーロット	3,300	653.00	2,154,900		
ファーストブラザーズ	1,200	1,027.00	1,232,400	貸付株式数	400株
ハウスドゥ	3,300	1,037.00	3,422,100	貸付株式数	1,200株
シーアールイー	1,800	1,582.00	2,847,600	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	1,400	2,260.00	3,164,000	貸付株式数	300株
ケイアイスター不動産	2,100	5,190.00	10,899,000		
アグレ都市デザイン	1,600	1,042.00	1,667,200	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,200	3,345.00	4,014,000		
テンポイノベーション	2,200	972.00	2,138,400	貸付株式数	500株
グロバルリンクマネジメント	1,200	831.00	997,200	貸付株式数	400株

住江織物	1,400	1,869.00	2,616,600		
日本フエルト	3,000	457.00	1,371,000		
イチカワ	800	1,376.00	1,100,800		
エコナックホールディングス	13,500	91.00	1,228,500		
日東製網	900	1,564.00	1,407,600		
芦森工業	1,200	1,047.00	1,256,400	貸付株式数	500株
アツギ	4,900	618.00	3,028,200		
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	1,200	1,299.00	1,558,800	貸付株式数	400株
ＪＭホールディングス	4,900	2,198.00	10,770,200		
コメダホールディングス	14,000	2,024.00	28,336,000		
サツドラホールディングス	900	2,052.00	1,846,800		
アレンザホールディングス	4,500	1,251.00	5,629,500	貸付株式数	1,500株 (300株)
串カツ田中ＨＬＤＧＳ	1,800	1,899.00	3,418,200	貸付株式数	600株 (600株)
バロックジャパン	4,500	808.00	3,636,000		
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	6,400	7,860.00	50,304,000	貸付株式数	2,500株
ダイニック	2,500	778.00	1,945,000		
共和レザー	3,300	729.00	2,405,700		
ピーバンドットコム	1,100	814.00	895,400	貸付株式数	300株
力の源ＨＤ	2,300	654.00	1,504,200	貸付株式数	900株
ＦＯＯＤ&ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮ	37,500	4,820.00	180,750,000		
アセンテック	1,800	1,285.00	2,313,000	貸付株式数	500株
セーレン	15,700	2,162.00	33,943,400		
ソトー	1,800	802.00	1,443,600		
東海染工	800	1,128.00	902,400		
小松マテーレ	10,500	941.00	9,880,500	貸付株式数	3,300株
ワコールホールディングス	15,800	2,514.00	39,721,200		
ホギメディカル	8,500	3,430.00	29,155,000	貸付株式数	2,300株
クラウディアＨＬＤＧＳ	2,100	299.00	627,900	貸付株式数	600株
ＴＳＩホールディングス	19,400	331.00	6,421,400		
マツオカコーポレーション	2,000	1,760.00	3,520,000	貸付株式数	800株
ワールド	8,200	1,591.00	13,046,200		
ＴＩＳ	63,700	2,803.00	178,551,100		
ＪＮＳホールディングス	3,100	569.00	1,763,900	貸付株式数	1,200株
電算システム	2,400	2,847.00	6,832,800		
グリー	42,300	560.00	23,688,000	貸付株式数	15,200株
コーエーテクモＨＤ	17,100	5,060.00	86,526,000		

三菱総合研究所	2,700	3,890.00	10,503,000	貸付株式数	1,000株
ボルテージ	3,100	490.00	1,519,000	貸付株式数	400株
電算	500	2,510.00	1,255,000		
ＡＧＳ	3,100	840.00	2,604,000		
ファインデックス	5,600	1,000.00	5,600,000		
ブレインパッド	1,700	4,860.00	8,262,000	貸付株式数	600株
ＫＬａｂ	11,900	680.00	8,092,000	貸付株式数	4,700株
ポールトゥウィン・ピットクル	8,800	1,161.00	10,216,800	貸付株式数	1,200株
イーブックイニシアティブ	1,300	3,370.00	4,381,000	貸付株式数	400株
ネクソン	161,600	2,477.00	400,283,200		
アイスタイル	20,300	536.00	10,880,800	貸付株式数	7,700株
エムアップホールディングス	1,900	2,760.00	5,244,000	貸付株式数	600株
エイチーム	4,900	1,748.00	8,565,200		
エニグモ	6,300	1,389.00	8,750,700	貸付株式数	100株
テクノスジャパン	5,300	607.00	3,217,100		
ｅｎｉｓｈ	3,500	508.00	1,778,000	貸付株式数	1,300株
コロプラ	20,800	790.00	16,432,000	貸付株式数	100株
オルトプラス	4,900	434.00	2,126,600	貸付株式数	1,500株
ブロードリーフ	31,600	520.00	16,432,000	貸付株式数	12,300株
クロス・マーケティングＧ	3,100	686.00	2,126,600	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	3,100	1,530.00	4,743,000	貸付株式数	1,100株 (600株)
システム情報	5,000	942.00	4,710,000	貸付株式数	1,900株
メディアドゥ	2,700	4,690.00	12,663,000	貸付株式数	900株
じげん	16,200	403.00	6,528,600		
ブイキューブ	3,600	2,426.00	8,733,600	貸付株式数	1,300株
エンカレッジ・テクノロジ	1,100	663.00	729,300	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	2,300	1,589.00	3,654,700	貸付株式数	800株
ディー・エル・イー	4,300	298.00	1,281,400		
フィックスターズ	6,800	837.00	5,691,600	貸付株式数	2,700株
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,800	1,698.00	4,754,400	貸付株式数	1,200株
オプティム	4,600	2,326.00	10,699,600	貸付株式数	1,700株
セレス	2,200	3,470.00	7,634,000	貸付株式数	300株
ＳＨＩＦＴ	3,300	15,260.00	50,358,000	貸付株式数	200株
特種東海製紙	3,900	4,355.00	16,984,500	貸付株式数	100株
ティーガイア	6,700	1,951.00	13,071,700	貸付株式数	2,700株
セック	900	2,695.00	2,425,500	貸付株式数	200株

日本アジアグループ	7,300	917.00	6,694,100		
テクマトリックス	10,200	1,659.00	16,921,800		
プロシップ	1,800	1,339.00	2,410,200		
ガンホー・オンライン・エンター	15,400	2,150.00	33,110,000		
GMOペイメントゲートウェイ	13,600	12,800.00	174,080,000		
ザッパラス	4,000	537.00	2,148,000		
システムリサーチ	1,900	2,081.00	3,953,900	貸付株式数	500株
インターネットイニシアティブ	17,300	3,030.00	52,419,000		
さくらインターネット	7,500	631.00	4,732,500	貸付株式数	2,700株
ヴィンクス	1,900	991.00	1,882,900	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインHD	1,600	5,020.00	8,032,000	貸付株式数	500株 (400株)
ＳＲＡホールディングス	3,400	2,754.00	9,363,600		
システムインテグレータ	1,800	624.00	1,123,200		
朝日ネット	6,000	702.00	4,212,000	貸付株式数	300株
ｅＢＡＳＥ	7,900	838.00	6,620,200	貸付株式数	3,100株
アバント	7,200	1,458.00	10,497,600		
アドソル日進	2,400	2,366.00	5,678,400		
フリービット	4,400	894.00	3,933,600	貸付株式数	100株
コムチュア	6,000	2,382.00	14,292,000		
サイバーコム	1,100	1,533.00	1,686,300	貸付株式数	400株
アステリア	4,800	799.00	3,835,200	貸付株式数	1,800株
アイル	3,700	1,587.00	5,871,900		
王子ホールディングス	287,100	674.00	193,505,400		
日本製紙	28,300	1,287.00	36,422,100		
三菱製紙	7,800	370.00	2,886,000	貸付株式数	3,100株
北越コーポレーション	45,700	605.00	27,648,500	貸付株式数	14,300株
中越パルプ	2,300	1,242.00	2,856,600		
巴川製紙	2,100	816.00	1,713,600		
大王製紙	30,800	1,749.00	53,869,200		
阿波製紙	1,600	425.00	680,000		
マークラインズ	2,900	2,986.00	8,659,400		
メディカル・データ・ビジ	7,500	2,039.00	15,292,500	貸付株式数	2,800株
ｇｕｍｉ	9,200	1,058.00	9,733,600	貸付株式数	3,500株
ショーケース	1,800	757.00	1,362,600	貸付株式数	500株
モバイルファクトリー	1,600	1,250.00	2,000,000	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,100	2,544.00	5,342,400	貸付株式数	900株

デジタル・インフォメーション	3,100	2,005.00	6,215,500	貸付株式数	1,100株
ＰＣＩホールディングス	2,500	1,231.00	3,077,500	貸付株式数	1,000株
パイプドＨＤ	1,400	1,677.00	2,347,800	貸付株式数	500株 (500株)
アイビーシー	1,200	1,022.00	1,226,400	貸付株式数	200株
ネオジャパン	1,300	1,720.00	2,236,000	貸付株式数	400株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,600	3,280.00	5,248,000	貸付株式数	500株
ラクス	19,500	2,025.00	39,487,500		
ランドコンピュータ	1,000	1,069.00	1,069,000	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	900	4,940.00	4,446,000		
オープンドア	4,000	2,539.00	10,156,000	貸付株式数	1,300株
マイネット	2,500	754.00	1,885,000	貸付株式数	800株
アカツキ	2,700	3,575.00	9,652,500		
ベネフィットジャパン	700	2,120.00	1,484,000		
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	1,800	3,070.00	5,526,000		
カナミックネットワーク	7,000	622.00	4,354,000	貸付株式数	1,900株
ノムラシステムコーポレーション	3,200	291.00	931,200	貸付株式数	1,100株
レンゴー	65,600	977.00	64,091,200	貸付株式数	26,100株
トーモク	3,800	1,940.00	7,372,000	貸付株式数	1,200株
ザ・パック	4,800	2,756.00	13,228,800	貸付株式数	800株
チェンジ	12,000	2,820.00	33,840,000		
シンクロ・フード	5,200	390.00	2,028,000		
オークネット	3,800	1,444.00	5,487,200	貸付株式数	900株
セグエグループ	1,800	1,138.00	2,048,400		
エイトレッド	1,300	2,223.00	2,889,900	貸付株式数	300株
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,300	897.00	5,651,100		
マクロミル	13,000	851.00	11,063,000		
ビーグリー	1,600	1,368.00	2,188,800	貸付株式数	500株
オロ	2,200	3,575.00	7,865,000		
ユーザーローカル	1,000	4,175.00	4,175,000		
テモナ	1,900	1,108.00	2,105,200	貸付株式数	500株
ニーズウェル	1,400	613.00	858,200	貸付株式数	100株
サインポスト	1,500	863.00	1,294,500	貸付株式数	600株
昭和電工	48,300	3,605.00	174,121,500		
住友化学	501,200	621.00	311,245,200		
住友精化	3,100	3,545.00	10,989,500		

日産化学	35,100	5,800.00	203,580,000	
ラサ工業	2,200	1,919.00	4,221,800	貸付株式数 200株
クレハ	5,500	6,410.00	35,255,000	
多木化学	2,500	5,410.00	13,525,000	貸付株式数 900株
テイカ	4,500	1,290.00	5,805,000	
石原産業	11,600	1,040.00	12,064,000	
片倉コープアグリ	1,600	1,227.00	1,963,200	
日本曹達	8,900	3,350.00	29,815,000	
東ソー	98,200	1,968.00	193,257,600	
トクヤマ	18,900	2,335.00	44,131,500	
セントラル硝子	11,800	2,104.00	24,827,200	
東亞合成	38,500	1,180.00	45,430,000	
大阪ソーダ	6,300	2,495.00	15,718,500	
関東電化	14,800	1,016.00	15,036,800	
デンカ	23,300	3,820.00	89,006,000	
イビデン	31,400	5,610.00	176,154,000	
信越化学	117,600	19,380.00	2,279,088,000	
日本カーバイド	2,200	1,325.00	2,915,000	
堺　化　学	4,400	1,870.00	8,228,000	
第一稀元素化学工	6,800	1,786.00	12,144,800	
エア・ウォーター	65,200	1,789.00	116,642,800	
日本酸素ＨＬＤＧＳ	52,400	2,166.00	113,498,400	
日本化学工業	1,900	2,777.00	5,276,300	
東邦アセチレン	1,200	1,210.00	1,452,000	
日本パーカライジング	31,500	1,107.00	34,870,500	
高圧ガス	9,800	642.00	6,291,600	
チタン工業	900	1,902.00	1,711,800	
四国化成	8,000	1,243.00	9,944,000	
戸田工業	1,400	2,382.00	3,334,800	
ステラ　ケミファ	3,500	3,055.00	10,692,500	貸付株式数 400株
保土谷化学	1,900	4,055.00	7,704,500	
日本触媒	11,400	5,570.00	63,498,000	
大日精化	5,000	2,367.00	11,835,000	
カネカ	16,400	4,575.00	75,030,000	
協和キリン	65,300	3,600.00	235,080,000	
三菱瓦斯化学	63,900	2,518.00	160,900,200	
三井化学	55,000	3,940.00	216,700,000	
ＪＳＲ	64,200	3,255.00	208,971,000	
東京応化工業	11,000	7,180.00	78,980,000	
大阪有機化学	6,000	4,295.00	25,770,000	

三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	424,900	916.00	389,208,400		
ＫＨネオケム	10,700	2,800.00	29,960,000		
ダイセル	85,300	921.00	78,561,300		
住友ベークライト	10,000	4,945.00	49,450,000	貸付株式数	3,900株
積水化学	134,100	1,914.00	256,667,400		
日本ゼオン	57,600	1,628.00	93,772,800		
アイカ工業	17,600	3,935.00	69,256,000		
宇部興産	32,200	2,360.00	75,992,000		
積水樹脂	10,200	2,056.00	20,971,200		
タキロンシーアイ	13,800	589.00	8,128,200		
旭有機材	3,600	1,356.00	4,881,600		
ニチバン	3,200	1,782.00	5,702,400	貸付株式数	1,200株
リケンテクノス	15,100	590.00	8,909,000		
大倉工業	3,000	2,494.00	7,482,000	貸付株式数	100株
積水化成品	7,900	603.00	4,763,700		
群栄化学	1,400	2,427.00	3,397,800		
タイガース　ポリマー	2,200	456.00	1,003,200	貸付株式数	100株
ミライアル	1,900	1,501.00	2,851,900		
ダイキアクシス	2,600	876.00	2,277,600	貸付株式数	900株
ダイキョーニシカワ	13,100	789.00	10,335,900	貸付株式数	5,200株
竹本容器	2,600	971.00	2,524,600	貸付株式数	800株
森六ホールディングス	3,300	2,339.00	7,718,700	貸付株式数	700株
日本化薬	38,900	1,046.00	40,689,400		
カーリットホールディングス	6,300	679.00	4,277,700		
ＥＰＳホールディングス	8,500	1,799.00	15,291,500	貸付株式数	1,000株
ソルクシーズ	2,600	1,017.00	2,644,200	貸付株式数	900株
レッグス	1,700	2,719.00	4,622,300	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	23,300	710.00	16,543,000		
フェイス	2,300	839.00	1,929,700		
プロトコーポレーション	7,800	1,152.00	8,985,600		
ハイマックス	2,000	1,064.00	2,128,000		
アミューズ	3,500	2,330.00	8,155,000		
野村総合研究所	115,800	3,395.00	393,141,000		
ドリームインキュベータ	2,000	1,000.00	2,000,000		
サイバネットシステム	4,600	813.00	3,739,800		
クイック	3,800	1,241.00	4,715,800		
ＴＡＣ	4,000	235.00	940,000		
ＣＥホールディングス	3,600	534.00	1,922,400		
日本システム技術	1,200	1,535.00	1,842,000		

電通グループ	69,700	3,915.00	272,875,500	貸付株式数	6,500株
インテージホールディングス	7,900	1,602.00	12,655,800	貸付株式数	1,500株
テイクアンドギヴニーズ	3,400	986.00	3,352,400		
東邦システムサイエンス	1,200	918.00	1,101,600	貸付株式数	600株
ぴあ	1,800	3,235.00	5,823,000	貸付株式数	700株
イオンファンタジー	2,400	2,319.00	5,565,600	貸付株式数	900株
ソースネクスト	31,100	316.00	9,827,600		
シーティーエス	7,100	887.00	6,297,700	貸付株式数	1,300株
ネクシィーズグループ	2,100	933.00	1,959,300	貸付株式数	800株
インフォコム	5,900	3,085.00	18,201,500		
メディカルシステムネットワーク	5,800	692.00	4,013,600	貸付株式数	700株
日本精化	4,700	1,469.00	6,904,300	貸付株式数	1,000株
扶桑化学工業	5,100	3,955.00	20,170,500		
トリケミカル	6,100	3,660.00	22,326,000	貸付株式数	2,300株
ＨＥＲＯＺ	1,800	2,407.00	4,332,600		
ラクスル	7,000	4,795.00	33,565,000	貸付株式数	2,000株
ＦＩＧ	6,800	282.00	1,917,600	貸付株式数	800株
システムサポート	1,900	1,393.00	2,646,700	貸付株式数	200株
ＡＤＥＫＡ	29,300	1,939.00	56,812,700	貸付株式数	200株
日油	24,100	5,750.00	138,575,000		
ミヨシ油脂	2,300	1,246.00	2,865,800		
新日本理化	12,300	283.00	3,480,900	貸付株式数	900株
ハリマ化成グループ	4,700	902.00	4,239,400		
イーソル	3,400	1,104.00	3,753,600	貸付株式数	1,300株
アルテリア・ネットワークス	7,500	1,661.00	12,457,500		
東海ソフト	1,000	1,386.00	1,386,000	貸付株式数	200株
ヒト・コミュニケーションズＨＤ	1,500	2,078.00	3,117,000		
トビラシステムズ	800	1,319.00	1,055,200	貸付株式数	200株
Ｓａｎｓａｎ	5,700	8,340.00	47,538,000	貸付株式数	1,200株
花　王	155,500	6,669.00	1,037,029,500		
第一工業製薬	2,200	3,460.00	7,612,000		
石原ケミカル	1,700	2,208.00	3,753,600	貸付株式数	700株
日華化学	2,200	1,284.00	2,824,800		
ニイタカ	1,400	2,510.00	3,514,000	貸付株式数	500株
三洋化成	3,900	5,550.00	21,645,000		
武田薬品	540,700	3,666.00	1,982,206,200		

アステラス製薬	563,400	1,890.00	1,064,826,000		
大日本住友製薬	48,200	2,184.00	105,268,800		
塩野義製薬	81,800	5,597.00	457,834,600		
わかもと製薬	8,200	338.00	2,771,600	貸付株式数	3,000株 (2,800株)
日本新薬	18,400	8,130.00	149,592,000		
ビオフエルミン製薬	1,300	3,035.00	3,945,500		
中外製薬	203,200	4,228.00	859,129,600		
科研製薬	11,100	4,695.00	52,114,500		
エーザイ	71,800	7,751.00	556,521,800		
理研ビタミン	6,400	1,462.00	9,356,800		
ロート製薬	30,900	2,747.00	84,882,300		
小野薬品	149,100	2,419.50	360,747,450		
久光製薬	18,800	5,710.00	107,348,000		
有機合成薬品	5,100	301.00	1,535,100	貸付株式数	2,000株
持田製薬	8,900	3,645.00	32,440,500		
参天製薬	113,300	1,454.00	164,738,200		
扶桑薬品	2,100	2,269.00	4,764,900	貸付株式数	200株
日本ケミファ	700	2,260.00	1,582,000		
ツムラ	21,800	3,555.00	77,499,000	貸付株式数	6,800株
日医工	18,600	891.00	16,572,600		
テ　ル　モ	199,100	4,209.00	838,011,900		
ＨＵグループＨＤ	17,600	2,853.00	50,212,800		
キッセイ薬品工業	11,400	2,082.00	23,734,800		
生化学工業	11,400	1,063.00	12,118,200		
栄研化学	11,600	2,094.00	24,290,400	貸付株式数	2,900株
日水製薬	2,300	971.00	2,233,300		
鳥居薬品	4,100	2,460.00	10,086,000		
ＪＣＲファーマ	18,500	3,200.00	59,200,000		
東和薬品	9,300	2,509.00	23,333,700		
富士製薬工業	4,500	1,150.00	5,175,000	貸付株式数	900株
ゼリア新薬工業	11,900	2,102.00	25,013,800	貸付株式数	4,900株
第一三共	510,600	2,366.50	1,208,334,900		
キョーリン製薬ＨＤ	14,600	1,693.00	24,717,800		
大幸薬品	8,300	1,058.00	8,781,400	貸付株式数	3,300株
ダイト	4,200	3,390.00	14,238,000	貸付株式数	700株
大塚ホールディングス	134,700	4,601.00	619,754,700		
大正製薬ＨＤ	15,300	6,110.00	93,483,000	貸付株式数	4,300株
ペプチドリーム	33,600	4,875.00	163,800,000		
大日本塗料	7,000	854.00	5,978,000	貸付株式数	1,700株

日本ペイントＨＯＬＤ	262,800	1,569.00	412,333,200		
関西ペイント	71,600	2,948.00	211,076,800	貸付株式数	28,600株
神東塗料	5,800	196.00	1,136,800		
中国塗料	15,500	895.00	13,872,500		
日本特殊塗料	4,800	1,118.00	5,366,400		
藤倉化成	8,200	528.00	4,329,600		
太陽ホールディングス	4,800	5,290.00	25,392,000		
ＤＩＣ	26,600	2,988.00	79,480,800	貸付株式数	10,600株
サカタインクス	13,600	1,043.00	14,184,800		
東洋インキＳＣホールディン	13,100	2,086.00	27,326,600	貸付株式数	5,200株
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	4,600	821.00	3,776,600		
アルプス技研	5,500	1,955.00	10,752,500		
サニックス	10,500	368.00	3,864,000	貸付株式数	3,900株
ダイオーズ	800	1,023.00	818,400	貸付株式数	400株
日本空調サービス	6,200	738.00	4,575,600		
オリエンタルランド	66,000	16,945.00	1,118,370,000		
フォーカスシステムズ	4,200	893.00	3,750,600		
ダスキン	14,400	2,586.00	37,238,400	貸付株式数	4,500株
パーク２４	34,500	2,478.00	85,491,000	貸付株式数	13,700株
明光ネットワークジャパン	8,100	576.00	4,665,600	貸付株式数	3,000株
ファルコホールディングス	2,900	1,698.00	4,924,200		
クレスコ	4,300	1,701.00	7,314,300		
フジ・メディア・ＨＤ	65,600	1,261.00	82,721,600		
秀英予備校	1,900	400.00	760,000	貸付株式数	600株
田谷	1,500	541.00	811,500	貸付株式数	600株
ラウンドワン	21,500	1,571.00	33,776,500	貸付株式数	1,600株
リゾートトラスト	28,700	1,905.00	54,673,500	貸付株式数	11,400株
オービック	20,100	20,170.00	405,417,000		
ジャストシステム	9,100	5,900.00	53,690,000	貸付株式数	2,400株
ＴＤＣソフト	5,600	988.00	5,532,800	貸付株式数	1,900株
Ｚホールディングス	869,700	505.30	439,459,410		
ビー・エム・エル	8,000	3,650.00	29,200,000	貸付株式数	200株
トレンドマイクロ	33,900	5,460.00	185,094,000		
りらいあコミュニケーショ	9,500	1,299.00	12,340,500	貸付株式数	2,600株
ＩＤホールディングス	2,400	1,347.00	3,232,800		
リソー教育	33,400	314.00	10,487,600		
日本オラクル	12,900	9,900.00	127,710,000		
早稲田アカデミー	2,700	893.00	2,411,100	貸付株式数	600株
アルファシステムズ	1,700	3,600.00	6,120,000	貸付株式数	600株

フューチャー	7,900	2,115.00	16,708,500		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,100	1,453.00	5,957,300		
ＳＢテクノロジー	2,600	3,025.00	7,865,000	貸付株式数	900株
トーセ	1,700	813.00	1,382,100	貸付株式数	300株
ユー・エス・エス	68,900	1,869.00	128,774,100		
オービックビジネスＣ	6,500	6,160.00	40,040,000	貸付株式数	2,500株
伊藤忠テクノソリュー	29,000	3,415.00	99,035,000		
アイティフォー	8,200	761.00	6,240,200		
東京個別指導学院	5,500	612.00	3,366,000	貸付株式数	900株
東計電算	900	4,865.00	4,378,500		
サイバーエージェント	153,700	2,146.00	329,840,200		
楽天グループ	290,600	1,284.00	373,130,400		
エックスネット	1,000	1,013.00	1,013,000	貸付株式数	100株
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,453.00	4,940,200	貸付株式数	200株
テー・オー・ダブリュー	10,500	346.00	3,633,000	貸付株式数	4,200株
大塚商会	34,400	5,930.00	203,992,000	貸付株式数	13,500株
サイボウズ	7,600	2,429.00	18,460,400	貸付株式数	1,100株
山田コンサルティンググループ	3,600	1,210.00	4,356,000	貸付株式数	1,600株
セントラルスポーツ	2,300	2,628.00	6,044,400	貸付株式数	100株
パラカ	1,600	1,633.00	2,612,800		
電通国際情報Ｓ	8,000	3,810.00	30,480,000		
ＡＣＣＥＳＳ	7,700	879.00	6,768,300	貸付株式数	2,400株
デジタルガレージ	10,500	4,740.00	49,770,000	貸付株式数	3,800株
イーエムシステムズ	10,400	835.00	8,684,000	貸付株式数	4,100株
ウェザーニューズ	2,000	5,790.00	11,580,000		
ＣＩＪ	4,000	851.00	3,404,000	貸付株式数	700株
ビジネスエンジニアリング	600	3,225.00	1,935,000	貸付株式数	200株
日本エンタープライズ	7,900	216.00	1,706,400	貸付株式数	2,700株
WOWOW	3,200	2,350.00	7,520,000	貸付株式数	500株 (400株)
スカラ	5,800	838.00	4,860,400	貸付株式数	2,100株
インテリジェント　ウェイブ	3,700	660.00	2,442,000		
フルキャストホールディングス	5,400	2,202.00	11,890,800		
エン・ジャパン	11,100	3,790.00	42,069,000		
あすか製薬ＨＤ	7,800	1,040.00	8,112,000		
サワイグループＨＤ	14,200	4,855.00	68,941,000		
富士フイルムＨＬＤＧＳ	114,200	7,756.00	885,735,200		

コニカミノルタ	132,300	632.00	83,613,600		
資　生　堂	129,200	7,912.00	1,022,230,400		
ライオン	84,700	1,910.00	161,777,000		
高砂香料	4,000	2,704.00	10,816,000	貸付株式数	300株
マンダム	13,600	2,045.00	27,812,000	貸付株式数	5,300株
ミルボン	8,800	6,310.00	55,528,000		
ファンケル	23,900	3,360.00	80,304,000		
コーセー	12,200	17,910.00	218,502,000		
コタ	4,500	1,429.00	6,430,500		
シーボン	700	1,960.00	1,372,000		
ポーラ・オルビスＨＤ	27,900	2,914.00	81,300,600		
ノエビアホールディングス	5,400	5,230.00	28,242,000		
アジュバンコスメジャパン	1,900	1,027.00	1,951,300	貸付株式数	500株
エステー	4,200	1,763.00	7,404,600		
アグロカネショウ	2,500	1,440.00	3,600,000		
コ　ニ　シ	10,600	1,553.00	16,461,800	貸付株式数	1,800株
長谷川香料	11,000	2,211.00	24,321,000		
星光ＰＭＣ	3,500	812.00	2,842,000		
小林製薬	18,300	9,250.00	169,275,000		
荒川化学工業	5,000	1,207.00	6,035,000	貸付株式数	2,000株
メック	4,600	2,854.00	13,128,400	貸付株式数	1,700株 (1,500株)
日本高純度化学	1,900	2,821.00	5,359,900		
タカラバイオ	17,100	2,817.00	48,170,700		
ＪＣＵ	7,400	3,525.00	26,085,000		
新田ゼラチン	4,000	648.00	2,592,000	貸付株式数	200株
ＯＡＴアグリオ	1,200	1,459.00	1,750,800		
デクセリアルズ	18,700	2,295.00	42,916,500		
アース製薬	4,900	6,560.00	32,144,000	貸付株式数	1,900株
北興化学	6,300	933.00	5,877,900		
大成ラミック	2,300	2,750.00	6,325,000		
クミアイ化学	26,900	842.00	22,649,800	貸付株式数	4,400株
日本農薬	11,500	510.00	5,865,000		
富士興産	2,100	1,247.00	2,618,700	貸付株式数	700株
ニチレキ	7,700	1,353.00	10,418,100		
ユシロ化学	3,400	1,189.00	4,042,600		
ビーピー・カストロール	2,300	1,404.00	3,229,200		
富士石油	16,900	282.00	4,765,800	貸付株式数	6,200株
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,100	1,111.00	2,333,100		
出光興産	71,800	2,686.00	192,854,800		

ＥＮＥＯＳホールディングス	973,600	474.80	462,265,280		
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	20,600	2,435.00	50,161,000		
横浜ゴム	37,400	2,330.00	87,142,000		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	34,300	2,285.00	78,375,500		
ブリヂストン	172,600	4,975.00	858,685,000	貸付株式数	68,400株
住友ゴム	58,100	1,504.00	87,382,400		
藤倉コンポジット	5,500	508.00	2,794,000		
オカモト	3,900	4,340.00	16,926,000		
アキレス	4,500	1,396.00	6,282,000		
フ　コ　ク	2,800	998.00	2,794,400	貸付株式数	1,100株
ニッタ	6,800	2,750.00	18,700,000		
クリエートメディック	1,800	1,004.00	1,807,200		
住友理工	12,200	736.00	8,979,200		
三ツ星ベルト	7,700	1,785.00	13,744,500	貸付株式数	400株
バンドー化学	11,000	864.00	9,504,000		
ＡＧＣ	59,700	4,850.00	289,545,000		
日本板硝子	34,100	614.00	20,937,400		
石塚硝子	1,000	1,945.00	1,945,000	貸付株式数	400株
有沢製作所	9,000	926.00	8,334,000	貸付株式数	3,300株
日本山村硝子	2,400	934.00	2,241,600		
日本電気硝子	24,100	2,741.00	66,058,100		
オハラ	2,700	1,534.00	4,141,800	貸付株式数	1,000株
住友大阪セメント	11,600	3,020.00	35,032,000		
太平洋セメント	38,400	2,472.00	94,924,800		
リソルホールディングス	700	4,180.00	2,926,000		
日本ヒユーム	5,600	735.00	4,116,000		
日本コンクリート	14,600	339.00	4,949,400		
三谷セキサン	3,000	4,225.00	12,675,000		
アジアパイルＨＤ	9,600	502.00	4,819,200		
東海カーボン	63,800	1,665.00	106,227,000		
日本カーボン	3,700	4,445.00	16,446,500	貸付株式数	1,400株
東洋炭素	3,900	2,710.00	10,569,000	貸付株式数	1,400株
ノリタケ	3,600	4,275.00	15,390,000	貸付株式数	100株
ＴＯＴＯ	46,400	5,880.00	272,832,000		
日本碍子	71,000	2,051.00	145,621,000		
日本特殊陶業	49,500	1,715.00	84,892,500		
ダントーホールディングス	5,700	291.00	1,658,700	貸付株式数	200株
ＭＡＲＵＷＡ	2,300	10,910.00	25,093,000	貸付株式数	200株

品川リフラクトリーズ	1,500	3,650.00	5,475,000		
黒崎播磨	1,100	4,480.00	4,928,000		
ヨータイ	4,700	1,156.00	5,433,200		
イソライト	2,900	617.00	1,789,300		
東京窯業	7,700	319.00	2,456,300		
ニッカトー	2,900	708.00	2,053,200		
フジミインコーポレーテッド	5,300	5,160.00	27,348,000		
クニミネ工業	2,200	1,150.00	2,530,000		
エーアンドエーマテリアル	900	1,028.00	925,200		
ニチアス	16,400	2,843.00	46,625,200	貸付株式数	2,400株
日本製鉄	306,700	1,922.00	589,477,400		
神戸製鋼所	118,100	711.00	83,969,100		
中山製鋼所	8,400	437.00	3,670,800		
合同製鐵	3,400	1,706.00	5,800,400		
ＪＦＥホールディングス	185,700	1,340.00	248,838,000		
東京製鐵	25,400	1,110.00	28,194,000		
共英製鋼	7,200	1,459.00	10,504,800		
大和工業	13,700	3,780.00	51,786,000		
東京鐵鋼	2,700	1,607.00	4,338,900		
大阪製鐵	3,300	1,140.00	3,762,000	貸付株式数	100株
淀川製鋼所	8,400	2,300.00	19,320,000	貸付株式数	400株
丸一鋼管	20,800	2,716.00	56,492,800		
モリ工業	1,900	2,412.00	4,582,800		
大同特殊鋼	10,500	5,290.00	55,545,000	貸付株式数	4,100株
日本高周波	2,300	413.00	949,900		
日本冶金工	4,900	2,342.00	11,475,800		
山陽特殊製鋼	7,600	1,645.00	12,502,000	貸付株式数	1,200株
愛知製鋼	3,500	3,195.00	11,182,500	貸付株式数	200株
日立金属	61,100	2,122.00	129,654,200		
日本金属	1,700	977.00	1,660,900	貸付株式数	500株
大平洋金属	4,500	1,810.00	8,145,000		
新日本電工	43,000	320.00	13,760,000		
栗本鉄工所	2,900	1,700.00	4,930,000		
虹　技	800	1,228.00	982,400	貸付株式数	100株
日本鋳鉄管	700	1,341.00	938,700		
日本製鋼所	19,600	2,985.00	58,506,000		
三菱製鋼	5,000	927.00	4,635,000		
日亜鋼業	8,800	304.00	2,675,200		
日本精線	1,000	4,560.00	4,560,000	貸付株式数	100株

エンビプロＨＤ	3,100	1,228.00	3,806,800	貸付株式数	1,000株
大紀アルミニウム	9,800	1,188.00	11,642,400	貸付株式数	1,900株
日本軽金属ＨＤ	17,300	1,885.00	32,610,500		
三井金属	17,300	3,175.00	54,927,500		
東邦亜鉛	3,600	1,980.00	7,128,000		
三菱マテリアル	42,100	2,268.00	95,482,800		
住友鉱山	82,100	4,863.00	399,252,300		
ＤＯＷＡホールディングス	16,200	4,430.00	71,766,000		
古河機金	10,300	1,290.00	13,287,000		
エス・サイエンス	35,400	38.00	1,345,200	貸付株式数	7,000株
大阪チタニウム	6,700	854.00	5,721,800	貸付株式数	2,600株
東邦チタニウム	11,800	962.00	11,351,600	貸付株式数	1,900株
ＵＡＣＪ	9,700	2,505.00	24,298,500		
ＣＫサンエツ	1,300	3,440.00	4,472,000	貸付株式数	500株
古河電工	20,000	2,959.00	59,180,000		
住友電工	223,100	1,749.50	390,313,450		
フジクラ	78,100	482.00	37,644,200		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	6,300	1,665.00	10,489,500		
東京特殊電線	700	2,551.00	1,785,700	貸付株式数	400株
タツタ電線	11,600	579.00	6,716,400		
カナレ電気	900	1,800.00	1,620,000	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	3,600	1,237.00	4,453,200		
リョービ	7,700	1,683.00	12,959,100		
アーレステイ	8,100	492.00	3,985,200		
アサヒＨＤ	24,500	2,303.00	56,423,500	貸付株式数	1,800株
東洋製罐グループＨＤ	40,500	1,526.00	61,803,000		
ホッカンホールディングス	3,100	1,427.00	4,423,700		
コロナ	3,700	940.00	3,478,000		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	11,100	2,117.00	23,498,700		
駒井ハルテック	1,400	1,760.00	2,464,000		
高田機工	600	2,697.00	1,618,200	貸付株式数	100株
三和ホールディングス	60,500	1,339.00	81,009,500		
文化シヤッター	19,000	1,083.00	20,577,000		
三協立山	8,200	781.00	6,404,200		
アルインコ	4,100	996.00	4,083,600	貸付株式数	100株
東洋シヤッター	1,500	680.00	1,020,000		
ＬＩＸＩＬ	88,600	2,884.00	255,522,400		
日本フイルコン	4,200	498.00	2,091,600		
ノーリツ	13,200	1,868.00	24,657,600		
長府製作所	6,500	2,025.00	13,162,500	貸付株式数	100株

リンナイ	12,500	10,470.00	130,875,000		
ユニプレス	10,600	1,019.00	10,801,400		
ダイニチ工業	3,800	789.00	2,998,200		
日東精工	8,600	555.00	4,773,000		
三洋工業	700	1,881.00	1,316,700		
岡　部	12,200	662.00	8,076,400	貸付株式数	1,700株
ジーテクト	7,900	1,569.00	12,395,100		
東　プ　レ	11,900	1,697.00	20,194,300		
高周波熱錬	11,800	613.00	7,233,400	貸付株式数	500株
東京製綱	2,900	1,261.00	3,656,900		
サンコール	5,400	463.00	2,500,200	貸付株式数	2,100株
モリテックスチル	5,400	533.00	2,878,200	貸付株式数	2,100株
パイオラックス	9,300	1,527.00	14,201,100		
エイチワン	6,200	826.00	5,121,200		
日本発条	63,400	942.00	59,722,800		
中央発條	3,400	1,270.00	4,318,000	貸付株式数	1,000株
アドバネクス	900	1,384.00	1,245,600	貸付株式数	300株
三浦工業	27,800	5,090.00	141,502,000		
タ　ク　マ	22,200	1,810.00	40,182,000		
テクノプロ・ホールディング	12,400	7,910.00	98,084,000		
アトラグループ	1,800	346.00	622,800	貸付株式数	600株
インターワークス	1,500	430.00	645,000		
アイ・アールジャパンＨＤ	2,600	12,840.00	33,384,000		
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,200	2,813.00	11,814,600	貸付株式数	1,500株
ファーストロジック	1,900	717.00	1,362,300	貸付株式数	400株
三機サービス	1,500	1,047.00	1,570,500	貸付株式数	400株
Ｇｕｎｏｓｙ	4,500	917.00	4,126,500		
デザインワン・ジャパン	3,400	229.00	778,600	貸付株式数	600株
イー・ガーディアン	3,200	2,631.00	8,419,200		
リブセンス	6,500	221.00	1,436,500	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
ジャパンマテリアル	18,800	1,347.00	25,323,600	貸付株式数	1,100株
ベクトル	7,900	904.00	7,141,600		
ウチヤマホールディングス	3,000	398.00	1,194,000		
チャームケアコーポレーション	5,000	1,137.00	5,685,000		
キャリアリンク	2,200	2,166.00	4,765,200	貸付株式数	800株
ＩＢＪ	5,400	1,116.00	6,026,400	貸付株式数	2,000株
アサンテ	2,300	1,782.00	4,098,600		

バリューＨＲ	2,600	1,673.00	4,349,800	貸付株式数	900株
M&Aキャピタルパートナー	5,200	4,750.00	24,700,000	貸付株式数	1,000株
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,600	1,491.00	3,876,600	貸付株式数	900株
ＥＲＩホールディングス	1,500	596.00	894,000	貸付株式数	500株
アビスト	1,000	2,995.00	2,995,000	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	3,600	2,145.00	7,722,000		
ウィルグループ	4,600	987.00	4,540,200	貸付株式数	1,800株
エスクローＡＪ	9,900	243.00	2,405,700		
リクルートホールディングス	444,800	5,707.00	2,538,473,600		
エラン	9,000	1,322.00	11,898,000		
ツ　ガ　ミ	13,600	1,728.00	23,500,800		
オークマ	7,400	5,630.00	41,662,000		
芝浦機械	6,700	2,585.00	17,319,500		
アマダ	94,000	1,168.00	109,792,000		
アイダエンジニア	16,200	889.00	14,401,800		
滝澤鉄工所	1,800	1,138.00	2,048,400		
ＦＵＪＩ	25,700	2,695.00	69,261,500		
牧野フライス	7,500	4,495.00	33,712,500	貸付株式数	1,100株
オーエスジー	31,400	1,969.00	61,826,600		
ダイジェット	700	1,340.00	938,000		
旭ダイヤモンド	16,300	529.00	8,622,700		
ＤＭＧ森精機	41,100	1,980.00	81,378,000	貸付株式数	5,700株
ソディツク	15,900	1,159.00	18,428,100		
ディスコ	8,700	34,050.00	296,235,000		
日東工器	3,200	1,923.00	6,153,600		
日進工具	5,100	1,491.00	7,604,100	貸付株式数	600株
パンチ工業	5,400	679.00	3,666,600		
冨士ダイス	2,800	650.00	1,820,000		
土木管理総合試験	2,700	376.00	1,015,200	貸付株式数	1,000株
ネットマーケティング	4,300	404.00	1,737,200	貸付株式数	300株
日本郵政	468,300	920.50	431,070,150		
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	10,400	1,726.00	17,950,400	貸付株式数	3,700株
鎌倉新書	6,600	1,200.00	7,920,000	貸付株式数	2,400株 (1,900株)
ＳＭＮ	1,900	807.00	1,533,300	貸付株式数	500株

一蔵	900	440.00	396,000		
グローバルキッズＣＯＭＰ	1,300	996.00	1,294,800		
エアトリ	4,200	2,797.00	11,747,400		
アトラエ	4,400	2,035.00	8,954,000		
ストライク	2,400	4,135.00	9,924,000	貸付株式数	900株
ソラスト	15,600	1,271.00	19,827,600		
セラク	2,200	2,040.00	4,488,000	貸付株式数	700株
インソース	6,300	2,140.00	13,482,000		
豊田自動織機	52,500	9,730.00	510,825,000		
豊和工業	3,800	808.00	3,070,400		
ＯＫＫ	2,600	392.00	1,019,200		
石川製作所	1,800	1,691.00	3,043,800	貸付株式数	600株
東洋機械金属	3,900	551.00	2,148,900		
津田駒工業	1,200	900.00	1,080,000		
エンシュウ	1,400	914.00	1,279,600		
島精機製作所	9,300	2,124.00	19,753,200	貸付株式数	3,700株
オプトラン	8,100	2,629.00	21,294,900	貸付株式数	1,000株
ＮＣホールディングス	2,100	1,059.00	2,223,900		
イワキポンプ	4,000	1,012.00	4,048,000		
フリュー	6,500	1,178.00	7,657,000		
ヤマシンフィルタ	13,300	778.00	10,347,400	貸付株式数	5,100株
日阪製作所	8,000	819.00	6,552,000		
やまびこ	12,500	1,211.00	15,137,500		
平田機工	3,000	6,570.00	19,710,000	貸付株式数	100株
ペガサスミシン製造	6,300	507.00	3,194,100		
マルマエ	2,700	2,109.00	5,694,300	貸付株式数	900株
タツモ	2,800	1,701.00	4,762,800	貸付株式数	1,100株
ナブテスコ	37,800	5,100.00	192,780,000	貸付株式数	15,600株
三井海洋開発	6,800	2,262.00	15,381,600		
レオン自動機	6,300	1,349.00	8,498,700	貸付株式数	1,000株
ＳＭＣ	19,000	66,370.00	1,261,030,000		
ホソカワミクロン	2,300	6,050.00	13,915,000		
ユニオンツール	2,400	3,990.00	9,576,000	貸付株式数	900株
オイレス工業	8,900	1,559.00	13,875,100	貸付株式数	3,500株
日精エーエスビー	2,100	5,450.00	11,445,000		
サト－ホールディングス	8,500	2,570.00	21,845,000		
技研製作所	5,700	4,585.00	26,134,500		
日本エアーテック	2,300	1,340.00	3,082,000	貸付株式数	300株
カ　ワ　タ	1,800	907.00	1,632,600		
日精樹脂工業	5,000	1,301.00	6,505,000		

オカダアイヨン	2,100	1,315.00	2,761,500		
ワイエイシイホールディングス	2,800	1,094.00	3,063,200	貸付株式数	1,000株
小松製作所	294,100	3,126.00	919,356,600		
住友重機械	37,100	3,445.00	127,809,500		
日立建機	30,400	3,560.00	108,224,000		
日　工	10,000	698.00	6,980,000		
巴工業	2,500	2,215.00	5,537,500		
井関農機	6,200	1,455.00	9,021,000		
ＴＯＷＡ	6,100	2,266.00	13,822,600	貸付株式数	1,300株
丸山製作所	1,300	1,802.00	2,342,600		
北川鉄工所	2,700	1,805.00	4,873,500		
シンニッタン	8,500	267.00	2,269,500	貸付株式数	2,600株
ローツェ	2,900	10,220.00	29,638,000	貸付株式数	1,100株
タカキタ	2,200	638.00	1,403,600	貸付株式数	300株
クボタ	341,500	2,458.00	839,407,000		
荏原実業	1,700	6,380.00	10,846,000		
東洋エンジニア	9,000	736.00	6,624,000	貸付株式数	3,400株
三菱化工機	2,200	2,823.00	6,210,600	貸付株式数	800株
月島機械	11,600	1,181.00	13,699,600		
帝国電機製作所	4,500	1,296.00	5,832,000		
東京機械	3,400	747.00	2,539,800	貸付株式数	800株
新東工業	14,600	793.00	11,577,800		
渋谷工業	5,600	3,405.00	19,068,000	貸付株式数	100株
アイチ　コーポレーション	11,000	889.00	9,779,000	貸付株式数	2,000株
小森コーポレーション	16,100	803.00	12,928,300		
鶴見製作所	4,900	1,755.00	8,599,500		
住友精密	900	2,492.00	2,242,800		
日本ギア工業	2,400	326.00	782,400	貸付株式数	700株
酒井重工業	1,100	2,502.00	2,752,200		
荏原製作所	27,000	5,630.00	152,010,000		
石井鉄工所	900	3,010.00	2,709,000	貸付株式数	200株
酉島製作所	6,600	906.00	5,979,600		
北越工業	6,700	1,168.00	7,825,600		
ダイキン工業	82,800	21,180.00	1,753,704,000		
オルガノ	2,200	6,400.00	14,080,000		
トーヨーカネツ	2,500	2,474.00	6,185,000		
栗田工業	35,200	5,220.00	183,744,000	貸付株式数	6,800株
椿本チエイン	9,100	3,270.00	29,757,000	貸付株式数	2,200株
大同工業	3,000	1,029.00	3,087,000		

日　機　装	21,100	1,177.00	24,834,700		
木村化工機	5,800	902.00	5,231,600	貸付株式数	2,100株
レイズネクスト	10,500	1,171.00	12,295,500		
アネスト岩田	10,700	1,073.00	11,481,100	貸付株式数	600株
ダイフク	35,800	9,360.00	335,088,000	貸付株式数	14,300株
サムコ	1,700	3,250.00	5,525,000	貸付株式数	700株
加藤製作所	3,400	1,014.00	3,447,600		
油研工業	900	1,736.00	1,562,400	貸付株式数	100株
タダノ	31,600	1,147.00	36,245,200		
フジテック	22,700	2,478.00	56,250,600	貸付株式数	8,800株
ＣＫＤ	15,100	2,566.00	38,746,600		
キトー	5,400	1,811.00	9,779,400		
平和	17,900	1,890.00	33,831,000	貸付株式数	7,100株
理想科学工業	5,000	1,807.00	9,035,000	貸付株式数	800株
ＳＡＮＫＹＯ	15,600	2,751.00	42,915,600		
日本金銭機械	6,600	576.00	3,801,600		
マースグループＨＬＤＧＳ	3,800	1,630.00	6,194,000		
フクシマガリレイ	4,400	4,400.00	19,360,000		
オーイズミ	2,300	381.00	876,300		
ダイコク電機	2,600	912.00	2,371,200		
竹内製作所	11,200	2,902.00	32,502,400		
ア　マ　ノ	17,000	2,884.00	49,028,000		
ＪＵＫＩ	9,200	783.00	7,203,600		
サンデンホールディングス	9,100	382.00	3,476,200	貸付株式数	2,600株
蛇の目ミシン	6,200	810.00	5,022,000	貸付株式数	2,300株
ブラザー工業	79,600	2,332.00	185,627,200		
マックス	8,700	1,679.00	14,607,300		
モリタホールディングス	10,200	1,601.00	16,330,200		
グローリー	16,700	2,356.00	39,345,200		
新晃工業	6,200	1,904.00	11,804,800	貸付株式数	100株
大和冷機工業	10,600	1,073.00	11,373,800		
セガサミーホールディングス	59,300	1,425.00	84,502,500		
日本ピストンリング	2,400	1,392.00	3,340,800		
リ　ケ　ン	2,900	2,712.00	7,864,800	貸付株式数	1,100株
ＴＰＲ	8,500	1,547.00	13,149,500	貸付株式数	3,300株
ツバキ・ナカシマ	12,800	1,844.00	23,603,200	貸付株式数	3,700株
ホシザキ	20,500	10,050.00	206,025,000		
大豊工業	5,600	1,126.00	6,305,600		
日本精工	132,800	1,062.00	141,033,600		

ＮＴＮ	151,200	318.00	48,081,600	貸付株式数	52,800株
ジェイテクト	62,000	1,244.00	77,128,000		
不二越	5,900	4,190.00	24,721,000		
ミネベアミツミ	111,600	2,989.00	333,572,400		
日本トムソン	18,600	623.00	11,587,800		
ＴＨＫ	40,400	3,610.00	145,844,000	貸付株式数	16,000株
ユーシン精機	4,300	833.00	3,581,900		
前澤給装工業	4,700	1,082.00	5,085,400		
イーグル工業	8,100	1,152.00	9,331,200		
前澤工業	4,500	603.00	2,713,500	貸付株式数	200株
日本ピラー工業	6,800	2,220.00	15,096,000	貸付株式数	2,600株
キッツ	19,800	777.00	15,384,600		
日立	312,300	6,080.00	1,898,784,000		
東芝	128,700	4,645.00	597,811,500		
三菱電機	648,500	1,809.50	1,173,460,750		
富士電機	39,300	5,330.00	209,469,000		
東洋電機製造	2,400	1,196.00	2,870,400		
安川電機	69,900	5,310.00	371,169,000		
シンフォニア テクノロジー	8,500	1,321.00	11,228,500	貸付株式数	3,100株
明電舎	11,100	2,361.00	26,207,100		
オリジン	1,600	1,329.00	2,126,400	貸付株式数	400株
山洋電気	3,100	8,000.00	24,800,000		
デンヨー	5,500	2,017.00	11,093,500		
ベイカレントコンサルティング	4,100	37,800.00	154,980,000		
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ ＨＬＤＧＳ	1,600	2,910.00	4,656,000	貸付株式数	500株
アイモバイル	2,600	1,368.00	3,556,800	貸付株式数	400株
キャリアインデックス	3,200	715.00	2,288,000	貸付株式数	500株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2,700	1,031.00	2,783,700	貸付株式数	1,000株
船場	900	828.00	745,200		
グレイステクノロジー	6,700	1,829.00	12,254,300	貸付株式数	2,500株
ジャパンエレベーターＳＨＤ	18,200	2,372.00	43,170,400		
フルテック	900	1,396.00	1,256,400	貸付株式数	300株
グリーンズ	2,800	650.00	1,820,000		
ツナググループＨＬＤＧＳ	1,000	346.00	346,000	貸付株式数	400株
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	1,800	617.00	1,110,600	貸付株式数	100株
ソウルドアウト	1,500	1,714.00	2,571,000	貸付株式数	500株

ＭＳ＆ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	1,100	631.00	694,100		
ミダック	1,400	6,320.00	8,848,000		
日総工産	5,000	837.00	4,185,000	貸付株式数	1,300株
キュービーネットＨＬＤＧＳ	3,000	1,918.00	5,754,000	貸付株式数	300株
ＲＰＡホールディングス	7,300	767.00	5,599,100	貸付株式数	2,800株
三桜工業	9,200	1,246.00	11,463,200		
マキタ	84,700	5,130.00	434,511,000	貸付株式数	3,200株
東芝テック	7,000	4,490.00	31,430,000		
芝浦メカトロニクス	1,200	7,970.00	9,564,000		
マブチモーター	17,900	4,405.00	78,849,500	貸付株式数	200株
日本電産	156,400	12,520.00	1,958,128,000	貸付株式数	11,000株
ユーエムシーエレクトロニクス	3,900	736.00	2,870,400		
トレックス・セミコンダクター	3,600	2,263.00	8,146,800		
東光高岳	3,400	1,448.00	4,923,200	貸付株式数	1,300株
ダブル・スコープ	15,500	650.00	10,075,000	貸付株式数	5,100株
宮越ホールディングス	2,700	1,086.00	2,932,200	貸付株式数	900株
ダイヘン	7,300	5,050.00	36,865,000		
ヤーマン	10,900	1,509.00	16,448,100		
ＪＶＣケンウッド	56,800	231.00	13,120,800	貸付株式数	22,500株
ミマキエンジニアリング	6,000	716.00	4,296,000		
Ｉ－ＰＥＸ	3,000	2,651.00	7,953,000		
日新電機	15,200	1,344.00	20,428,800		
大崎電気	13,200	617.00	8,144,400	貸付株式数	4,100株
オムロン	54,000	8,570.00	462,780,000		
日東工業	9,500	1,829.00	17,375,500	貸付株式数	1,600株
ＩＤＥＣ	8,800	2,141.00	18,840,800	貸付株式数	2,100株
正興電機製作所	2,200	1,676.00	3,687,200	貸付株式数	600株
不二電機工業	1,000	1,279.00	1,279,000		
ジーエス・ユアサ　コーポ	23,400	3,055.00	71,487,000		
サクサホールディングス	1,500	1,399.00	2,098,500	貸付株式数	100株
メルコホールディングス	2,300	4,895.00	11,258,500		
テクノメディカ	1,400	1,631.00	2,283,400		
ダイヤモンドエレクトリクＨＤ	1,900	2,949.00	5,603,100	貸付株式数	700株
日本電気	82,600	5,080.00	419,608,000		
富　士　通	58,400	18,620.00	1,087,408,000		

沖　電　気	26,200	1,002.00	26,252,400		
岩崎通信機	2,900	950.00	2,755,000		
電気興業	3,100	2,349.00	7,281,900		
サンケン電気	7,500	5,220.00	39,150,000		
ナカヨ	1,100	1,475.00	1,622,500		
アイホン	3,800	2,092.00	7,949,600		
ルネサスエレクトロニクス	279,600	1,245.00	348,102,000		
セイコーエプソン	80,600	1,985.00	159,991,000		
ワコム	47,800	657.00	31,404,600	貸付株式数	18,800株
アルバック	12,000	5,410.00	64,920,000		
アクセル	2,600	918.00	2,386,800		
ＥＩＺＯ	5,500	5,190.00	28,545,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	40.00	2,468,000		
日本信号	14,900	938.00	13,976,200		
京三製作所	13,400	427.00	5,721,800		
能美防災	8,500	2,016.00	17,136,000		
ホーチキ	4,500	1,200.00	5,400,000		
星和電機	3,400	562.00	1,910,800		
エレコム	15,000	2,085.00	31,275,000		
パナソニック	693,000	1,267.50	878,377,500		
シャープ	86,500	2,020.00	174,730,000	貸付株式数	34,300株
アンリツ	39,400	2,066.00	81,400,400	貸付株式数	15,500株
富士通ゼネラル	20,100	2,678.00	53,827,800		
ソニーグループ ※	407,200	10,850.00	4,418,120,000		
Ｔ　Ｄ　Ｋ	31,300	14,420.00	451,346,000		
帝国通信工業	2,700	1,181.00	3,188,700	貸付株式数	500株
タムラ製作所	23,000	597.00	13,731,000	貸付株式数	1,200株
アルプスアルパイン	53,000	1,217.00	64,501,000		
池上通信機	2,200	826.00	1,817,200		
日本電波工業	6,500	950.00	6,175,000	貸付株式数	2,300株
鈴木	2,900	1,029.00	2,984,100	貸付株式数	1,100株
日本トリム	1,600	3,685.00	5,896,000		
ローランド　ディー.ジー.	3,800	2,509.00	9,534,200	貸付株式数	1,100株
フオスター電機	6,600	1,036.00	6,837,600	貸付株式数	1,900株
Ｓ　Ｍ　Ｋ	1,600	2,595.00	4,152,000	貸付株式数	600株
ヨコオ	5,100	2,345.00	11,959,500		
ティアック	5,200	130.00	676,000	貸付株式数	600株
ホシデン	18,000	1,011.00	18,198,000		
ヒロセ電機	10,000	16,370.00	163,700,000		

日本航空電子	14,800	1,950.00	28,860,000		
Ｔ　Ｏ　Ａ	7,400	892.00	6,600,800		
マクセルホールディングス	12,900	1,242.00	16,021,800		
古野電気	8,300	1,023.00	8,490,900	貸付株式数	1,100株
ユニデンホールディングス	1,800	2,479.00	4,462,200		
スミダコーポレーション	5,500	1,096.00	6,028,000		
アイコム	2,800	2,395.00	6,706,000		
リオン	2,900	2,647.00	7,676,300		
本多通信工業	4,400	486.00	2,138,400	貸付株式数	1,700株
横河電機	64,900	1,746.00	113,315,400		
新電元工業	2,500	4,185.00	10,462,500		
アズビル	44,200	4,270.00	188,734,000		
東亜ディーケーケー	2,800	824.00	2,307,200		
日本光電工業	26,900	3,140.00	84,466,000		
チ　ノ　ー	1,800	1,492.00	2,685,600		
共和電業	6,100	390.00	2,379,000		
日本電子材料	2,800	2,042.00	5,717,600	貸付株式数	900株
堀場製作所	12,900	7,310.00	94,299,000		
アドバンテスト	48,400	10,220.00	494,648,000		
小野測器	2,500	569.00	1,422,500	貸付株式数	200株
エスペック	5,500	2,078.00	11,429,000		
キーエンス	63,800	54,500.00	3,477,100,000		
日置電機	3,200	5,690.00	18,208,000	貸付株式数	1,200株
シスメックス	50,800	10,775.00	547,370,000		
日本マイクロニクス	11,300	1,629.00	18,407,700		
メガチップス	6,500	3,435.00	22,327,500	貸付株式数	800株
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,700	4,000.00	14,800,000	貸付株式数	1,400株
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	5,400	492.00	2,656,800	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
澤藤電機	800	2,228.00	1,782,400	貸付株式数	300株
デンソー	142,900	7,857.00	1,122,765,300		
原田工業	2,700	902.00	2,435,400	貸付株式数	1,100株
コーセル	7,900	1,088.00	8,595,200		
イリソ電子工業	5,500	5,020.00	27,610,000	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	10,800	1,952.00	21,081,600		
千代田インテグレ	2,700	1,838.00	4,962,600		
アイ・オー・データ	2,400	1,090.00	2,616,000		
レーザーテック	28,600	22,780.00	651,508,000		
スタンレー電気	45,100	3,290.00	148,379,000		
岩崎電気	2,400	1,847.00	4,432,800		

ウシオ電機	33,200	1,700.00	56,440,000		
岡谷電機	4,600	357.00	1,642,200	貸付株式数	1,800株
ヘリオステクノＨ	6,200	358.00	2,219,600		
エノモト	1,900	1,785.00	3,391,500		
日本セラミック	6,600	2,993.00	19,753,800		
遠藤照明	3,300	790.00	2,607,000		
古河電池	4,800	1,610.00	7,728,000	貸付株式数	1,900株
双信電機	3,300	579.00	1,910,700	貸付株式数	1,200株
山一電機	4,200	1,727.00	7,253,400		
図　研	4,400	3,050.00	13,420,000		
日本電子	12,000	6,020.00	72,240,000		
カ　シ　オ	52,400	1,951.00	102,232,400		
ファナック	57,000	26,010.00	1,482,570,000		
日本シイエムケイ	13,900	451.00	6,268,900	貸付株式数	5,500株
エンプラス	3,000	4,085.00	12,255,000	貸付株式数	1,100株
大真空	2,300	3,660.00	8,418,000		
ロ　ー　ム	26,900	10,360.00	278,684,000		
浜松ホトニクス	46,600	6,760.00	315,016,000		
三井ハイテック	6,400	4,420.00	28,288,000	貸付株式数	1,500株
新光電気工業	22,000	3,790.00	83,380,000		
京　セ　ラ	98,700	6,844.00	675,502,800		
協栄産業	700	1,383.00	968,100	貸付株式数	100株
太陽誘電	29,000	5,420.00	157,180,000		
村田製作所	190,700	8,542.00	1,628,959,400		
双葉電子工業	10,700	822.00	8,795,400		
日東電工	41,400	8,630.00	357,282,000		
北陸電気工業	2,200	1,032.00	2,270,400		
東海理化電機	16,800	1,820.00	30,576,000		
ニチコン	20,900	1,183.00	24,724,700	貸付株式数	8,200株
日本ケミコン	6,700	2,499.00	16,743,300		
ＫＯＡ	9,100	1,642.00	14,942,200		
三井Ｅ＆ＳＨＤ	21,700	527.00	11,435,900		
日立造船	52,900	729.00	38,564,100	貸付株式数	700株
三菱重工業	101,800	3,535.00	359,863,000		
川崎重工業	50,700	2,677.00	135,723,900		
ＩＨＩ	43,600	2,922.00	127,399,200		
名村造船所	21,900	172.00	3,766,800	貸付株式数	1,300株
サノヤスホールディングス	9,800	148.00	1,450,400		
スプリックス	2,000	1,268.00	2,536,000	貸付株式数	500株

マネジメントソリューションズ	3,200	1,989.00	6,364,800	貸付株式数	1,100株
プロレド・パートナーズ	1,100	3,010.00	3,311,000	貸付株式数	300株
ＡＮＤ　ＦＡＣＴＯＲＹ	1,100	704.00	774,400	貸付株式数	200株
ギークス	1,200	1,830.00	2,196,000	貸付株式数	200株
カーブスホールディングス	17,300	937.00	16,210,100	貸付株式数	600株
フォーラムエンジニアリング	4,300	966.00	4,153,800		
日本車輌	2,200	2,237.00	4,921,400		
三菱ロジスネクスト	8,800	1,071.00	9,424,800	貸付株式数	3,400株
近畿車輌	1,000	1,290.00	1,290,000	貸付株式数	200株
ＦＰＧ	21,700	808.00	17,533,600	貸付株式数	4,900株
島根銀行	3,000	647.00	1,941,000		
じもとホールディングス	4,300	644.00	2,769,200		
全国保証	16,700	4,675.00	78,072,500	貸付株式数	6,600株
めぶきフィナンシャルＧ	333,400	236.00	78,682,400		
東京きらぼしＦＧ	8,100	1,414.00	11,453,400		
九州フィナンシャルＧ	129,800	410.00	53,218,000		
かんぽ生命保険	79,600	2,226.00	177,189,600		
ゆうちょ銀行	180,400	929.00	167,591,600	貸付株式数	72,800株
富山第一銀行	14,700	275.00	4,042,500		
コンコルディア・フィナンシャル	388,300	411.00	159,591,300		
ジェイリース	2,500	1,120.00	2,800,000	貸付株式数	800株
西日本フィナンシャルＨＤ	42,500	665.00	28,262,500		
マーキュリアインベストメント	3,100	750.00	2,325,000		
イントラスト	2,100	725.00	1,522,500	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	3,600	982.00	3,535,200		
Ｃａｓａ	2,100	970.00	2,037,000	貸付株式数	900株
アルヒ	9,700	1,540.00	14,938,000	貸付株式数	3,700株
プレミアグループ	3,200	3,325.00	10,640,000		
日産自動車	765,100	558.10	427,002,310		
いすゞ自動車	187,500	1,520.00	285,000,000		
トヨタ自動車 ※	658,300	9,917.00	6,528,361,100		
日野自動車	81,100	1,029.00	83,451,900		
三菱自動車工業	240,200	319.00	76,623,800	貸付株式数	96,500株
エフテック	4,600	878.00	4,038,800		
レシップホールディングス	2,900	582.00	1,687,800		
ＧＭＢ	1,500	1,026.00	1,539,000	貸付株式数	400株

ファルテック	1,300	788.00	1,024,400		
武蔵精密工業	14,700	2,465.00	36,235,500		
日産車体	9,300	735.00	6,835,500	貸付株式数	3,800株
新明和工業	18,200	996.00	18,127,200	貸付株式数	4,100株
極東開発工業	11,200	1,757.00	19,678,400	貸付株式数	400株
トピー工業	5,300	1,391.00	7,372,300		
ティラド	2,100	2,927.00	6,146,700		
タチエス	10,000	1,443.00	14,430,000		
ＮＯＫ	31,300	1,429.00	44,727,700		
フタバ産業	15,800	541.00	8,547,800		
ＫＹＢ	7,400	4,110.00	30,414,000	貸付株式数	100株
市光工業	9,800	743.00	7,281,400		
大同メタル工業	13,000	616.00	8,008,000		
プレス工業	31,200	360.00	11,232,000		
ミクニ	7,900	310.00	2,449,000		
太平洋工業	13,600	1,176.00	15,993,600	貸付株式数	3,400株
河西工業	9,400	419.00	3,938,600	貸付株式数	3,500株
アイシン	47,400	4,905.00	232,497,000		
マツダ	203,400	1,018.00	207,061,200		
今仙電機製作所	5,600	749.00	4,194,400		
本田技研 ※	511,000	3,590.00	1,834,490,000		
スズキ	128,700	4,832.00	621,878,400		
ＳＵＢＡＲＵ	185,600	2,228.00	413,516,800		
安永	3,200	1,211.00	3,875,200	貸付株式数	1,300株
ヤマハ発動機	92,000	3,290.00	302,680,000		
小糸製作所	38,800	7,300.00	283,240,000		
ＴＢＫ	7,400	420.00	3,108,000	貸付株式数	1,900株
エクセディ	8,800	1,738.00	15,294,400		
ミツバ	12,000	956.00	11,472,000	貸付株式数	700株
豊田合成	21,000	2,734.00	57,414,000		
愛三工業	10,200	920.00	9,384,000		
盟和産業	1,100	978.00	1,075,800	貸付株式数	300株
日本プラスト	5,100	757.00	3,860,700		
ヨロズ	5,500	1,302.00	7,161,000	貸付株式数	300株
エフ・シー・シー	10,500	1,754.00	18,417,000		
新家工業	1,600	1,664.00	2,662,400		
シマノ	24,400	24,085.00	587,674,000		
テイ・エス　テック	29,800	1,654.00	49,289,200		
３３ＦＧ	5,500	1,362.00	7,491,000	貸付株式数	200株
第四北越フィナンシャルＧ	10,300	2,382.00	24,534,600		

ひろぎんＨＬＤＧＳ	95,100	586.00	55,728,600	貸付株式数	27,100株
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,700	5,380.00	14,526,000		
ジャムコ	4,000	1,080.00	4,320,000	貸付株式数	1,500株 (1,200株)
小　野　建	5,500	1,322.00	7,271,000	貸付株式数	2,200株
はるやまＨＬＤＧＳ	2,300	676.00	1,554,800	貸付株式数	400株
南　陽	1,200	1,919.00	2,302,800		
ノ　ジ　マ	11,400	3,015.00	34,371,000		
佐鳥電機	4,000	777.00	3,108,000		
カッパ・クリエイト	8,900	1,466.00	13,047,400	貸付株式数	3,300株
エコートレーディング	1,700	627.00	1,065,900		
伯東	4,200	1,583.00	6,648,600		
コンドーテック	4,800	1,010.00	4,848,000		
中山福	4,100	473.00	1,939,300		
ライトオン	4,600	695.00	3,197,000	貸付株式数	1,800株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,200	2,549.00	20,901,800		
三菱食品	6,800	2,957.00	20,107,600		
良品計画	84,700	2,100.00	177,870,000		
三城ホールディングス	7,900	272.00	2,148,800	貸付株式数	2,800株
松田産業	5,000	2,195.00	10,975,000	貸付株式数	100株
第一興商	12,700	4,260.00	54,102,000	貸付株式数	1,800株
メディパルＨＤ	63,900	2,141.00	136,809,900		
アドヴァン	6,500	950.00	6,175,000		
ＳＰＫ	2,900	1,359.00	3,941,100		
萩原電気ＨＬＤＧＳ	2,400	2,453.00	5,887,200		
アルビス	1,900	2,281.00	4,333,900		
アズワン	4,600	12,200.00	56,120,000		
スズデン	2,200	1,463.00	3,218,600		
尾家産業	2,000	1,245.00	2,490,000	貸付株式数	300株
シモジマ	4,100	1,108.00	4,542,800	貸付株式数	1,400株
ドウシシャ	6,100	1,683.00	10,266,300		
小津産業	1,600	1,919.00	3,070,400		
コナカ	7,800	360.00	2,808,000		
高速	3,500	1,460.00	5,110,000		
ハウス　ローゼ	600	1,630.00	978,000		
Ｇ－７ホールディングス	3,900	2,844.00	11,091,600		
たけびし	2,200	1,565.00	3,443,000	貸付株式数	300株
イオン北海道	8,400	1,023.00	8,593,200	貸付株式数	2,300株
コ　ジ　マ	11,200	776.00	8,691,200	貸付株式数	4,300株

ヒマラヤ	2,200	1,017.00	2,237,400		
コーナン商事	9,200	3,075.00	28,290,000	貸付株式数	3,500株
ネットワンシステムズ	26,200	3,415.00	89,473,000		
エコス	2,400	1,920.00	4,608,000		
ワタミ	8,300	994.00	8,250,200	貸付株式数	3,300株
マルシェ	1,500	515.00	772,500	貸付株式数	600株
リックス	1,300	1,540.00	2,002,000		
システムソフト	18,400	149.00	2,741,600	貸付株式数	3,600株
パンパシフィックＨＤ	127,900	2,250.00	287,775,000		
丸文	5,600	636.00	3,561,600		
西松屋チェーン	14,400	1,498.00	21,571,200	貸付株式数	5,600株
ゼンショーホールディングス	34,200	2,715.00	92,853,000	貸付株式数	12,600株
ハピネット	5,700	1,438.00	8,196,600	貸付株式数	100株
幸楽苑ホールディングス	4,100	1,667.00	6,834,700	貸付株式数	1,000株
ハークスレイ	1,000	1,014.00	1,014,000	貸付株式数	500株
橋本総業ＨＬＤＧＳ	1,400	2,788.00	3,903,200		
日本ライフライン	20,600	1,372.00	28,263,200		
サイゼリヤ	9,500	2,547.00	24,196,500	貸付株式数	200株
タカショー	5,000	799.00	3,995,000	貸付株式数	1,600株
ＶＴホールディングス	24,500	486.00	11,907,000	貸付株式数	9,500株
マルカ	2,100	2,423.00	5,088,300		
アルゴグラフィックス	5,000	3,090.00	15,450,000	貸付株式数	1,800株
魚力	1,900	1,969.00	3,741,100		
ＩＤＯＭ	22,000	621.00	13,662,000		
日本エム・ディ・エム	3,900	2,158.00	8,416,200		
ポプラ	2,800	314.00	879,200	貸付株式数	500株
フジ・コーポレーション	3,400	1,262.00	4,290,800		
ユナイテッドアローズ	7,400	2,262.00	16,738,800	貸付株式数	2,800株
進和	3,800	2,174.00	8,261,200		
エスケイジャパン	2,500	442.00	1,105,000	貸付株式数	600株
ダイトロン	2,700	2,011.00	5,429,700		
ハイデイ日高	9,100	1,813.00	16,498,300	貸付株式数	3,300株
シークス	8,100	1,603.00	12,984,300		
京都きもの友禅	4,300	283.00	1,216,900		
コロワイド	21,200	2,028.00	42,993,600	貸付株式数	8,400株 (1,400株)
ピーシーデポコーポ	7,400	455.00	3,367,000	貸付株式数	3,500株
田中商事	1,700	693.00	1,178,100		
オーハシテクニカ	3,400	1,523.00	5,178,200		

壱番屋	4,400	4,815.00	21,186,000		
白銅	2,100	1,870.00	3,927,000		
トップカルチャー	2,500	344.00	860,000		
ＰＬＡＮＴ	1,600	729.00	1,166,400	貸付株式数	500株
スギホールディングス	12,900	8,440.00	108,876,000		
ダイコー通産	800	1,512.00	1,209,600		
薬王堂ホールディングス	2,800	2,406.00	6,736,800		
島津製作所	83,600	3,940.00	329,384,000		
Ｊ　Ｍ　Ｓ	5,900	854.00	5,038,600	貸付株式数	2,100株
クボテック	1,800	333.00	599,400	貸付株式数	400株
長野計器	4,900	1,175.00	5,757,500		
ブイ・テクノロジー	3,100	5,680.00	17,608,000	貸付株式数	400株
スター精密	10,200	1,875.00	19,125,000		
東京計器	4,100	1,070.00	4,387,000		
愛知時計	700	4,285.00	2,999,500		
インターアクション	3,400	2,429.00	8,258,600		
オーバル	6,600	283.00	1,867,800	貸付株式数	100株
東京精密	11,000	5,570.00	61,270,000		
マニー	25,800	2,454.00	63,313,200	貸付株式数	3,100株
ニコン	99,000	1,199.00	118,701,000		
トプコン	32,800	1,846.00	60,548,800		
オリンパス	359,600	2,385.00	857,646,000		
理研計器	5,800	2,764.00	16,031,200		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	11,300	10,640.00	120,232,000		
キヤノン電子	5,900	1,727.00	10,189,300		
タムロン	5,600	2,499.00	13,994,400	貸付株式数	2,000株
ＨＯＹＡ	127,900	13,970.00	1,786,763,000		
シ　ー　ド	2,300	801.00	1,842,300		
ノーリツ鋼機	6,100	2,340.00	14,274,000		
エー・アンド・デイ	5,700	1,044.00	5,950,800		
朝日インテック	68,500	2,666.00	182,621,000		
キヤノン	322,700	2,597.00	838,051,900	貸付株式数	141,500株
リ　コ　ー	165,500	1,422.00	235,341,000		
シチズン時計	83,100	453.00	37,644,300		
リズム	1,900	790.00	1,501,000		
大研医器	4,800	555.00	2,664,000		
メニコン	10,200	7,080.00	72,216,000	貸付株式数	3,900株
シンシア	1,300	635.00	825,500	貸付株式数	200株 (200株)

中本パックス	1,600	1,601.00	2,561,600	貸付株式数	100株
スノーピーク	4,000	3,280.00	13,120,000	貸付株式数	100株
パラマウントベッドＨＤ	12,200	1,981.00	24,168,200		
トランザクション	3,800	1,415.00	5,377,000	貸付株式数	200株
粧美堂	1,700	422.00	717,400		
ニホンフラッシュ	5,600	1,229.00	6,882,400		
前田工繊	7,300	3,445.00	25,148,500	貸付株式数	2,800株
永大産業	8,600	306.00	2,631,600		
アートネイチャー	6,300	674.00	4,246,200		
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	53,700	7,864.00	422,296,800		
アイフィスジャパン	1,800	720.00	1,296,000		
共立印刷	8,200	141.00	1,156,200	貸付株式数	1,000株
ＳＨＯＥＩ	6,400	3,930.00	25,152,000		
フランスベッドＨＬＤＧＳ	9,000	926.00	8,334,000	貸付株式数	3,400株
マーベラス	10,300	790.00	8,137,000	貸付株式数	2,900株
パイロットコーポレーション	10,900	3,595.00	39,185,500	貸付株式数	1,200株
萩原工業	3,600	1,438.00	5,176,800		
エイベックス	11,400	1,548.00	17,647,200	貸付株式数	4,400株
トッパン・フォームズ	11,500	1,090.00	12,535,000		
フジシールインターナショナル	13,500	2,321.00	31,333,500	貸付株式数	5,200株
タカラトミー	29,800	974.00	29,025,200		
廣済堂	4,800	1,018.00	4,886,400		
エステールホールディングス	4,000	640.00	2,560,000	貸付株式数	700株
レック	7,700	1,185.00	9,124,500		
タカノ	1,900	639.00	1,214,100		
三光合成	7,200	445.00	3,204,000		
プロネクサス	5,300	1,037.00	5,496,100		
ホクシン	6,700	171.00	1,145,700	貸付株式数	1,100株 (500株)
ウッドワン	2,300	1,392.00	3,201,600		
大建工業	4,300	1,955.00	8,406,500		
き　も　と	10,900	257.00	2,801,300		
凸版印刷	98,100	1,942.00	190,510,200		
大日本印刷	77,800	2,468.00	192,010,400		
共同印刷	2,000	2,689.00	5,378,000		
ＮＩＳＳＨＡ	13,300	1,623.00	21,585,900	貸付株式数	2,400株
光村印刷	600	1,714.00	1,028,400	貸付株式数	200株

藤森工業	5,800	4,065.00	23,577,000		
ヴィア・ホールディングス	7,600	207.00	1,573,200	貸付株式数	3,200株
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,300	1,732.00	5,715,600	貸付株式数	1,200株
前澤化成工業	4,300	1,278.00	5,495,400	貸付株式数	1,600株
未来工業	2,300	1,756.00	4,038,800		
アシックス	57,500	2,759.00	158,642,500	貸付株式数	22,800株
ツ　ツ　ミ	2,000	2,340.00	4,680,000		
ウェーブロックＨＬＤＧＳ	2,300	708.00	1,628,400		
ジェイ　エス　ピー	4,200	1,670.00	7,014,000	貸付株式数	1,400株
ニ　チ　ハ	9,000	2,910.00	26,190,000		
エフピコ	12,100	4,100.00	49,610,000	貸付株式数	800株
小松ウオール工業	2,100	1,916.00	4,023,600		
ヤマハ	38,700	6,490.00	251,163,000		
河合楽器	2,000	3,645.00	7,290,000		
クリナップ	6,000	519.00	3,114,000		
ピジョン	42,000	3,230.00	135,660,000	貸付株式数	14,800株
天馬	4,900	2,618.00	12,828,200		
オリバー	1,500	2,715.00	4,072,500	貸付株式数	300株
兼松サステック	500	1,799.00	899,500		
キングジム	5,300	937.00	4,966,100	貸付株式数	2,100株
象印マホービン	17,600	1,711.00	30,113,600		
リンテック	13,800	2,517.00	34,734,600		
信越ポリマー	9,600	1,075.00	10,320,000		
東　リ	14,700	246.00	3,616,200	貸付株式数	5,900株
イトーキ	12,800	375.00	4,800,000	貸付株式数	2,300株
任　天　堂	37,200	68,580.00	2,551,176,000		
三菱鉛筆	10,400	1,440.00	14,976,000	貸付株式数	100株
松　風	3,100	1,875.00	5,812,500		
タカラスタンダード	13,100	1,579.00	20,684,900		
コ　ク　ヨ	31,800	1,755.00	55,809,000		
ナカバヤシ	5,800	605.00	3,509,000	貸付株式数	1,200株
ニ　フ　コ	24,000	4,010.00	96,240,000		
立川ブラインド	2,900	1,316.00	3,816,400	貸付株式数	1,100株
グローブライド	3,300	4,135.00	13,645,500		
オカムラ	23,200	1,444.00	33,500,800	貸付株式数	3,900株
バルカー	5,300	2,185.00	11,580,500		
ＭＵＴＯＨホールディングス	900	1,594.00	1,434,600		
伊　藤　忠	446,900	3,344.00	1,494,433,600		

丸　紅	630,600	1,013.00	638,797,800		
スクロール	9,500	857.00	8,141,500	貸付株式数	3,600株
高　島	1,000	1,751.00	1,751,000		
ヨンドシーホールディングス	5,900	1,906.00	11,245,400		
三陽商会	3,400	970.00	3,298,000	貸付株式数	1,300株
長瀬産業	34,800	1,650.00	57,420,000	貸付株式数	7,000株
ナイガイ	3,200	327.00	1,046,400	貸付株式数	900株
蝶　理	4,100	1,707.00	6,998,700		
豊田通商	63,900	5,080.00	324,612,000		
オンワ－ドホールディングス	39,200	336.00	13,171,200		
三共生興	9,100	518.00	4,713,800		
兼　松	25,700	1,489.00	38,267,300		
美　津　濃	6,600	2,364.00	15,602,400		
ツカモトコーポレーション	1,300	1,396.00	1,814,800		
ルックホールディングス	2,200	1,507.00	3,315,400	貸付株式数	700株
三井物産	516,800	2,552.50	1,319,132,000		
日本紙パルプ	3,300	3,565.00	11,764,500		
東京エレクトロン	38,100	48,550.00	1,849,755,000		
カメイ	8,100	1,157.00	9,371,700		
東都水産	400	4,500.00	1,800,000		
ＯＵＧホールディングス	1,000	2,822.00	2,822,000		
スターゼン	5,000	2,121.00	10,605,000		
セイコーＨＤ	9,300	2,310.00	21,483,000		
山　善	24,800	970.00	24,056,000		
椿本興業	1,200	3,445.00	4,134,000		
住友商事	401,600	1,557.00	625,291,200		
日本ユニシス	22,100	3,150.00	69,615,000		
内田洋行	2,800	4,880.00	13,664,000	貸付株式数	500株
三菱商事	388,900	3,088.00	1,200,923,200		
第一実業	3,000	4,360.00	13,080,000		
キヤノンマーケティングＪＰＮ	15,600	2,647.00	41,293,200		
西華産業	3,200	1,783.00	5,705,600	貸付株式数	600株
佐藤商事	5,100	1,110.00	5,661,000		
菱洋エレクトロ	4,900	2,579.00	12,637,100	貸付株式数	400株
東京産業	5,700	606.00	3,454,200	貸付株式数	400株
ユアサ商事	6,500	3,075.00	19,987,500		
神鋼商事	1,400	2,374.00	3,323,600		

トルク	3,900	244.00	951,600		
阪和興業	12,900	3,165.00	40,828,500		
正栄食品	4,200	4,100.00	17,220,000	貸付株式数	1,600株
カナデン	5,300	1,074.00	5,692,200		
菱電商事	4,700	1,623.00	7,628,100	貸付株式数	1,600株
ニプロ	48,100	1,342.00	64,550,200	貸付株式数	19,100株
フルサト工業	3,000	1,858.00	5,574,000		
岩谷産業	15,500	6,410.00	99,355,000		
ナイス	2,500	2,021.00	5,052,500		
ニチモウ	1,000	2,117.00	2,117,000		
極東貿易	2,000	2,290.00	4,580,000	貸付株式数	600株
アステナホールディングス	9,900	665.00	6,583,500		
兼松エレクトロニクス	3,400	3,605.00	12,257,000		
三愛石油	15,500	1,202.00	18,631,000		
稲畑産業	15,700	1,735.00	27,239,500		
ＧＳＩクレオス	3,500	995.00	3,482,500	貸付株式数	1,200株
明和産業	5,900	476.00	2,808,400		
クワザワホールディングス	2,500	605.00	1,512,500		
ヤマエ久野	4,600	1,125.00	5,175,000	貸付株式数	1,100株
ゴールドウイン	10,600	6,610.00	70,066,000	貸付株式数	3,100株
ユニ・チャーム	137,800	4,404.00	606,871,200		
デサント	10,900	2,251.00	24,535,900	貸付株式数	4,200株
キ　ン　グ	3,400	516.00	1,754,400	貸付株式数	300株
ワ　キ　タ	12,500	1,133.00	14,162,500		
ヤマトインターナシヨナル	5,800	341.00	1,977,800	貸付株式数	100株
東邦ホールディングス	20,200	1,714.00	34,622,800		
サンゲツ	17,200	1,544.00	26,556,800		
ミツウロコグループ	9,700	1,221.00	11,843,700		
シナネンホールディングス	2,500	2,927.00	7,317,500	貸付株式数	900株
伊藤忠エネクス	14,300	1,018.00	14,557,400		
サンリオ	18,200	1,938.00	35,271,600	貸付株式数	6,700株
サンワ　テクノス	4,200	1,194.00	5,014,800		
リョーサン	6,800	2,023.00	13,756,400	貸付株式数	2,700株
新光商事	8,600	768.00	6,604,800		
トーホー	3,000	1,666.00	4,998,000	貸付株式数	1,100株
三信電気	3,500	2,128.00	7,448,000		
東陽テクニカ	6,900	1,114.00	7,686,600		
モスフード　サービス	9,000	3,105.00	27,945,000		
加賀電子	5,800	3,025.00	17,545,000	貸付株式数	1,300株
三益半導体	4,900	2,703.00	13,244,700		

ソーダニツカ	6,300	575.00	3,622,500		
立花エレテック	4,600	1,490.00	6,854,000	貸付株式数	1,800株
木曽路	8,300	2,371.00	19,679,300	貸付株式数	1,700株
ＳＲＳホールディングス	8,200	821.00	6,732,200	貸付株式数	3,000株
千　趣　会	11,800	414.00	4,885,200	貸付株式数	4,500株
タカキユー	7,300	138.00	1,007,400	貸付株式数	200株
リテールパートナーズ	7,900	1,162.00	9,179,800	貸付株式数	3,000株
ケーヨー	11,900	738.00	8,782,200		
上新電機	7,400	2,730.00	20,202,000		
日本瓦斯	32,000	1,823.00	58,336,000		
ロイヤルホールディングス	11,100	2,267.00	25,163,700	貸付株式数	4,400株
東　天　紅	500	1,081.00	540,500		
いなげや	7,000	1,464.00	10,248,000	貸付株式数	2,800株
チヨダ	6,400	907.00	5,804,800	貸付株式数	1,400株
ライフコーポレーション	6,000	3,415.00	20,490,000	貸付株式数	1,700株
リンガーハット	7,900	2,281.00	18,019,900	貸付株式数	1,200株
ＭｒＭａｘＨＤ	8,800	627.00	5,517,600		
テンアライド	5,300	342.00	1,812,600	貸付株式数	2,300株
ＡＯＫＩホールディングス	13,300	713.00	9,482,900	貸付株式数	1,200株
オークワ	10,000	1,100.00	11,000,000		
コメリ	9,900	2,600.00	25,740,000		
青山商事	14,200	892.00	12,666,400		
しまむら	7,400	9,990.00	73,926,000		
はせがわ	3,300	300.00	990,000		
高　島　屋	46,800	1,332.00	62,337,600		
松　屋	14,000	928.00	12,992,000		
エイチ・ツー・オーリテイリング	30,500	976.00	29,768,000		
近鉄百貨店	2,400	3,195.00	7,668,000		
丸井グループ	54,400	2,204.00	119,897,600		
クレディセゾン	37,300	1,422.00	53,040,600		
アクシアル　リテイリング	5,200	3,930.00	20,436,000		
井　筒　屋	3,200	256.00	819,200	貸付株式数	1,200株
イオン	246,100	3,004.00	739,284,400		
イ　ズ　ミ	13,000	4,265.00	55,445,000		
フオーバル	2,200	845.00	1,859,000		
平　和　堂	11,300	2,290.00	25,877,000	貸付株式数	5,200株
フ　ジ	7,700	2,008.00	15,461,600		
ヤオコー	7,300	6,280.00	45,844,000	貸付株式数	2,900株
ゼビオホールディングス	7,400	985.00	7,289,000	貸付株式数	500株

ケーズホールディングス	56,600	1,307.00	73,976,200	貸付株式数	25,200株
ＰＡＬＴＡＣ	10,300	5,720.00	58,916,000		
三谷産業	9,400	390.00	3,666,000	貸付株式数	3,000株
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,600	769.00	2,768,400	貸付株式数	1,300株
日産東京販売ＨＤ	8,900	243.00	2,162,700		
新生銀行	52,700	1,646.00	86,744,200		
あおぞら銀行	38,200	2,512.00	95,958,400		
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ ※	4,382,700	629.00	2,756,718,300		
りそなホールディングス	745,000	469.00	349,405,000	貸付株式数	294,400株
三井住友トラストＨＤ	121,200	3,720.00	450,864,000		
三井住友フィナンシャルＧ ※	442,900	4,008.00	1,775,143,200		
千葉銀行	213,500	699.00	149,236,500		
群馬銀行	130,500	357.00	46,588,500		
武蔵野銀行	9,500	1,683.00	15,988,500	貸付株式数	3,700株
千葉興業銀行	16,500	262.00	4,323,000		
筑波銀行	28,900	172.00	4,970,800		
七十七銀行	20,200	1,302.00	26,300,400		
青森銀行	4,900	2,117.00	10,373,300	貸付株式数	100株
秋田銀行	3,900	1,396.00	5,444,400		
山形銀行	7,000	878.00	6,146,000		
岩手銀行	4,100	1,784.00	7,314,400		
東邦銀行	56,700	205.00	11,623,500	貸付株式数	22,600株
東北銀行	3,100	1,029.00	3,189,900		
みちのく銀行	4,300	990.00	4,257,000		
ふくおかフィナンシャルＧ	58,000	1,997.00	115,826,000		
静岡銀行	156,100	885.00	138,148,500		
十六銀行	8,100	1,961.00	15,884,100		
スルガ銀行	63,000	359.00	22,617,000		
八十二銀行	141,700	362.00	51,295,400		
山梨中央銀行	7,400	833.00	6,164,200		
大垣共立銀行	12,900	1,871.00	24,135,900		
福井銀行	5,500	1,437.00	7,903,500		
北國銀行	5,900	2,239.00	13,210,100		
清水銀行	2,500	1,546.00	3,865,000		
富山銀行	1,300	2,605.00	3,386,500		
滋賀銀行	12,900	2,075.00	26,767,500		
南都銀行	9,300	1,853.00	17,232,900		
百五銀行	57,600	305.00	17,568,000		

京都銀行	23,100	5,380.00	124,278,000		
紀陽銀行	22,500	1,465.00	32,962,500		
ほくほくフィナンシャルG	42,500	860.00	36,550,000	貸付株式数	1,500株
山陰合同銀行	39,700	538.00	21,358,600		
中国銀行	54,800	863.00	47,292,400	貸付株式数	200株
鳥取銀行	2,200	1,117.00	2,457,400		
伊予銀行	85,100	572.00	48,677,200		
百十四銀行	6,500	1,472.00	9,568,000		
四国銀行	9,300	692.00	6,435,600	貸付株式数	2,800株
阿波銀行	9,600	2,073.00	19,900,800		
大分銀行	3,600	1,736.00	6,249,600		
宮崎銀行	3,900	2,040.00	7,956,000		
佐賀銀行	3,700	1,385.00	5,124,500		
沖縄銀行	5,700	2,624.00	14,956,800	貸付株式数	600株
琉球銀行	13,500	721.00	9,733,500		
セブン銀行	214,600	235.00	50,431,000	貸付株式数	83,700株
みずほフィナンシャルG	869,900	1,692.00	1,471,870,800		
高知銀行	2,500	834.00	2,085,000		
山口フィナンシャルG	79,900	652.00	52,094,800		
芙蓉総合リース	6,600	7,360.00	48,576,000	貸付株式数	900株
みずほリース	10,000	3,620.00	36,200,000	貸付株式数	3,900株
東京センチュリー	14,900	6,520.00	97,148,000	貸付株式数	400株
ＳＢＩホールディングス	79,100	2,778.00	219,739,800		
日本証券金融	28,200	874.00	24,646,800		
アイフル	109,100	372.00	40,585,200		
日本アジア投資	5,900	233.00	1,374,700		
長野銀行	2,200	1,112.00	2,446,400		
名古屋銀行	5,100	2,639.00	13,458,900		
北洋銀行	97,500	246.00	23,985,000	貸付株式数	26,200株
愛知銀行	2,200	2,802.00	6,164,400		
中京銀行	2,500	1,506.00	3,765,000		
大光銀行	2,200	1,418.00	3,119,600		
愛媛銀行	8,900	833.00	7,413,700		
トマト銀行	2,300	1,051.00	2,417,300	貸付株式数	100株
京葉銀行	25,500	409.00	10,429,500		
栃木銀行	31,600	172.00	5,435,200		
北日本銀行	1,900	1,726.00	3,279,400		
東和銀行	12,100	534.00	6,461,400		
福島銀行	7,700	228.00	1,755,600		
大東銀行	3,000	609.00	1,827,000	貸付株式数	1,200株

リコーリース	5,000	3,455.00	17,275,000	貸付株式数	2,000株
イオンフィナンシャルサービス	39,000	1,311.00	51,129,000		
ア　コ　ム	128,100	504.00	64,562,400	貸付株式数	50,900株
ジャックス	7,100	2,619.00	18,594,900	貸付株式数	1,400株
オ　リ　コ	173,800	158.00	27,460,400		
オリックス	388,600	1,976.50	768,067,900		
三菱ＨＣキャピタル	223,100	629.00	140,329,900		
ジャフコ　グループ	9,900	7,960.00	78,804,000		
九州　リースサービス	3,000	677.00	2,031,000	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	48,200	298.00	14,363,600		
大和証券Ｇ本社	479,500	643.00	308,318,500		
野村ホールディングス	979,800	605.00	592,779,000		
岡三証券グループ	53,100	440.00	23,364,000	貸付株式数	2,900株
丸三証券	19,200	652.00	12,518,400		
東洋証券	21,500	169.00	3,633,500		
東海東京ＨＤ	68,000	409.00	27,812,000	貸付株式数	500株
光世証券	1,800	644.00	1,159,200	貸付株式数	600株
水戸証券	17,800	304.00	5,411,200		
いちよし証券	13,300	603.00	8,019,900	貸付株式数	5,000株
松井証券	31,600	841.00	26,575,600		
ＳＯＭＰＯホールディングス	113,000	4,405.00	497,765,000	貸付株式数	45,200株
日本取引所グループ	173,100	2,568.00	444,520,800		
マネックスＧ	58,100	804.00	46,712,400	貸付株式数	23,000株
極東証券	8,500	813.00	6,910,500	貸付株式数	3,400株
岩井コスモホールディング	7,100	1,694.00	12,027,400		
藍澤證券	11,600	1,101.00	12,771,600	貸付株式数	300株
フィデアホール	62,000	122.00	7,564,000		
池田泉州ＨＤ	73,200	161.00	11,785,200	貸付株式数	28,700株
アニコム　ホールディングス	18,500	952.00	17,612,000	貸付株式数	7,200株
ＭＳ＆ＡＤ	155,200	3,424.00	531,404,800		
マネーパートナーズＧＰ	9,000	242.00	2,178,000		
スパークス・グループ	30,600	272.00	8,323,200	貸付株式数	11,900株
小林洋行	4,000	270.00	1,080,000		
第一生命ＨＬＤＧＳ	338,700	2,296.00	777,655,200		
東京海上ＨＤ	211,200	5,299.00	1,119,148,800		
アドバンテッジリスクマネ	3,200	1,064.00	3,404,800	貸付株式数	1,300株
イー・ギャランティ	7,500	2,271.00	17,032,500	貸付株式数	2,000株

アサックス	3,900	697.00	2,718,300	貸付株式数	1,400株
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,600	2,173.00	5,649,800		
Ｔ＆Ｄホールディングス	191,800	1,511.00	289,809,800		
アドバンスクリエイト	3,400	900.00	3,060,000	貸付株式数	1,000株
三井不動産	291,800	2,701.50	788,297,700		
三菱地所	420,300	1,838.00	772,511,400		
平和不動産	11,100	4,185.00	46,453,500	貸付株式数	4,300株
東京建物	63,200	1,685.00	106,492,000		
ダイビル	16,500	1,272.00	20,988,000		
京阪神ビルディング	10,500	1,391.00	14,605,500		
住友不動産	143,900	3,820.00	549,698,000		
太平洋興発	2,500	643.00	1,607,500	貸付株式数	700株
テーオーシー	12,100	707.00	8,554,700	貸付株式数	2,300株
東京楽天地	1,000	4,260.00	4,260,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	7,500	2,803.00	21,022,500		
フジ住宅	7,700	620.00	4,774,000		
空港施設	6,500	670.00	4,355,000		
明和地所	3,100	625.00	1,937,500		
ゴールドクレスト	5,800	1,829.00	10,608,200	貸付株式数	1,200株
リログループ	34,000	2,219.00	75,446,000		
エスリード	2,500	1,685.00	4,212,500	貸付株式数	1,000株
日神グループＨＬＤＧＳ	9,300	460.00	4,278,000	貸付株式数	4,100株
日本エスコン	12,500	787.00	9,837,500	貸付株式数	4,600株
タカラレーベン	27,400	347.00	9,507,800	貸付株式数	10,600株
ＡＶＡＮＴＩＡ	3,600	898.00	3,232,800	貸付株式数	600株
イオンモール	32,000	1,836.00	58,752,000		
毎日コムネット	2,300	715.00	1,644,500	貸付株式数	600株
ファースト住建	2,700	1,225.00	3,307,500		
ランド	359,900	11.00	3,958,900	貸付株式数	85,300株
カチタス	16,000	3,050.00	48,800,000		
東祥	4,000	1,995.00	7,980,000	貸付株式数	1,500株
トーセイ	8,900	1,090.00	9,701,000		
穴吹興産	1,800	2,147.00	3,864,600	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	7,800	982.00	7,659,600		
インテリックス	1,800	791.00	1,423,800	貸付株式数	600株
ランドビジネス	2,700	372.00	1,004,400		
サンネクスタグループ	2,200	1,015.00	2,233,000	貸付株式数	100株
グランディハウス	5,200	427.00	2,220,400		
東武鉄道	67,400	2,963.00	199,706,200		

相鉄ホールディングス	21,900	2,243.00	49,121,700	貸付株式数	8,700株
東急	162,900	1,569.00	255,590,100		
京浜急行	83,400	1,480.00	123,432,000		
小田急電鉄	104,100	2,883.00	300,120,300		
京王電鉄	36,300	6,840.00	248,292,000		
京成電鉄	48,700	3,690.00	179,703,000		
富士急行	9,000	5,460.00	49,140,000	貸付株式数	3,500株
新京成電鉄	1,800	2,140.00	3,852,000	貸付株式数	600株
東日本旅客鉄道	114,200	8,381.00	957,110,200		
西日本旅客鉄道	57,800	6,881.00	397,721,800		
東海旅客鉄道	54,000	17,755.00	958,770,000		
西武ホールディングス	78,400	1,428.00	111,955,200		
鴻池運輸	9,900	1,125.00	11,137,500	貸付株式数	1,900株
西日本鉄道	18,000	2,815.00	50,670,000	貸付株式数	7,100株
ハマキョウレックス	5,000	3,055.00	15,275,000		
サカイ引越センター	3,000	5,680.00	17,040,000	貸付株式数	1,100株
近鉄グループＨＬＤＧＳ	61,400	4,110.00	252,354,000		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	81,600	3,615.00	294,984,000		
南海電鉄	29,100	2,413.00	70,218,300	貸付株式数	11,500株
京阪ホールディングス	27,400	3,615.00	99,051,000		
神戸電鉄	1,500	3,490.00	5,235,000	貸付株式数	500株
名古屋鉄道	50,800	2,214.00	112,471,200		
山陽電鉄	4,400	1,946.00	8,562,400		
トランコム	1,900	8,210.00	15,599,000		
日本通運	21,200	8,980.00	190,376,000		
ヤマトホールディングス	86,100	2,982.00	256,750,200		
山　九	15,700	4,870.00	76,459,000		
日　新	4,900	1,504.00	7,369,600		
丸　運	4,300	265.00	1,139,500	貸付株式数	600株
丸全昭和運輸	5,100	3,300.00	16,830,000	貸付株式数	1,900株
センコーグループＨＬＤＧＳ	34,300	1,039.00	35,637,700	貸付株式数	9,000株
トナミホールディングス	1,500	5,010.00	7,515,000		
ニッコンホールディングス	20,600	2,373.00	48,883,800		
日石輸送	600	2,587.00	1,552,200		
福山通運	7,800	4,030.00	31,434,000	貸付株式数	2,100株
セイノーホールディングス	45,800	1,518.00	69,524,400	貸付株式数	1,400株
エスライン	1,300	895.00	1,163,500		
神奈川中央交通	1,400	3,605.00	5,047,000	貸付株式数	600株
日立物流	13,600	3,530.00	48,008,000		

丸和運輸機関	13,200	1,528.00	20,169,600	貸付株式数	5,100株 (4,800株)
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	6,200	1,619.00	10,037,800		
日本郵船	51,700	4,960.00	256,432,000		
商船三井	36,700	4,760.00	174,692,000		
川崎汽船	19,200	3,255.00	62,496,000		
ＮＳユナイテッド海運	3,100	2,182.00	6,764,200		
明治海運	6,800	434.00	2,951,200	貸付株式数	800株
飯野海運	29,000	441.00	12,789,000		
共栄タンカー	1,200	869.00	1,042,800		
九州旅客鉄道	47,600	2,699.00	128,472,400		
ＳＧホールディングス	116,600	2,519.00	293,715,400		
日本航空	150,500	2,597.00	390,848,500		
ＡＮＡホールディングス	166,500	2,768.00	460,872,000		
パスコ	1,200	1,604.00	1,924,800		
西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,500	2,940.00	4,410,000	貸付株式数	300株
シルバーライフ	1,300	2,549.00	3,313,700	貸付株式数	400株 (300株)
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	800	1,885.00	1,508,000	貸付株式数	200株
一家ダイニングプロジ	900	596.00	536,400	貸付株式数	200株
ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	2,800	3,570.00	9,996,000	貸付株式数	1,100株
国際紙パルプ商事	13,600	253.00	3,440,800		
ナルミヤ・インターナショナル	1,400	1,153.00	1,614,200		
ブックオフＧＨＤ	3,600	939.00	3,380,400	貸付株式数	1,400株
三菱倉庫	21,400	3,390.00	72,546,000		
三井倉庫ＨＯＬＤ	6,600	2,329.00	15,371,400	貸付株式数	500株
住友倉庫	22,100	1,509.00	33,348,900		
渋沢倉庫	3,300	2,117.00	6,986,100		
ヤマタネ	2,900	1,495.00	4,335,500		
東陽倉庫	9,600	324.00	3,110,400	貸付株式数	1,800株
乾汽船	4,000	1,179.00	4,716,000	貸付株式数	400株
日本トランスシティ	13,500	522.00	7,047,000	貸付株式数	400株
ケイヒン	1,100	1,352.00	1,487,200		
中央倉庫	3,500	1,071.00	3,748,500	貸付株式数	200株
川西倉庫	1,100	1,142.00	1,256,200		

安田倉庫	5,000	941.00	4,705,000		
ファイズホールディングス	1,400	821.00	1,149,400	貸付株式数	500株
東洋埠頭	1,800	1,517.00	2,730,600		
宇徳	4,500	502.00	2,259,000		
上　組	34,100	2,206.00	75,224,600		
サンリツ	1,900	735.00	1,396,500	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,400	1,339.00	1,874,600	貸付株式数	400株
キユーソー流通システム	1,500	1,692.00	2,538,000	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	11,700	2,368.00	27,705,600		
東海運	3,700	312.00	1,154,400		
エーアイテイー	3,800	995.00	3,781,000		
内外トランスライン	2,400	1,941.00	4,658,400	貸付株式数	800株
ショーエイコーポ	1,800	976.00	1,756,800	貸付株式数	400株
日本コンセプト	2,000	1,576.00	3,152,000	貸付株式数	100株
ＴＢＳホールディングス	42,100	1,838.00	77,379,800		
日本テレビＨＬＤＳ	52,800	1,335.00	70,488,000		
朝日放送グループＨＤ	5,300	710.00	3,763,000		
テレビ朝日ＨＤ	19,700	1,899.00	37,410,300	貸付株式数	7,000株
スカパーＪＳＡＴＨＤ	41,900	426.00	17,849,400		
テレビ東京ＨＤ	4,500	2,172.00	9,774,000		
日本ＢＳ放送	2,000	1,118.00	2,236,000	貸付株式数	800株
ビジョン	8,500	1,166.00	9,911,000		
スマートバリュー	2,100	800.00	1,680,000	貸付株式数	600株
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	6,400	2,219.00	14,201,600	貸付株式数	900株
ワイヤレスゲート	3,100	448.00	1,388,800	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,100	1,499.00	6,145,900		
日本通信	58,700	224.00	13,148,800	貸付株式数	1,000株
クロップス	1,200	876.00	1,051,200	貸付株式数	400株
日本電信電話	746,000	2,950.00	2,200,700,000		
ＫＤＤＩ	511,500	3,726.00	1,905,849,000		
ソフトバンク	579,700	1,430.50	829,260,850		
光通信	7,500	21,190.00	158,925,000		
エムティーアイ	7,300	685.00	5,000,500	貸付株式数	2,500株
ＧＭＯインターネット	22,800	2,979.00	67,921,200		
ファイバーゲート	2,400	1,590.00	3,816,000	貸付株式数	800株
アイドママーケティングコミュ	1,700	440.00	748,000		
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	16,700	4,460.00	74,482,000		
学研ホールディングス	9,300	1,342.00	12,480,600		

ゼンリン	11,500	1,166.00	13,409,000		
昭文社ホールディングス	3,200	469.00	1,500,800	貸付株式数	200株
インプレスホールディングス	8,200	211.00	1,730,200		
東京電力ＨＤ	553,300	343.00	189,781,900		
中部電力	198,800	1,314.50	261,322,600		
関西電力	246,000	1,062.00	261,252,000		
中国電力	95,300	1,020.00	97,206,000		
北陸電力	59,900	616.00	36,898,400		
東北電力	151,400	871.00	131,869,400		
四国電力	53,700	734.00	39,415,800		
九州電力	144,000	862.00	124,128,000		
北海道電力	62,900	501.00	31,512,900		
沖縄電力	12,900	1,391.00	17,943,900		
電源開発	51,800	1,607.00	83,242,600		
エフオン	4,400	956.00	4,206,400	貸付株式数	1,500株
イーレックス	9,900	2,039.00	20,186,100		
レノバ	11,300	3,745.00	42,318,500	貸付株式数	4,300株
東京瓦斯	125,100	2,105.00	263,335,500		
大阪瓦斯	117,500	2,020.00	237,350,000		
東邦瓦斯	32,100	5,470.00	175,587,000	貸付株式数	8,100株
北海道瓦斯	3,500	1,543.00	5,400,500		
広島ガス	11,600	371.00	4,303,600		
西部ガスＨＬＤＧＳ	7,400	2,443.00	18,078,200		
静岡ガス	18,600	1,008.00	18,748,800	貸付株式数	1,900株
メタウォーター	7,300	2,032.00	14,833,600		
アイネット	3,000	1,423.00	4,269,000	貸付株式数	1,300株
松　竹	4,200	12,610.00	52,962,000	貸付株式数	1,000株
東　宝	37,700	4,575.00	172,477,500		
エイチ・アイ・エス	10,000	2,566.00	25,660,000	貸付株式数	3,800株
東　映	2,100	20,700.00	43,470,000	貸付株式数	800株
ラックランド	1,900	2,729.00	5,185,100	貸付株式数	700株
ＮＴＴデータ	169,300	1,747.00	295,767,100		
共立メンテナンス	10,400	3,800.00	39,520,000		
イチネンホールディングス	6,200	1,234.00	7,650,800	貸付株式数	500株
建設技術研究所	4,100	2,451.00	10,049,100		
スペース	3,900	917.00	3,576,300	貸付株式数	600株
長　大	2,500	1,956.00	4,890,000		
アインホールディングス	9,300	7,000.00	65,100,000		
燦ホールディングス	2,700	1,187.00	3,204,900		

ピー・シー・エー	1,000	4,205.00	4,205,000		
スバル興業	400	8,340.00	3,336,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,300	1,283.00	2,950,900		
タナベ経営	1,000	1,427.00	1,427,000		
ビジネスＢ太田昭和	2,300	1,721.00	3,958,300		
ナ　ガ　ワ	2,000	8,090.00	16,180,000	貸付株式数	700株
東京都競馬	4,200	4,780.00	20,076,000		
常磐興産	2,600	1,445.00	3,757,000	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,800	2,669.00	28,825,200	貸付株式数	4,200株
ＤＴＳ	13,200	2,641.00	34,861,200	貸付株式数	3,700株
スクウェア・エニックス・ＨＤ	27,200	5,700.00	155,040,000		
シーイーシー	6,800	1,457.00	9,907,600		
カプコン	55,000	3,320.00	182,600,000		
西尾レントオール	5,700	3,250.00	18,525,000	貸付株式数	500株
アイ・エス・ビー	3,100	1,420.00	4,402,000		
アゴーラ　ホスピタリティーＧ	51,200	25.00	1,280,000	貸付株式数	10,900株
日本空港ビルデング	22,200	5,120.00	113,664,000	貸付株式数	2,700株
トランス・コスモス	5,900	2,978.00	17,570,200	貸付株式数	2,300株
乃村工藝社	26,800	988.00	26,478,400		
ジャステック	4,100	1,286.00	5,272,600		
ＳＣＳＫ	14,600	6,290.00	91,834,000		
藤田観光	2,700	2,325.00	6,277,500	貸付株式数	1,000株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	3,800	1,431.00	5,437,800	貸付株式数	1,500株
日本管財	6,500	2,344.00	15,236,000	貸付株式数	2,500株
トーカイ	6,000	2,462.00	14,772,000		
白　洋　舎	700	2,319.00	1,623,300	貸付株式数	300株
セコム	61,000	8,638.00	526,918,000		
日本システムウエア	1,900	2,297.00	4,364,300		
セントラル警備保障	2,900	3,170.00	9,193,000	貸付株式数	1,100株
アイネス	6,300	1,312.00	8,265,600	貸付株式数	2,500株
丹青社	11,700	916.00	10,717,200		
メイテツク	7,600	6,280.00	47,728,000		
ＴＫＣ	10,700	3,305.00	35,363,500		
富士ソフト	6,800	5,500.00	37,400,000	貸付株式数	2,700株
応用地質	7,100	1,285.00	9,123,500		
船井総研ホールディン	12,600	2,310.00	29,106,000	貸付株式数	3,300株
ＮＳＤ	20,300	1,783.00	36,194,900		

進学会ホールディングス	2,600	421.00	1,094,600	貸付株式数	1,000株
丸紅建材リース	500	1,805.00	902,500		
オ　オ　バ	4,100	770.00	3,157,000	貸付株式数	1,800株
コナミホールディングス	23,200	7,210.00	167,272,000		
いであ	1,500	1,802.00	2,703,000	貸付株式数	500株
学　究　社	1,900	1,342.00	2,549,800	貸付株式数	700株
ベネッセホールディングス	22,600	2,577.00	58,240,200	貸付株式数	9,000株
イオンディライト	7,500	3,400.00	25,500,000		
ナック	2,700	927.00	2,502,900		
福井コンピュータＨＬＤＳ	3,000	4,180.00	12,540,000		
ダイセキ	10,500	4,370.00	45,885,000	貸付株式数	900株
ステップ	2,200	1,612.00	3,546,400		
日鉄物産	4,400	4,365.00	19,206,000		
泉州電業	1,800	3,405.00	6,129,000		
元気寿司	1,800	2,626.00	4,726,800	貸付株式数	700株 (500株)
トラスコ中山	14,700	2,935.00	43,144,500		
ヤマダホールディングス	212,400	523.00	111,085,200	貸付株式数	79,800株
オートバックスセブン	23,400	1,483.00	34,702,200		
モリト	4,500	606.00	2,727,000	貸付株式数	600株
アークランドサカモト	10,100	1,431.00	14,453,100	貸付株式数	2,200株
ニトリホールディングス	25,300	18,445.00	466,658,500		
グルメ杵屋	4,100	959.00	3,931,900	貸付株式数	1,600株
愛　眼	4,400	227.00	998,800	貸付株式数	1,700株
ケーユーホールディングス	3,400	986.00	3,352,400	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	21,000	2,046.00	42,966,000	貸付株式数	8,400株
加藤産業	9,200	3,295.00	30,314,000	貸付株式数	3,600株
北恵	1,800	986.00	1,774,800		
イノテック	3,700	1,376.00	5,091,200		
イエローハット	12,000	1,927.00	23,124,000		
松屋フーズＨＬＤＧＳ	2,900	3,520.00	10,208,000	貸付株式数	100株
ＪＢＣＣホールディングス	4,200	1,315.00	5,523,000		
ＪＫホールディングス	5,800	788.00	4,570,400	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	8,700	1,049.00	9,126,300	貸付株式数	3,500株
日　伝	5,300	2,071.00	10,976,300		
関西スーパーマーケット	4,800	988.00	4,742,400		
ミロク情報サービス	6,200	1,566.00	9,709,200		
北沢産業	4,300	253.00	1,087,900		
杉本商事	3,200	2,259.00	7,228,800		
因幡電機産業	17,000	2,553.00	43,401,000	貸付株式数	3,600株

王将フードサービス	4,100	5,590.00	22,919,000	貸付株式数	1,600株
プレナス	7,000	2,046.00	14,322,000		
ミニストップ	5,300	1,370.00	7,261,000	貸付株式数	1,800株
アークス	12,100	2,420.00	29,282,000	貸付株式数	4,100株
バローホールディングス	12,900	2,271.00	29,295,900		
東　テ　ク	2,200	2,698.00	5,935,600		
ミスミグループ本社	80,100	3,615.00	289,561,500		
藤　　久	1,700	845.00	1,436,500	貸付株式数	600株
アルテック	6,300	332.00	2,091,600		
ベ　ル　ク	3,100	5,510.00	17,081,000		
大　庄	3,100	1,050.00	3,255,000	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	2,100	1,816.00	3,813,600	貸付株式数	700株
ファーストリテイリング	8,600	84,120.00	723,432,000		
ソフトバンクグループ	506,100	8,153.00	4,126,233,300		
蔵王産業	900	1,465.00	1,318,500		
スズケン	27,200	3,450.00	93,840,000		
サンドラッグ	24,200	3,545.00	85,789,000		
サックスバーホールディング	5,000	631.00	3,155,000	貸付株式数	2,000株
ジェコス	4,500	874.00	3,933,000		
ヤマザワ	1,100	1,711.00	1,882,100	貸付株式数	500株
や　ま　や	1,200	2,306.00	2,767,200	貸付株式数	500株
グローセル	6,400	429.00	2,745,600	貸付株式数	2,000株
ベルーナ	13,900	1,064.00	14,789,600	貸付株式数	1,800株
合計			174,866,104,090		

（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。

ソニーグループ	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。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	124,063,442	136,508,839
国債証券	17,297,379,830	27,289,808,440
地方債証券	1,557,629,300	1,656,998,200
特殊債券	726,014,200	729,845,600
社債券	827,793,900	927,264,900
未収利息	48,444,133	60,543,882
前払費用	1,675,348	3,091,011
流動資産合計	20,583,000,153	30,804,060,872
資産合計	20,583,000,153	30,804,060,872
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,196,613	610,663
その他未払費用	969	－
流動負債合計	2,197,582	610,663
負債合計	2,197,582	610,663
純資産の部		
元本等		
元本　※1	15,964,638,245	23,909,728,537
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,616,164,326	6,893,721,672
元本等合計	20,580,802,571	30,803,450,209
純資産合計	20,580,802,571	30,803,450,209
負債純資産合計	20,583,000,153	30,804,060,872

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6月6日 至　2021年6月7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	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
1. ※1　期首	2019年6月12日	2020年6月6日
期首元本額	13,828,473,102円	15,964,638,245円
期中追加設定元本額	4,324,050,803円	8,335,559,013円
期中一部解約元本額	2,187,885,660円	390,468,721円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	220,452,950円	512,193,102円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	2,051,993円	－円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	128,078,758円	2,400,673,245円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,834,153,495円	2,951,095,002円
ダイワ・ライフ・バランス３０	6,266,365,831円	7,777,518,506円
ダイワ・ライフ・バランス５０	3,659,650,103円	5,043,351,856円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,101,824,963円	1,599,441,219円

	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	877,405,843円	1,276,401,478円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	702,693,232円	956,403,243円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	221,886,329円	341,020,878円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	52,146,312円	－円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	65,600,176円	－円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,365,722円	－円
	ダイワつみたてインデックス日本債券	287,797,255円	507,219,192円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	24,664,794円	31,180,661円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	7,482,369円	11,093,047円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	3,751,222円	5,910,207円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	306,933,836円	295,990,826円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	189,333,062円	200,236,075円
計		15,964,638,245円	23,909,728,537円
2.	期末日における受益権の総数	15,964,638,245口	23,909,728,537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　2020年6月6日 至　2021年6月7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	2021年6月7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	2020年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年6月7日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△248,052,400	△143,651,070
地方債証券	△7,650,600	△4,295,300
特殊債券	△3,831,300	△2,437,900
社債券	△7,080,300	△1,511,800
合計	△266,614,600	△151,896,070

（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12月3日から2020年6月5日まで、及び2020年12月1日から2021年6月7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

2020年6月5日現在	2021年6月7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）

	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
1口当たり純資産額	1.2891円	1.2883円
（1万口当たり純資産額）	(12,891円)	(12,883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	４１４　２年国債	170,000,000	170,425,000	
	４１５　２年国債	100,000,000	100,270,000	
	４１６　２年国債	80,000,000	80,236,800	
	４１７　２年国債	130,000,000	130,410,800	
	４１８　２年国債	160,000,000	160,537,600	
	４１９　２年国債	350,000,000	351,246,000	
	４２０　２年国債	100,000,000	100,376,000	
	４２１　２年国債	130,000,000	130,516,100	
	４２２　２年国債	70,000,000	70,296,800	
	４２３　２年国債	30,000,000	30,076,200	
	４２４　２年国債	100,000,000	100,266,000	
	１３３　５年国債	230,000,000	230,664,700	
	１３４　５年国債	170,000,000	170,600,100	
	１３５　５年国債	420,000,000	421,722,000	
	１３６　５年国債	380,000,000	381,778,400	
	１３７　５年国債	540,000,000	542,905,200	
	１３８　５年国債	450,000,000	452,686,500	
	１３９　５年国債	430,000,000	432,816,500	
	１４０　５年国債	280,000,000	281,960,000	
	１４１　５年国債	430,000,000	433,190,600	
	１４２　５年国債	100,000,000	100,798,000	
	１４３　５年国債	360,000,000	363,074,400	
	１４４　５年国債	260,000,000	262,368,600	
	１４５　５年国債	320,000,000	323,030,400	

１４６　５年国債	170,000,000	171,625,200	
１４７　５年国債	286,000,000	287,441,440	
１　４０年国債	30,000,000	43,156,500	
２　４０年国債	48,000,000	67,005,120	
３　４０年国債	19,000,000	26,624,320	
４　４０年国債	54,000,000	75,925,620	
５　４０年国債	35,000,000	47,607,350	
６　４０年国債	40,000,000	53,664,400	
７　４０年国債	41,000,000	52,919,110	
８　４０年国債	33,000,000	39,855,420	
９　４０年国債	40,000,000	36,238,000	
１０　４０年国債	91,000,000	96,483,660	
１１　４０年国債	85,000,000	87,357,900	
１２　４０年国債	99,000,000	91,983,870	
１３　４０年国債	252,000,000	233,775,360	
３２５　１０年国債	160,000,000	161,904,000	
３２６　１０年国債	20,000,000	20,253,600	
３２７　１０年国債	90,000,000	91,278,900	
３２８　１０年国債	60,000,000	60,775,800	
３２９　１０年国債	200,000,000	203,790,000	
３３０　１０年国債	81,000,000	82,735,830	
３３１　１０年国債	10,000,000	10,168,400	
３３２　１０年国債	65,000,000	66,206,400	
３３３　１０年国債	83,000,000	84,702,330	
３３４　１０年国債	320,000,000	327,110,400	
３３５　１０年国債	210,000,000	214,328,100	
３３７　１０年国債	260,000,000	263,920,800	
３３８　１０年国債	80,000,000	81,595,200	
３３９　１０年国債	115,000,000	117,446,050	
３４０　１０年国債	190,000,000	194,254,100	
３４１　１０年国債	15,000,000	15,280,200	
３４２　１０年国債	140,000,000	141,344,000	
３４３　１０年国債	270,000,000	272,662,200	
３４４　１０年国債	130,000,000	131,310,400	
３４５　１０年国債	320,000,000	323,289,600	
３４６　１０年国債	130,000,000	131,358,500	
３４７　１０年国債	300,000,000	303,180,000	
３４８　１０年国債	310,000,000	313,227,100	
３４９　１０年国債	250,000,000	252,622,500	

３５０　１０年国債	230,000,000	232,424,200	
３５１　１０年国債	300,000,000	303,174,000	
３５２　１０年国債	360,000,000	363,679,200	
３５３　１０年国債	290,000,000	292,844,900	
３５４　１０年国債	280,000,000	282,618,000	
３５５　１０年国債	185,000,000	186,559,550	
３５６　１０年国債	220,000,000	221,729,200	
３５７　１０年国債	180,000,000	181,303,200	
３５８　１０年国債	275,000,000	276,806,750	
３５９　１０年国債	340,000,000	341,836,000	
３６０　１０年国債	350,000,000	351,617,000	
３６１　１０年国債	290,000,000	290,959,900	
３６２　１０年国債	265,000,000	265,641,300	
２　３０年国債	9,000,000	10,861,110	
３　３０年国債	4,000,000	4,810,280	
４　３０年国債	8,000,000	10,144,880	
５　３０年国債	8,000,000	9,678,560	
６　３０年国債	9,000,000	11,146,950	
７　３０年国債	12,000,000	14,842,800	
１０　３０年国債	25,000,000	27,733,250	
１１　３０年国債	9,000,000	10,636,200	
１２　３０年国債	11,000,000	13,562,890	
１３　３０年国債	11,000,000	13,462,240	
１４　３０年国債	22,000,000	28,084,100	
１５　３０年国債	21,000,000	27,186,600	
１６　３０年国債	26,000,000	33,760,480	
１７　３０年国債	17,000,000	21,913,850	
１８　３０年国債	20,000,000	25,581,200	
１９　３０年国債	15,000,000	19,233,900	
２０　３０年国債	16,000,000	21,023,200	
２１　３０年国債	16,000,000	20,628,960	
２２　３０年国債	17,000,000	22,468,050	
２３　３０年国債	16,000,000	21,200,320	
２４　３０年国債	15,000,000	19,924,650	
２５　３０年国債	17,000,000	22,128,560	
２６　３０年国債	32,000,000	42,252,480	
２７　３０年国債	32,000,000	42,963,840	
２８　３０年国債	34,000,000	45,876,880	
２９　３０年国債	43,000,000	57,555,070	

３０　３０年国債	56,000,000	74,341,120	
３１　３０年国債	76,000,000	99,904,280	
３２　３０年国債	45,000,000	60,198,300	
３３　３０年国債	95,000,000	122,322,950	
３４　３０年国債	110,000,000	146,160,300	
３５　３０年国債	120,000,000	155,439,600	
３６　３０年国債	98,000,000	127,350,020	
３７　３０年国債	117,000,000	150,244,380	
３８　３０年国債	65,000,000	82,324,450	
３９　３０年国債	58,000,000	74,782,880	
４０　３０年国債	70,000,000	88,869,200	
４１　３０年国債	65,000,000	81,290,300	
４２　３０年国債	63,000,000	78,864,030	
４３　３０年国債	55,000,000	68,916,100	
４４　３０年国債	55,000,000	68,981,000	
４５　３０年国債	80,000,000	96,844,800	
４６　３０年国債	90,000,000	109,011,600	
４７　３０年国債	105,000,000	129,640,350	
４８　３０年国債	68,000,000	80,902,320	
４９　３０年国債	68,000,000	80,931,560	
５０　３０年国債	85,000,000	89,438,700	
５１　３０年国債	75,000,000	70,102,500	
５２　３０年国債	82,000,000	80,287,840	
５３　３０年国債	75,000,000	75,082,500	
５４　３０年国債	84,000,000	87,947,160	
５５　３０年国債	96,000,000	100,435,200	
５６　３０年国債	68,000,000	71,087,200	
５７　３０年国債	70,000,000	73,120,600	
５８　３０年国債	114,000,000	118,985,220	
５９　３０年国債	70,000,000	71,296,400	
６０　３０年国債	80,000,000	85,326,400	
６１　３０年国債	58,000,000	58,883,340	
６２　３０年国債	46,000,000	44,323,760	
６３　３０年国債	85,000,000	79,582,950	
６４　３０年国債	65,000,000	60,682,050	
６５　３０年国債	76,000,000	70,829,720	
６６　３０年国債	87,000,000	80,941,320	
６７　３０年国債	67,000,000	65,620,470	
６８　３０年国債	76,000,000	74,423,760	

６９　３０年国債	106,000,000	106,390,080	
７０　３０年国債	166,000,000	166,410,020	
５８　２０年国債	35,000,000	35,912,100	
５９　２０年国債	3,000,000	3,084,150	
６１　２０年国債	40,000,000	40,802,800	
６２　２０年国債	16,000,000	16,301,600	
６３　２０年国債	30,000,000	31,176,900	
６４　２０年国債	35,000,000	36,628,200	
６５　２０年国債	42,000,000	44,162,160	
６６　２０年国債	30,000,000	31,467,900	
６７　２０年国債	19,000,000	20,073,500	
６８　２０年国債	25,000,000	26,621,750	
６９　２０年国債	12,000,000	12,744,960	
７０　２０年国債	18,000,000	19,383,660	
７１　２０年国債	17,000,000	18,203,260	
７２　２０年国債	53,000,000	56,880,130	
７５　２０年国債	14,000,000	15,180,340	
７６　２０年国債	25,000,000	26,918,000	
７８　２０年国債	17,000,000	18,391,620	
７９　２０年国債	14,000,000	15,202,740	
８１　２０年国債	65,000,000	70,919,550	
８２　２０年国債	28,000,000	30,670,640	
８５　２０年国債	31,000,000	34,267,710	
８６　２０年国債	6,000,000	6,690,120	
８７　２０年国債	35,000,000	38,857,700	
８８　２０年国債	33,000,000	36,996,630	
８９　２０年国債	15,000,000	16,740,750	
９２　２０年国債	60,000,000	67,289,400	
９３　２０年国債	18,000,000	20,174,220	
９４　２０年国債	45,000,000	50,697,000	
９５　２０年国債	30,000,000	34,317,900	
９６　２０年国債	63,000,000	71,304,030	
９７　２０年国債	25,000,000	28,573,250	
９８　２０年国債	34,000,000	38,645,080	
９９　２０年国債	53,000,000	60,509,570	
１００　２０年国債	35,000,000	40,371,450	
１０１　２０年国債	18,000,000	21,007,620	
１０２　２０年国債	10,000,000	11,729,100	
１０３　２０年国債	21,000,000	24,482,850	

１０４　２０年国債	64,000,000	73,711,360	
１０５　２０年国債	38,000,000	43,941,300	
１０６　２０年国債	16,000,000	18,618,400	
１０７　２０年国債	40,000,000	46,433,600	
１０８　２０年国債	68,000,000	77,910,320	
１０９　２０年国債	60,000,000	68,977,200	
１１０　２０年国債	27,000,000	31,460,670	
１１１　２０年国債	35,000,000	41,201,650	
１１２　２０年国債	40,000,000	46,766,000	
１１３　２０年国債	70,000,000	82,144,300	
１１４　２０年国債	45,000,000	52,996,950	
１１５　２０年国債	42,000,000	49,821,660	
１１６　２０年国債	27,000,000	32,145,120	
１１７　２０年国債	77,000,000	90,998,600	
１１８　２０年国債	13,000,000	15,300,090	
１１９　２０年国債	23,000,000	26,655,160	
１２０　２０年国債	98,000,000	111,809,180	
１２３　２０年国債	42,000,000	50,122,380	
１２４　２０年国債	100,000,000	118,391,000	
１２５　２０年国債	25,000,000	30,172,750	
１２６　２０年国債	21,000,000	24,937,080	
１２７　２０年国債	110,000,000	129,554,700	
１２８　２０年国債	32,000,000	37,796,480	
１２９　２０年国債	95,000,000	111,263,050	
１３０　２０年国債	28,000,000	32,879,000	
１３１　２０年国債	135,000,000	157,148,100	
１３２　２０年国債	25,000,000	29,169,750	
１３３　２０年国債	110,000,000	129,493,100	
１３４　２０年国債	15,000,000	17,700,900	
１３５　２０年国債	20,000,000	23,388,000	
１３６　２０年国債	120,000,000	139,050,000	
１３７　２０年国債	18,000,000	21,096,720	
１３９　２０年国債	140,000,000	162,561,000	
１４０　２０年国債	20,000,000	23,492,200	
１４１　２０年国債	48,000,000	56,499,360	
１４２　２０年国債	140,000,000	166,378,800	
１４３　２０年国債	100,000,000	116,785,000	
１４４　２０年国債	70,000,000	80,938,900	
１４５　２０年国債	130,000,000	153,634,000	

	１４６　２０年国債	140,000,000	165,775,400	
	１４７　２０年国債	145,000,000	170,237,250	
	１４８　２０年国債	145,000,000	168,700,250	
	１４９　２０年国債	165,000,000	192,366,900	
	１５０　２０年国債	145,000,000	167,408,300	
	１５１　２０年国債	155,000,000	175,078,700	
	１５２　２０年国債	160,000,000	180,851,200	
	１５３　２０年国債	160,000,000	183,147,200	
	１５４　２０年国債	155,000,000	175,429,000	
	１５５　２０年国債	145,000,000	160,139,450	
	１５６　２０年国債	130,000,000	132,307,500	
	１５７　２０年国債	160,000,000	157,924,800	
	１５８　２０年国債	140,000,000	144,197,200	
	１５９　２０年国債	145,000,000	151,455,400	
	１６０　２０年国債	130,000,000	137,627,100	
	１６１　２０年国債	115,000,000	119,910,500	
	１６２　２０年国債	150,000,000	156,258,000	
	１６３　２０年国債	120,000,000	124,884,000	
	１６４　２０年国債	165,000,000	168,922,050	
	１６５　２０年国債	115,000,000	117,582,900	
	１６６　２０年国債	150,000,000	158,169,000	
	１６７　２０年国債	100,000,000	101,972,000	
	１６８　２０年国債	120,000,000	120,199,200	
	１６９　２０年国債	100,000,000	98,235,000	
	１７０　２０年国債	95,000,000	93,142,750	
	１７１　２０年国債	105,000,000	102,744,600	
	１７２　２０年国債	165,000,000	164,138,700	
	１７３　２０年国債	130,000,000	129,086,100	
	１７４　２０年国債	135,000,000	133,920,000	
	１７５　２０年国債	93,000,000	93,834,210	
	１７６　２０年国債	50,000,000	50,408,000	
国債証券　合計			27,289,808,440	
地方債証券	７５１　東京都公債	100,000,000	101,650,000	
	２７－１５　北海道公債	100,000,000	100,919,900	
	２２２　神奈川県公債	100,000,000	100,250,500	
	４０１　大阪府公債	100,000,000	102,006,500	
	３　兵庫県公債１２年	100,000,000	102,069,600	
	１１兵庫県公債２０年	100,000,000	115,563,800	
	２８－１　静岡県公債	100,000,000	100,310,500	

	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	101,235,500	
	２２－１　福岡県１５年	100,000,000	107,400,900	
	２９－６　千葉県公債	100,000,000	101,329,800	
	１１６　共同発行地方	100,000,000	101,167,300	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	101,096,500	
	１６８　共同発行地方	100,000,000	101,039,900	
	２７－１　滋賀県公債	100,000,000	102,088,500	
	２５－６　大阪市公債	100,000,000	101,708,600	
	１１　名古屋市２０年	100,000,000	117,160,400	
地方債証券　合計			1,656,998,200	
特殊債券	４７日本政策投資ＣＯ	100,000,000	107,328,400	
	８１　政保道路機構	100,000,000	116,166,300	
	１９０　政保道路機構	100,000,000	101,152,700	
	２４１　政保道路機構	100,000,000	101,630,800	
	２６１　政保道路機構	100,000,000	101,628,200	
	６５　地方公共団体	100,000,000	101,749,000	
	１２７　都市再生	100,000,000	100,190,200	
特殊債券　合計			729,845,600	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	100,117,100	
	２５　西日本高速道	100,000,000	101,731,000	
	１４　セブンアンドアイ	100,000,000	100,451,500	
	１７　パナソニツク	100,000,000	101,327,000	
	５　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	101,365,300	
	８０　三菱地所	100,000,000	112,350,500	
	３２東日本旅客鉄道	100,000,000	106,237,000	
	９　ソフトバンク	100,000,000	99,930,800	
	４９７　関西電力	100,000,000	103,754,700	
社債券　合計			927,264,900	
合計			30,603,917,140	

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

	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	173,603,398	453,635,712
コール・ローン	318,299,700	7,243,115,392
株式	131,681,035,925	199,282,719,518
投資証券	3,609,130,632	4,908,406,142
派生商品評価勘定	81,188,750	258,465,709
未収入金	701,175	63,829,653
未収配当金	198,865,568	268,921,252
差入委託証拠金	832,164,327	3,514,930,360
流動資産合計	136,894,989,475	215,994,023,738
資産合計	136,894,989,475	215,994,023,738
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	－	4,724,448
未払解約金	54,700,100	84,794,800
その他未払費用	8,070	－
流動負債合計	54,708,170	89,519,248
負債合計	54,708,170	89,519,248
純資産の部		
元本等		
元本　※1	51,293,925,045	58,182,794,639
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	85,546,356,260	157,721,709,851
元本等合計	136,840,281,305	215,904,504,490
純資産合計	136,840,281,305	215,904,504,490
負債純資産合計	136,894,989,475	215,994,023,738

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6月6日 至　2021年6月7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	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
1．※1　期首	2019年6月12日	2020年6月6日
期首元本額	44,696,223,546円	51,293,925,045円
期中追加設定元本額	17,425,115,824円	13,640,586,671円
期中一部解約元本額	10,827,414,325円	6,751,717,077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	454,031,179円	383,529,944円

ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	10,677,933円	4,549,034円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	131,184,690円	78,505,468円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	16,165,872円	9,555,264円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	444,326,612円	269,933,131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）	16,856,230円	27,604,939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）	551,473,507円	504,914,542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）	2,240,316,478円	2,461,237,714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）	642,283,389円	494,255,626円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	8,073,192円	11,991,941円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	6,420,807円	18,033,648円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	1,606,714,185円	3,092,178,917円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	980,707,358円	1,041,878,873円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	37,453,162円	127,831,257円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	32,474,283,197円	35,748,871,257円
ダイワ・ライフ・バランス３０	639,509,932円	529,092,010円
ダイワ・ライフ・バランス５０	992,831,299円	938,183,739円
ダイワ・ライフ・バランス７０	747,726,631円	717,717,769円

大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,568,575,057円	1,632,567,507円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	2,786,310円	－円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	13,728,464円	11,485,409円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	7,398,922円	8,497,384円
ダイワつみたてインデックス外国株式	328,138,672円	599,531,918円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	2,497,968円	1,997,402円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,899,391円	2,040,718円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	2,385,040円	2,583,521円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	187,704,863円	123,939,186円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	321,603,097円	232,900,284円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,699,584,193円	1,760,933,852円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	138,083,824円	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）	－円	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）	－円	234,082,341円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	788,846,647円	853,880,708円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	186,268,819円	233,874,969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）	127,037,653円	2,826,744,251円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,770,721,586円	2,742,298,017円
ダイワライフスタイル２５	20,088,972円	14,059,133円
ダイワライフスタイル５０	70,781,731円	54,804,382円

ダイワライフスタイル７５	54,758,183円	45,101,321円
計	51,293,925,045円	58,182,794,639円
2. 期末日における受益権の総数	51,293,925,045口	58,182,794,639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 2020年6月6日 至 2021年6月7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	2021年6月7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	2020年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年6月7日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△2,767,010,734	24,776,852,072
投資証券	△413,560,522	706,125,033
合計	△3,180,571,256	25,482,977,105

（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12月3日から2020年6月5日まで、及び2020年12月1日から2021年6月7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	2020年6月5日 現在				2021年6月7日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買　建	1,429,210,755	－	1,507,853,315	78,642,560	11,313,846,826	－	11,564,905,616	251,058,790
合計	1,429,210,755	－	1,507,853,315	78,642,560	11,313,846,826	－	11,564,905,616	251,058,790

（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	2020年6月5日 現在				2021年6月7日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	204,591,810	－	207,138,000	2,546,190	7,097,104,729	－	7,099,787,200	2,682,471
アメリカ・ドル	204,591,810	－	207,138,000	2,546,190	5,026,491,120	－	5,033,363,000	6,871,880
イギリス・ポンド	－	－	－	－	311,237,390	－	310,340,000	△897,390
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	238,992,180	－	239,051,400	59,220
カナダ・ドル	－	－	－	－	304,836,045	－	304,584,000	△252,045
スイス・フラン	－	－	－	－	296,086,202	－	296,265,600	179,398
ユーロ	－	－	－	－	919,461,792	－	916,183,200	△3,278,592
合計	204,591,810	－	207,138,000	2,546,190	7,097,104,729	－	7,099,787,200	2,682,471

（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）

	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6678円 (26,678円)	3.7108円 (37,108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	4,050	160.870	651,523.500	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,430	357.350	1,225,710.500	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,600	148.880	982,608.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,750	85.610	406,647.500	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,150	173.570	373,175.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	20,600	49.790	1,025,674.000	
	ABBOTT LABORATORIES	61,416	109.290	6,712,154.640	
	HOWMET AEROSPACE INC	13,233	35.200	465,801.600	
	VERISK ANALYTICS INC	5,500	172.650	949,575.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	12,150	56.520	686,718.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	21,100	69.160	1,459,276.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,530	347.030	530,955.900	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	21,562	146.860	3,166,595.320	
	QORVO INC	3,850	184.760	711,326.000	
	AFLAC INC	22,550	57.480	1,296,174.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	4,600	134.150	617,090.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,750	89.240	513,130.000	

ADOBE INC	16,620	504.500	8,384,790.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,650	55.360	423,504.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,360	329.520	1,436,707.200	
GARMIN LTD	5,350	143.640	768,474.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,750	304.760	2,361,890.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	24,150	230.050	5,555,707.500	
WR BERKLEY CORP	4,875	77.300	376,837.500	
AUTOZONE INC	790	1,387.210	1,095,895.900	
DOLLAR TREE INC	8,321	101.800	847,077.800	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	39,550	10.400	411,320.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,800	87.030	330,714.000	
CELANESE CORP	3,950	166.340	657,043.000	
DR HORTON INC	12,166	92.580	1,126,328.280	
DENTSPLY SIRONA INC	7,500	66.280	497,100.000	
AUTODESK INC	7,720	284.780	2,198,501.600	
MOODY'S CORP	5,820	335.650	1,953,483.000	
DEVON ENERGY CORP	22,400	31.660	709,184.000	
ALBEMARLE CORP	4,130	173.540	716,720.200	
ATMOS ENERGY CORP	4,550	100.710	458,230.500	
ALLIANT ENERGY CORP	8,500	58.110	493,935.000	
CITIGROUP INC	72,273	79.490	5,744,980.770	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14,650	197.720	2,896,598.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	17,450	86.030	1,501,223.500	
ALLEGHANY CORP	480	712.500	342,000.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,370	431.140	590,661.800	
HESS CORP	9,800	88.920	871,416.000	
DAVITA INC	2,750	120.280	330,770.000	
DANAHER CORP	22,200	242.270	5,378,394.000	
FORTIVE CORP	11,300	73.460	830,098.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	19,700	112.180	2,209,946.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	19,650	68.770	1,351,330.500	
BUNGE LTD	4,800	89.110	427,728.000	
TE CONNECTIVITY LTD	11,375	139.360	1,585,220.000	
APPLE INC	584,700	125.890	73,607,883.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,800	123.380	1,332,504.000	
BOEING CO/THE	19,210	249.920	4,800,963.200	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,365	124.220	666,440.300	

BECTON DICKINSON AND CO	9,939	240.660	2,391,919.740	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	7,600	17.070	129,732.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,600	104.270	479,642.000	
NISOURCE INC	13,900	25.490	354,311.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,650	96.340	447,981.000	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	320	1,106.290	354,012.800	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	29,421	52.210	1,536,070.410	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	143,504	57.300	8,222,779.200	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	47,550	292.520	13,909,326.000	
ANSYS INC	3,080	338.780	1,043,442.400	
TRUIST FINANCIAL CORP	46,917	60.190	2,823,934.230	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	24,000	93.200	2,236,800.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	77,900	64.940	5,058,826.000	
JPMORGAN CHASE & CO	105,870	166.440	17,621,002.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	8,050	194.470	1,565,483.500	
LKQ CORP	10,250	50.450	517,112.500	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,830	150.750	275,872.500	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,962	80.700	884,633.400	
CADENCE DESIGN SYS INC	9,850	126.750	1,248,487.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,140	265.410	1,098,797.400	
DOLLAR GENERAL CORP	8,650	206.760	1,788,474.000	
SERVICENOW INC	6,810	460.650	3,137,026.500	
CATERPILLAR INC	18,950	244.020	4,624,179.000	
BROWN & BROWN INC	8,550	52.370	447,763.500	
ESSENTIAL UTILITIES INC	8,300	47.350	393,005.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,800	336.840	606,312.000	
CMS ENERGY CORP	10,200	62.620	638,724.000	
MOSAIC CO/THE	12,800	36.040	461,312.000	
DELTA AIR LINES INC	5,750	45.980	264,385.000	
CORNING INC	27,100	43.410	1,176,411.000	
CISCO SYSTEMS INC	146,250	54.070	7,907,737.500	
MORGAN STANLEY	49,102	93.960	4,613,623.920	
ZILLOW GROUP INC - A	2,100	110.450	231,945.000	
MSCI INC	2,930	466.360	1,366,434.800	
FAIR ISAAC CORP	1,000	490.340	490,340.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,200	341.460	409,752.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,200	73.230	600,486.000	
BROADCOM INC	14,182	475.000	6,736,450.000	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,150	145.600	604,240.000	
ARAMARK	7,800	35.960	280,488.000	
DTE ENERGY COMPANY	6,820	137.340	936,658.800	
CENTENE CORP	20,487	71.440	1,463,591.280	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,700	111.950	414,215.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,000	49.920	748,800.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,850	144.870	992,359.500	
GARTNER INC	3,150	234.410	738,391.500	
SPLUNK INC	5,710	112.410	641,861.100	
DOMINION ENERGY INC	27,641	76.520	2,115,089.320	
MONSTER BEVERAGE CORP	13,950	95.370	1,330,411.500	
SMITH (A.O.) CORP	4,650	69.050	321,082.500	
DEERE & CO	10,400	356.640	3,709,056.000	
POOL CORP	1,420	438.040	622,016.800	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,234	194.200	1,987,442.800	
VMWARE INC-CLASS A	2,830	161.370	456,677.100	
CABLE ONE INC	200	1,775.160	355,032.000	
BURLINGTON STORES INC	2,280	304.360	693,940.800	
NASDAQ INC	3,950	170.230	672,408.500	
VAIL RESORTS INC	1,360	333.380	453,396.800	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,450	128.560	314,972.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,630	140.290	368,962.700	
CONSOLIDATED EDISON INC	12,100	77.240	934,604.000	
COGNEX CORP	6,200	79.500	492,900.000	
TELEFLEX INC	1,600	395.230	632,368.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,900	167.080	484,532.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,620	333.430	873,586.600	
BIO-RAD LABORATORIES-A	790	581.280	459,211.200	
CATALENT INC	5,950	101.160	601,902.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4,850	288.290	1,398,206.500	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,000	249.000	498,000.000	
IDEX CORP	2,610	225.390	588,267.900	
COLGATE-PALMOLIVE CO	27,800	83.970	2,334,366.000	
ROLLINS INC	7,387	33.190	245,174.530	
AMETEK INC	8,125	137.700	1,118,812.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,500	86.470	734,995.000	

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,550	47.200	261,960.000	
HEICO CORP	1,400	146.790	205,506.000	
XPO LOGISTICS INC	3,100	141.870	439,797.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,220	327.400	726,828.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,310	325.420	426,300.200	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,450	116.200	1,098,090.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,400	403.220	564,508.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	15,410	387.520	5,971,683.200	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,800	104.280	291,984.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,000	482.300	964,600.000	
RPM INTERNATIONAL INC	4,600	94.940	436,724.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,000	1,326.340	1,326,340.000	
UGI CORP	7,050	46.580	328,389.000	
CUMMINS INC	5,050	264.220	1,334,311.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	27,100	96.840	2,624,364.000	
CDW CORP/DE	5,100	167.490	854,199.000	
COSTAR GROUP INC	1,410	841.000	1,185,810.000	
SVB FINANCIAL GROUP	1,790	596.060	1,066,947.400	
AMERCO	340	568.590	193,320.600	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,500	260.270	910,945.000	
MERCADOLIBRE INC	1,580	1,325.420	2,094,163.600	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,620	157.800	413,436.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	9,766	124.750	1,218,308.500	
IPG PHOTONICS CORP	1,300	209.070	271,791.000	
DEXCOM INC	3,420	382.910	1,309,552.200	
NORDSON CORP	1,910	224.160	428,145.600	
COPART INC	7,550	125.030	943,976.500	
SEAGEN INC	4,750	148.300	704,425.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,660	582.350	1,549,051.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,780	665.300	1,184,234.000	
BIO-TECHNE CORP	1,400	424.300	594,020.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,350	94.390	316,206.500	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,400	89.250	660,450.000	
KINDER MORGAN INC	71,681	18.780	1,346,169.180	
HCA HEALTHCARE INC	9,550	213.770	2,041,503.500	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,300	450.230	585,299.000	
T-MOBILE US INC	21,877	144.510	3,161,445.270	

ZILLOW GROUP INC - C	5,450	108.800	592,960.000	
COCA-COLA CO/THE	141,900	56.240	7,980,456.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	6,900	61.800	426,420.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,800	124.100	719,780.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	10,350	35.740	369,909.000	
CSX CORP	26,100	99.620	2,600,082.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,460	266.350	921,571.000	
EXPEDIA GROUP INC	4,925	171.420	844,243.500	
AUTOLIV INC	2,950	108.380	319,721.000	
AMAZON.COM INC	14,900	3,206.220	47,772,678.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	21,940	95.870	2,103,387.800	
EXXON MOBIL CORP	146,705	61.450	9,015,022.250	
AES CORP	23,500	24.960	586,560.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,350	259.370	350,149.500	
EOG RESOURCES INC	20,500	87.460	1,792,930.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5,750	116.130	667,747.500	
ABIOMED INC	1,610	289.510	466,111.100	
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,430	116.920	634,875.600	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,590	137.900	1,460,361.000	
FORD MOTOR CO	137,323	15.970	2,193,048.310	
NOVAVAX INC	2,600	183.010	475,826.000	
DISCOVERY INC - A	5,290	31.550	166,899.500	
EXACT SCIENCES CORP	5,950	106.830	635,638.500	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,637	26.820	151,184.340	
LIBERTY BROADBAND-A	850	158.380	134,623.000	
DISCOVERY INC-C	10,389	29.550	306,994.950	
FORTINET INC	4,800	221.760	1,064,448.000	
MARKEL CORP	480	1,228.170	589,521.600	
NEXTERA ENERGY INC	68,180	72.340	4,932,141.200	
MASIMO CORP	1,800	211.220	380,196.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	50,908	41.730	2,124,390.840	
INSULET CORP	2,340	271.840	636,105.600	
US BANCORP	49,850	60.770	3,029,384.500	
UNITED RENTALS INC	2,570	332.070	853,419.900	
F5 NETWORKS INC	2,100	188.760	396,396.000	
FASTENAL CO	20,250	53.070	1,074,667.500	
FISERV INC	21,133	113.400	2,396,482.200	

GENERAL ELECTRIC CO	305,250	13.960	4,261,290.000	
GENERAL MOTORS CO	45,300	63.370	2,870,661.000	
ZENDESK INC	4,150	132.840	551,286.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	8,550	193.570	1,655,023.500	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,100	391.450	4,736,545.000	
ALPHABET INC-CL A	10,450	2,393.570	25,012,806.500	
ALPHABET INC-CL C	10,237	2,451.760	25,098,667.120	
OWENS CORNING	3,650	105.000	383,250.000	
GENERAL MILLS INC	21,500	64.030	1,376,645.000	
FIRSTENERGY CORP	18,668	38.330	715,544.440	
GENUINE PARTS CO	5,100	129.950	662,745.000	
IHS MARKIT LTD	13,284	106.900	1,420,059.600	
FIFTH THIRD BANCORP	25,100	42.040	1,055,204.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,380	222.750	1,643,895.000	
HALLIBURTON CO	31,200	24.720	771,264.000	
HOME DEPOT INC	37,400	311.010	11,631,774.000	
ASSURANT INC	2,050	163.100	334,355.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	35,900	15.630	561,117.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,410	222.250	313,372.500	
HERSHEY CO/THE	5,190	174.900	907,731.000	
HUMANA INC	4,530	426.330	1,931,274.900	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,600	202.000	1,939,200.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,580	246.740	636,589.200	
HENRY SCHEIN INC	5,100	77.900	397,290.000	
HP INC	47,300	30.630	1,448,799.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	45,700	16.220	741,254.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,978	43.890	262,374.420	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,000	44.020	308,140.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	44.000	129,800.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,400	39.640	570,816.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	23,603	43.960	1,037,587.880	
ENPHASE ENERGY INC	4,340	134.700	584,598.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	31,050	147.420	4,577,391.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	13,200	64.650	853,380.000	

FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,900	103.090	505,141.000	
ZOETIS INC	16,250	175.200	2,847,000.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,229	181.640	1,494,715.560	
CHENIERE ENERGY INC	8,450	87.350	738,107.500	
ALLEGION PLC	3,100	138.830	430,373.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	26.890	348,843.970	
WASTE CONNECTIONS INC	9,237	121.340	1,120,817.580	
JUNIPER NETWORKS INC	11,300	27.800	314,140.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,870	139.820	541,103.400	
JOHNSON & JOHNSON	91,200	165.970	15,136,464.000	
PLUG POWER INC	17,600	30.580	538,208.000	
ABBVIE INC	61,372	112.360	6,895,757.920	
HOLOGIC INC	9,150	60.720	555,588.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	11,650	130.570	1,521,140.500	
KROGER CO	26,400	38.610	1,019,304.000	
KLA CORP	5,310	316.990	1,683,216.900	
LOCKHEED MARTIN CORP	8,830	394.100	3,479,903.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,780	277.000	770,060.000	
L BRANDS INC	8,500	65.710	558,535.000	
LOWE'S COS INC	24,900	189.910	4,728,759.000	
ELI LILLY & CO	29,185	202.020	5,895,953.700	
LAM RESEARCH CORP	4,920	655.310	3,224,125.200	
LOEWS CORP	8,300	58.060	481,898.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	71.130	472,943.370	
MCDONALD'S CORP	25,950	233.380	6,056,211.000	
3M CO	20,170	206.050	4,156,028.500	
FACEBOOK INC-CLASS A	83,600	330.350	27,617,260.000	
S&P GLOBAL INC	8,400	384.580	3,230,472.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,210	351.770	777,411.700	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	1,820	241.840	440,148.800	
PHILLIPS 66	15,400	91.480	1,408,792.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	42.770	686,458.500	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,750	89.810	785,837.500	
METLIFE INC	26,150	66.560	1,740,544.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	28,300	48.700	1,378,210.000	
ARISTA NETWORKS INC	2,020	350.320	707,646.400	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	62.850	301,680.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,958	209.950	1,250,882.100	

METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	800	1,256.820	1,005,456.000	
BAKER HUGHES CO	25,473	26.020	662,807.460	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,010	275.620	1,105,236.200	
MERCK & CO. INC.	87,821	74.110	6,508,414.310	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	85.570	1,775,663.070	
MASCO CORP	9,100	59.780	543,998.000	
M & T BANK CORP	4,439	161.270	715,877.530	
MARSH & MCLENNAN COS	17,800	139.670	2,486,126.000	
BLACK KNIGHT INC	5,600	73.240	410,144.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,500	136.150	340,375.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	9,722	142.060	1,381,107.320	
WORKDAY INC-CLASS A	6,350	223.310	1,418,018.500	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,580	321.030	828,257.400	
SQUARE INC - A	13,700	213.690	2,927,553.000	
TRANSUNION	6,500	105.710	687,115.000	
VISTRA CORP	15,650	17.400	272,310.000	
NOVOCURE LTD	3,250	205.710	668,557.500	
NETAPP INC	7,900	80.740	637,846.000	
NIKE INC -CL B	44,100	133.740	5,897,934.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,650	279.300	2,415,945.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,500	155.380	1,476,110.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,400	132.430	582,692.000	
ALLY FINANCIAL INC	13,200	55.290	729,828.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,530	377.510	2,087,630.300	
APTIV PLC	9,500	159.750	1,517,625.000	
NEWMONT CORP	27,461	71.450	1,962,088.450	
MCKESSON CORP	5,450	194.940	1,062,423.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	9,450	102.430	967,963.500	
XYLEM INC	6,370	119.240	759,558.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	54,200	97.900	5,306,180.000	
NUCOR CORP	10,650	108.780	1,158,507.000	
SUNRUN INC	6,100	42.310	258,091.000	
WESTERN UNION CO	14,046	25.030	351,571.380	
GODADDY INC - CLASS A	6,000	80.830	484,980.000	
NEWELL BRANDS INC	13,442	28.270	380,005.340	
EVERGY INC	7,750	62.720	486,080.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	32,924	29.140	959,405.360	

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	900	194.880	175,392.000	
OKTA INC	4,280	213.360	913,180.800	
COUPA SOFTWARE INC	2,550	230.230	587,086.500	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	161.990	907,144.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	15,005	34.180	512,870.900	
LINDE PLC	17,846	299.860	5,351,301.560	
WIX.COM LTD	2,030	256.300	520,289.000	
EQUITABLE HOLDINGS INC	13,300	31.380	417,354.000	
KKR & CO INC	18,300	55.400	1,013,820.000	
PAYCHEX INC	11,450	102.560	1,174,312.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,480	526.590	1,305,943.200	
ALTRIA GROUP INC	64,700	49.770	3,220,119.000	
P G & E CORP	52,300	10.380	542,874.000	
PFIZER INC	193,613	39.150	7,579,948.950	
CIGNA CORP	12,360	252.940	3,126,338.400	
DELL TECHNOLOGIES -C	9,351	103.530	968,109.030	
ALTICE USA INC- A	10,900	33.780	368,202.000	
XCEL ENERGY INC	19,000	70.080	1,331,520.000	
STERIS PLC	3,030	193.610	586,638.300	
SEA LTD-ADR	600	256.820	154,092.000	
FOX CORP - CLASS B	5,433	35.670	193,795.110	
FOX CORP - CLASS A	11,549	37.190	429,507.310	
STRYKER CORP	11,570	251.830	2,913,673.100	
LYFT INC-A	9,200	57.400	528,080.000	
DOW INC	26,068	70.370	1,834,405.160	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,550	82.260	292,023.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	7,200	336.000	2,419,200.000	
PARKER HANNIFIN CORP	4,540	309.040	1,403,041.600	
UBER TECHNOLOGIES INC	42,350	50.180	2,125,123.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,250	170.300	1,234,675.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	85,467	135.950	11,619,238.650	
EXELON CORP	34,372	45.600	1,567,363.200	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,800	177.120	1,381,536.000	
TELADOC HEALTH INC	4,750	146.570	696,207.500	
INGERSOLL-RAND INC	13,158	49.210	647,505.180	
NVR INC	120	4,810.000	577,200.000	
CONOCOPHILLIPS	46,252	59.850	2,768,182.200	

TWILIO INC - A	5,650	309.910	1,750,991.500	
DOCUSIGN INC	6,600	233.240	1,539,384.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,810	322.280	583,326.800	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	4,750	86.430	410,542.500	
PEPSICO INC	47,900	147.840	7,081,536.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,500	125.970	188,955.000	
DROPBOX INC-CLASS A	10,500	28.500	299,250.000	
MONGODB INC	1,920	315.270	605,318.400	
SNAP INC - A	33,000	61.000	2,013,000.000	
CORTEVA INC	26,218	45.960	1,204,979.280	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,000	108.440	1,518,160.000	
AMCOR PLC	54,000	12.150	656,100.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6,330	206.940	1,309,930.200	
ROKU INC	3,850	327.120	1,259,412.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,400	156.430	1,001,152.000	
ACCENTURE PLC-CL A	22,000	283.170	6,229,740.000	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	16,700	44.170	737,639.000	
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,600	180.180	468,468.000	
PENTAIR PLC	5,925	69.520	411,906.000	
QUALCOMM INC	39,450	134.340	5,299,713.000	
INVESCO LTD	13,000	29.270	380,510.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,350	192.760	452,986.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,650	65.940	636,321.000	
DATADOG INC - CLASS A	6,200	88.450	548,390.000	
PINTEREST INC- CLASS A	18,800	62.890	1,182,332.000	
AVALARA INC	3,050	124.800	380,640.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,700	511.890	1,893,993.000	
REPUBLIC SERVICES INC	7,900	109.230	862,917.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,400	2,315.690	3,241,966.000	
ROSS STORES INC	12,550	119.470	1,499,348.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,250	146.760	476,970.000	
RESMED INC	5,150	205.310	1,057,346.500	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,730	128.880	609,602.400	
ROBERT HALF INTL INC	3,900	90.380	352,482.000	
MODERNA INC	11,150	206.070	2,297,680.500	
HUBSPOT INC	1,500	490.210	735,315.000	

PERKINELMER INC	3,930	138.960	546,112.800	
CARRIER GLOBAL CORP	29,087	45.890	1,334,802.430	
OTIS WORLDWIDE CORP	14,568	79.870	1,163,546.160	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,800	57.410	332,978.000	
AVANTOR INC	18,400	31.300	575,920.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	5,700	43.320	246,924.000	
DYNATRACE INC	6,100	50.930	310,673.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,500	574.750	862,125.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	33,835	22.630	765,686.050	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	5,900	45.210	266,739.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,680	153.160	410,468.800	
MATCH GROUP INC	9,020	137.930	1,244,128.600	
CHEVRON CORP	66,818	108.450	7,246,412.100	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	8,850	103.010	911,638.500	
ZSCALER INC	2,850	185.800	529,530.000	
EDISON INTERNATIONAL	13,450	56.470	759,521.500	
ETSY INC	4,450	164.180	730,601.000	
TESLA INC	26,670	599.050	15,976,663.500	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,000	242.560	242,560.000	
NORTONLIFELOCK INC	20,550	28.450	584,647.500	
DRAFTKINGS INC - CL A	6,250	50.330	314,562.500	
UNITY SOFTWARE INC	2,100	95.080	199,668.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,672	212.850	1,207,285.200	
SYNOPSYS INC	5,360	255.880	1,371,516.800	
CARVANA CO	2,480	279.870	694,077.600	
CHEWY INC - CLASS A	2,900	75.210	218,109.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	7,950	83.080	660,486.000	
PPD INC	4,400	46.420	204,248.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,785	682.650	3,266,480.250	
VIATRIS INC	43,321	15.390	666,710.190	
AIRBNB INC-CLASS A	2,150	150.730	324,069.500	
CBRE GROUP INC - A	11,800	87.970	1,038,046.000	
TWITTER INC	28,050	59.000	1,654,950.000	
SOUTHERN CO/THE	36,950	64.350	2,377,732.500	
SYSCO CORP	18,000	79.610	1,432,980.000	
TRAVELERS COS INC/THE	8,703	160.000	1,392,480.000	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,000	154.700	309,400.000	

SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	64.450	277,135.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,200	64.860	466,992.000	
SCHLUMBERGER LTD	49,152	36.420	1,790,115.840	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,400	60.970	329,238.000	
AT&T INC	247,791	29.270	7,252,842.570	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,050	58.550	295,677.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	14,600	38.210	557,866.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,500	110.640	829,800.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8,970	283.200	2,540,304.000	
SEMPRA ENERGY	11,170	136.420	1,523,811.400	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,500	61.700	401,050.000	
CLARIVATE PLC	12,500	32.160	402,000.000	
OAK STREET HEALTH INC	3,600	60.410	217,476.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	19,000	24.030	456,570.000	
ORGANON & CO	8,782	34.150	299,905.300	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,950	99.120	788,004.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	31,900	190.070	6,063,233.000	
SALESFORCE.COM INC	31,821	237.480	7,556,851.080	
WESTROCK CO	9,330	58.970	550,190.100	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	25,334	66.730	1,690,537.820	
TERADYNE INC	5,700	131.680	750,576.000	
UNION PACIFIC CORP	22,830	226.170	5,163,461.100	
MARATHON PETROLEUM CORP	22,938	63.670	1,460,462.460	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	52,879	89.020	4,707,288.580	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	25,000	210.630	5,265,750.000	
IQVIA HOLDINGS INC	6,744	233.840	1,577,016.960	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	65.270	283,924.500	
AMEREN CORPORATION	8,900	86.130	766,557.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	32,916	405.640	13,352,046.240	
VERISIGN INC	3,500	219.260	767,410.000	
VALERO ENERGY CORP	14,392	83.240	1,197,990.080	
ULTA BEAUTY INC	1,890	326.620	617,311.800	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9,888	47.090	465,625.920	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,650	159.760	423,364.000	
ANTHEM INC	8,500	393.200	3,342,200.000	
WALT DISNEY CO/THE	62,862	177.180	11,137,889.160	
WELLS FARGO & CO	144,822	46.960	6,800,841.120	

WASTE MANAGEMENT INC	14,850	140.750	2,090,137.500	
WILLIAMS COS INC	42,750	27.950	1,194,862.500	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,050	181.060	733,293.000	
WHIRLPOOL CORP	2,220	233.540	518,458.800	
WALMART INC	54,450	141.850	7,723,732.500	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,350	159.130	1,169,605.500	
WYNN RESORTS LTD	3,700	128.160	474,192.000	
WABTEC CORP	6,211	82.820	514,395.020	
TJX COMPANIES INC	41,800	65.640	2,743,752.000	
WATERS CORP	2,230	319.260	711,949.800	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,890	516.570	976,317.300	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	25,900	54.850	1,420,615.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,543	259.730	1,179,953.390	
WESTERN DIGITAL CORP	10,800	77.170	833,436.000	
WEC ENERGY GROUP INC	11,130	93.590	1,041,656.700	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	17,850	61.270	1,093,669.500	
VISA INC-CLASS A SHARES	58,900	230.140	13,555,246.000	
PPL CORP	27,000	28.990	782,730.000	
PULTEGROUP INC	9,450	56.950	538,177.500	
PPG INDUSTRIES INC	8,350	182.330	1,522,455.500	
NORTHERN TRUST CORP	7,000	120.390	842,730.000	
NVIDIA CORP	21,470	703.130	15,096,201.100	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	14,513	194.000	2,815,522.000	
TYSON FOODS INC-CL A	10,450	78.650	821,892.500	
NETFLIX INC	15,370	494.740	7,604,153.800	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	13,670	448.760	6,134,549.200	
NRG ENERGY INC	8,650	33.900	293,235.000	
GLOBE LIFE INC	3,425	106.490	364,728.250	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,150	195.020	1,199,373.000	
TEXTRON INC	8,000	69.100	552,800.000	
NEWS CORP - CLASS A	13,137	26.220	344,452.140	
OMNICOM GROUP	7,600	82.800	629,280.000	
ORACLE CORP	66,333	82.890	5,498,342.370	
MASTERCARD INC - A	30,750	366.020	11,255,115.000	

ONEOK INC	15,700	53.950	847,015.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	32,952	14.750	486,042.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,620	451.050	1,632,801.000	
YUM! BRANDS INC	10,350	118.770	1,229,269.500	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	4,050	184.450	747,022.500	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,500	60.110	390,715.000	
BANK OF AMERICA CORP	269,301	43.270	11,652,654.270	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,640	422.160	692,342.400	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,400	77.890	498,496.000	
AMERICAN EXPRESS CO	23,800	165.000	3,927,000.000	
ANALOG DEVICES INC	12,649	165.580	2,094,421.420	
ADVANCED MICRO DEVICES	42,450	81.580	3,463,071.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,422	53.420	1,625,143.240	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,680	170.410	967,928.800	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,100	94.070	761,967.000	
AVERY DENNISON CORP	2,930	220.320	645,537.600	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	18,300	71.500	1,308,450.000	
EMERSON ELECTRIC CO	21,050	98.210	2,067,320.500	
AON PLC-CLASS A	7,820	251.020	1,962,976.400	
AMGEN INC	19,750	236.850	4,677,787.500	
EATON CORP PLC	13,636	148.510	2,025,082.360	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,850	239.250	1,399,612.500	
APPLIED MATERIALS INC	31,900	139.850	4,461,215.000	
CME GROUP INC	12,250	218.370	2,675,032.500	
ECOLAB INC	9,050	215.460	1,949,913.000	
EQUIFAX INC	4,300	233.400	1,003,620.000	
GILEAD SCIENCES INC	43,950	67.430	2,963,548.500	
KEURIG DR PEPPER INC	24,700	36.910	911,677.000	
HORMEL FOODS CORP	10,550	49.430	521,486.500	
STATE STREET CORP	12,463	86.900	1,083,034.700	
SCHWAB (CHARLES) CORP	52,090	75.720	3,944,254.800	
BAXTER INTERNATIONAL INC	17,500	82.250	1,439,375.000	
CAMPBELL SOUP CO	7,000	49.680	347,760.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,750	100.440	477,090.000	
CARDINAL HEALTH INC	10,400	56.560	588,224.000	
FEDEX CORP	8,800	302.120	2,658,656.000	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,704	166.260	2,610,947.040	
FMC CORP	4,400	118.350	520,740.000	
CERNER CORP	10,850	80.350	871,797.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,713	143.000	1,245,959.000	
CITRIX SYSTEMS INC	4,350	119.140	518,259.000	
INTEL CORP	141,200	57.370	8,100,644.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	13,400	33.740	452,116.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,650	65.790	832,243.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	11,050	235.810	2,605,700.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,600	6.470	223,862.000	
ILLUMINA INC	5,000	418.120	2,090,600.000	
SEALED AIR CORP	5,400	58.350	315,090.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,030	831.450	3,350,743.500	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,050	119.990	485,959.500	
SNAP-ON INC	1,930	254.340	490,876.200	
CARMAX INC	5,800	114.050	661,490.000	
DUKE ENERGY CORP	26,928	101.480	2,732,653.440	
TARGET CORP	17,400	231.340	4,025,316.000	
DOVER CORP	4,950	153.150	758,092.500	
WW GRAINGER INC	1,580	464.650	734,147.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,430	143.400	635,262.000	
CINTAS CORP	3,330	352.200	1,172,826.000	
CONAGRA BRANDS INC	17,300	38.920	673,316.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	5,050	84.000	424,200.000	
CLOROX COMPANY	4,430	179.010	793,014.300	
ENTERGY CORP	7,070	105.920	748,854.400	
MICROSOFT CORP	249,500	250.790	62,572,105.000	
INCYTE CORP	6,580	83.330	548,311.400	
CVS HEALTH CORP	45,619	86.470	3,944,674.930	
MEDTRONIC PLC	46,898	123.850	5,808,317.300	
MICRON TECHNOLOGY INC	39,050	83.760	3,270,828.000	
BLACKROCK INC	5,300	886.850	4,700,305.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	19,500	25.400	495,300.000	
HASBRO INC	4,400	95.240	419,056.000	
KELLOGG CO	8,800	66.630	586,344.000	
KEYCORP	34,000	22.730	772,820.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,250	298.420	969,865.000	

	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	48,811	64.020	3,124,880.220	
	COOPER COS INC/THE	1,770	381.960	676,069.200	
	CHUBB LTD	15,419	173.010	2,667,641.190	
	ARROW ELECTRONICS INC	2,700	122.080	329,616.000	
	ALLSTATE CORP	10,650	136.230	1,450,849.500	
	EBAY INC	23,550	65.230	1,536,166.500	
	PAYPAL HOLDINGS INC	38,600	263.040	10,153,344.000	
	EASTMAN CHEMICAL CO	4,800	129.310	620,688.000	
	XILINX INC	8,650	128.630	1,112,649.500	
	DISH NETWORK CORP-A	8,200	45.110	369,902.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,070	303.350	2,448,034.500	
	TRIMBLE INC	8,550	79.820	682,461.000	
	LENNAR CORP-A	9,700	96.600	937,020.000	
	LEAR CORP	2,150	201.420	433,053.000	
	PROGRESSIVE CORP	20,550	100.360	2,062,398.000	
	PACCAR INC	12,237	94.930	1,161,658.410	
	BIOGEN INC	5,370	286.140	1,536,571.800	
	IDEXX LABORATORIES INC	3,030	558.360	1,691,830.800	
	STARBUCKS CORP	41,000	111.990	4,591,590.000	
	PTC INC	3,820	132.540	506,302.800	
	EVERSOURCE ENERGY	12,110	82.040	993,504.400	
	INTUIT INC	9,550	461.930	4,411,431.500	
	BORGWARNER INC	8,200	54.450	446,490.000	
	BEST BUY CO INC	8,250	115.990	956,917.500	
	BALL CORP	11,534	82.540	952,016.360	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	48,897	42.030	2,055,140.910	
	ELECTRONIC ARTS INC	9,970	145.210	1,447,743.700	
	VULCAN MATERIALS CO	4,700	179.600	844,120.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,150	209.930	1,920,859.500	
	VF CORP	11,800	79.030	932,554.000	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	20,025	41.700	835,042.500	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,050	201.410	412,890.500	
	CARNIVAL CORP	28,900	30.540	882,606.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	158,690	57.000	9,045,330.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	7,900	63.200	499,280.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,300	4.950	199,485.000	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 1,299,199,008.260	

				(142,353,235,334)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	709,500	3.194	2,266,497.750	
	UNILEVER PLC	91,360	42.730	3,903,812.800	
	BARCLAYS PLC	606,300	1.839	1,115,349.480	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	279,500	1.073	299,959.400	
	PRUDENTIAL PLC	91,000	14.735	1,340,885.000	
	NATWEST GROUP PLC	166,791	2.076	346,258.110	
	EVRAZ PLC	17,400	6.494	112,995.600	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,464	31.900	206,201.600	
	BAE SYSTEMS PLC	112,500	5.326	599,175.000	
	AVIVA PLC	137,566	4.095	563,332.770	
	AVEVA GROUP PLC	3,800	35.010	133,038.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	175,500	13.542	2,376,621.000	
	INFORMA PLC	52,700	5.406	284,896.200	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	165,600	1.686	279,284.400	
	AUTO TRADER GROUP PLC	31,900	5.578	177,938.200	
	DCC PLC	3,400	61.000	207,400.000	
	OCADO GROUP PLC	16,300	18.840	307,092.000	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,600	129.450	336,570.000	
	HALMA PLC	12,900	26.400	340,560.000	
	ENTAIN PLC	20,000	17.330	346,600.000	
	JD SPORTS FASHION PLC	17,200	9.342	160,682.400	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	21,000	7.414	155,694.000	
	M&G PLC	91,700	2.462	225,765.400	
	RELX PLC	67,446	18.470	1,245,727.620	
	DIAGEO PLC	81,500	33.960	2,767,740.000	
	RIO TINTO PLC	39,100	62.190	2,431,629.000	
	STANDARD CHARTERED PLC	91,800	4.959	455,236.200	
	TESCO PLC	269,684	2.250	606,789.000	
	SMITH & NEPHEW PLC	30,650	15.010	460,056.500	
	GLENCORE PLC	348,225	3.297	1,148,271.930	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,450	16.515	205,611.750	
	SMITHS GROUP PLC	13,183	15.535	204,797.900	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	46,583	2.987	139,143.420	
	PEARSON PLC	25,763	8.426	217,079.030	
	SAINSBURY (J) PLC	59,525	2.654	157,979.350	

NEXT PLC	4,650	81.960	381,114.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	127,700	1.714	218,877.800	
WHITBREAD PLC	6,861	32.330	221,816.130	
BUNZL PLC	11,905	22.720	270,481.600	
VODAFONE GROUP PLC	935,183	1.279	1,196,473.130	
CRODA INTERNATIONAL PLC	4,711	69.680	328,262.480	
KINGFISHER PLC	73,711	3.447	254,081.810	
WPP PLC	42,900	9.974	427,884.600	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	22,827	10.020	228,726.540	
SEVERN TRENT PLC	8,583	24.690	211,914.270	
RENTOKIL INITIAL PLC	64,000	4.791	306,624.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	24,900	64.870	1,615,263.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	17,950	14.295	256,595.250	
SCHRODERS PLC	4,150	35.830	148,694.500	
SSE PLC	36,300	15.385	558,475.500	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	34,000	7.558	256,972.000	
ASTRAZENECA PLC	45,700	80.550	3,681,135.000	
FERGUSON PLC	7,837	98.240	769,906.880	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	208,000	2.791	580,528.000	
3I GROUP PLC	33,191	12.520	415,551.320	
ASHTEAD GROUP PLC	15,650	52.000	813,800.000	
SAGE GROUP PLC/THE	37,214	6.562	244,198.260	
NATIONAL GRID PLC	123,634	9.143	1,130,385.660	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,468,465	0.489	1,207,943.340	
IMPERIAL BRANDS PLC	33,000	15.975	527,175.000	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,150	46.780	194,137.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	78,360	27.340	2,142,362.400	
BHP GROUP PLC	73,627	21.700	1,597,705.900	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	12,150	22.990	279,328.500	
HSBC HOLDINGS PLC	708,650	4.439	3,146,051.670	
ANGLO AMERICAN PLC	45,383	32.545	1,476,989.730	
MONDI PLC	16,600	19.105	317,143.000	
WM MORRISON SUPERMARKETS	80,500	1.769	142,404.500	
COMPASS GROUP PLC	62,139	16.060	997,952.340	
PERSIMMON PLC	11,200	31.510	352,912.000	
BT GROUP PLC	311,100	1.770	550,647.000	
COCA-COLA HBC AG-DI	7,150	26.100	186,615.000	

	BURBERRY GROUP PLC	14,289	21.770	311,071.530	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	6,436	49.580	319,096.880	
	INTERTEK GROUP PLC	5,500	53.200	292,600.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	11,399	75.780	863,816.220	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	142,900	13.936	1,991,454.400	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	129,218	13.280	1,716,015.040	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,700	24.090	137,313.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,600	30.550	201,630.000	
	ANTOFAGASTA PLC	14,100	15.655	220,735.500	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	77,862	2.779	216,378.490	
	EXPERIAN PLC	31,954	26.620	850,615.480	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 60,884,526.460 (9,449,887,352)	
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	40,100	16.080	644,808.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,400	242.000	338,800.000	
	ICL GROUP LTD	28,100	24.520	689,012.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	950	423.100	401,945.000	
	BANK HAPOALIM BM	44,100	27.480	1,211,868.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,200	25.320	1,422,984.000	
	NICE LTD	2,400	700.100	1,680,240.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,400	100.700	543,780.000	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 6,933,437.000 (233,738,641)	
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	3.170	281,496.000	
	BHP GROUP LTD	100,000	48.750	4,875,000.000	
	SOUTH32 LTD	160,100	3.040	486,704.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	32,050	24.070	771,443.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	56,500	22.970	1,297,805.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	111,350	27.510	3,063,238.500	
	WESTPAC BANKING CORP	124,548	26.870	3,346,604.760	
	SANTOS LTD	62,900	7.720	485,588.000	
	AUSNET SERVICES	65,000	1.785	116,025.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	96,250	29.200	2,810,500.000	

RIO TINTO LTD	12,700	124.620	1,582,674.000	
ORIGIN ENERGY LTD	59,000	4.720	278,480.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	3.720	223,200.000	
XERO LTD	4,550	129.410	588,815.500	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	30.080	102,272.000	
COLES GROUP LTD	45,045	17.040	767,566.800	
WISETECH GLOBAL LTD	5,400	28.560	154,224.000	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	37,000	10.910	403,670.000	
EVOLUTION MINING LTD	59,500	5.020	298,690.000	
AFTERPAY LTD	7,300	94.480	689,704.000	
REECE LTD	10,500	22.750	238,875.000	
OIL SEARCH LTD	64,200	4.130	265,146.000	
SEEK LTD	11,700	30.520	357,084.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	23,500	11.940	280,590.000	
NEWCREST MINING LTD	27,000	27.450	741,150.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	59,750	102.520	6,125,570.000	
AMPOL LTD	7,950	29.630	235,558.500	
ORICA LTD	13,100	14.080	184,448.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	49,150	11.330	556,869.500	
WOOLWORTHS GROUP LTD	43,100	43.350	1,868,385.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	72,763	5.130	373,274.190	
CROWN RESORTS LTD	13,400	12.690	170,046.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	30,500	4.870	148,535.000	
TELSTRA CORP LTD	143,500	3.580	513,730.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	14,950	42.950	642,102.500	
MACQUARIE GROUP LTD	11,634	154.000	1,791,636.000	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	19,350	40.950	792,382.500	
CSL LTD	15,350	291.370	4,472,529.500	
WESFARMERS LTD	38,600	55.240	2,132,264.000	
COCHLEAR LTD	2,200	228.850	503,470.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	22.450	365,935.000	
SUNCORP GROUP LTD	43,657	11.300	493,324.100	
ASX LTD	6,700	76.780	514,426.000	
COMPUTERSHARE LTD	18,200	16.250	295,750.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	80,336	5.230	420,157.280	
SONIC HEALTHCARE LTD	15,150	35.160	532,674.000	
AGL ENERGY LTD	21,500	8.820	189,630.000	

	BRAMBLES LTD	50,400	10.970	552,888.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,150	62.910	386,896.500	
	REA GROUP LTD	1,800	163.460	294,228.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,400	49.750	218,900.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	116.320	255,904.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 49,538,059.630 (4,199,341,315)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	9,100	41.080	373,828.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	700	1,764.460	1,235,122.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	9,687	83.500	808,864.500	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	15,400	58.410	899,514.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,850	171.150	830,077.500	
	BCE INC	4,930	61.070	301,075.100	
	FRANCO-NEVADA CORP	6,700	183.740	1,231,058.000	
	SUNCOR ENERGY INC	52,230	30.790	1,608,161.700	
	METRO INC/CN	8,600	58.400	502,240.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	11,600	92.980	1,078,568.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	42,100	81.210	3,418,941.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	15,550	145.190	2,257,704.500	
	TORONTO-DOMINION BANK	62,800	87.960	5,523,888.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	9,800	37.020	362,796.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	49,250	126.210	6,215,842.500	
	TC ENERGY CORP	32,750	63.510	2,079,952.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,829	38.480	724,539.920	
	BARRICK GOLD CORP	60,800	28.340	1,723,072.000	
	CAE INC	9,500	37.520	356,440.000	
	THOMSON REUTERS CORP	5,912	118.950	703,232.400	
	EMPIRE CO LTD 'A'	5,900	41.280	243,552.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,800	89.170	249,676.000	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	7,800	20.500	159,900.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,050	69.240	349,662.000	
	HYDRO ONE LTD	11,300	30.940	349,622.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	5,960	75.290	448,728.400	
	NORTHLAND POWER INC	7,900	40.720	321,688.000	
	WSP GLOBAL INC	3,900	136.260	531,414.000	

TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,800	108.050	302,540.000	
PARKLAND CORP	5,100	40.670	207,417.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	33.120	198,720.000	
EMERA INC	8,300	56.770	471,191.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	35.410	169,968.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	12,200	63.080	769,576.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	22,500	8.770	197,325.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	8,200	85.370	700,034.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	20,100	18.810	378,081.000	
B2GOLD CORP	34,700	6.060	210,282.000	
AIR CANADA	5,500	27.000	148,500.000	
KINROSS GOLD CORP	43,200	9.650	416,880.000	
BANK OF MONTREAL	22,500	128.000	2,880,000.000	
POWER CORP OF CANADA	19,100	40.100	765,910.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,900	1,457.150	5,682,885.000	
NUTRIEN LTD	19,519	77.970	1,521,896.430	
CANOPY GROWTH CORP	7,400	29.290	216,746.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,800	51.690	454,872.000	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,200	51.260	215,292.000	
CAMECO CORP	14,000	25.830	361,620.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,400	199.260	278,964.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,500	38.360	249,340.000	
LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	3,500	86.720	303,520.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,900	83.390	158,441.000	
TELUS CORP	10,800	27.880	301,104.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	16,100	29.850	480,585.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,000	201.840	403,680.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	40,500	45.420	1,839,510.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	569.780	512,802.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,600	125.240	1,202,304.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,537	118.830	301,471.710	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,000	39.040	273,280.000	
BLACKBERRY LTD	17,800	16.740	297,972.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	20,050	65.210	1,307,460.500	
ENBRIDGE INC	70,200	47.170	3,311,334.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	44,525	60.490	2,693,317.250	
MANULIFE FINANCIAL CORP	66,300	25.250	1,674,075.000	

	BAUSCH HEALTH COS INC	10,500	37.820	397,110.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	23,400	97.890	2,290,626.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	3,700	69.880	258,556.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,000	44.130	308,910.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	24,650	135.850	3,348,702.500	
	CGI INC - CLASS A	7,900	109.040	861,416.000	
	ONEX CORPORATION	2,600	88.360	229,736.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	16,000	36.140	578,240.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,100	45.170	140,027.000	
	TMX GROUP LTD	1,900	133.210	253,099.000	
	OPEN TEXT CORP	9,400	58.680	551,592.000	
	SAPUTO INC	8,700	37.580	326,946.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	20,400	29.070	593,028.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	29,500	44.850	1,323,075.000	
	YAMANA GOLD INC	32,300	6.260	202,198.000	
	FORTIS INC	15,800	55.250	872,950.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,800	71.950	273,410.000	
	LUNDIN MINING CORP	22,100	12.860	284,206.000	
	CENOVUS ENERGY INC	43,900	11.380	499,582.000	
	DOLLARAMA INC	10,200	53.940	550,188.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,900	44.230	128,267.000	
	ALTAGAS LTD	9,100	24.540	223,314.000	
	KEYERA CORP	7,400	32.910	243,534.000	
	INTER PIPELINE LTD	14,300	20.310	290,433.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 81,777,201.410 (7,415,556,624)	
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	44,000	26.100	1,148,400.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	67,400	29.710	2,002,454.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	48,475	4.900	237,527.500	
	KEPPEL CORP LTD	56,300	5.320	299,516.000	
	UOL GROUP LTD	17,100	7.370	126,027.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	7.720	124,292.000	
	CAPITALAND LTD	102,400	3.660	374,784.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	125,900	12.360	1,556,124.000	
	SINGAPORE AIRLINES-MCB RTS	101,312	0.001	101.310	

	GENTING SINGAPORE LTD	209,000	0.875	182,875.000	
	VENTURE CORP LTD	9,900	18.960	187,704.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	312,150	2.380	742,917.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	56,500	3.850	217,525.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	31,500	10.370	326,655.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,400	4.750	353,400.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 7,880,301.810 (652,094,975)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	124,650	14.760	1,839,834.000	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,100	342.600	376,860.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	853.500	238,980.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,150	62.820	323,523.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	24,130	319.900	7,719,187.000	
	SIKA AG-REG	4,810	292.100	1,405,001.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	91,400.000	365,600.000	
	ABB LTD-REG	62,700	31.410	1,969,407.000	
	SWISS RE AG	10,450	86.260	901,417.000	
	NESTLE SA-REG	98,900	112.900	11,165,810.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	780	1,365.000	1,064,700.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,380	271.600	374,808.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	84,370	9.968	841,000.160	
	JULIUS BAER GROUP LTD	7,400	61.640	456,136.000	
	SGS SA-REG	200	2,769.000	553,800.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	690	263.000	181,470.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,450	134.000	194,300.000	
	TEMENOS AG - REG	2,300	141.400	325,220.000	
	ALCON INC	17,280	63.160	1,091,404.800	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	970	324.200	314,474.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,192	377.500	1,959,980.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,570	148.000	232,360.000	
	CLARIANT AG-REG	6,650	19.685	130,905.250	
	NOVARTIS AG-REG	76,250	81.020	6,177,775.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	120	2,038.000	244,560.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	17,710	113.500	2,010,085.000	
	SWISSCOM AG-REG	870	515.600	448,572.000	

	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,010	84.500	85,345.000	
	GEBERIT AG-REG	1,300	659.400	857,220.000	
	GIVAUDAN-REG	310	4,086.000	1,266,660.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	340	1,423.000	483,820.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,922	315.800	606,967.600	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,000	118.700	712,200.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,600	586.800	1,525,680.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	62.400	94,848.000	
	HOLCIM LTD	17,790	54.520	969,910.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,110	460.800	511,488.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,800	312.600	562,680.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,510	92.650	232,551.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	8,590.000	292,060.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 51,108,600.110 (6,228,605,095)	
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	406.000	1,429,120.000	
	ERICSSON LM-B SHS	108,330	108.800	11,786,304.000	
	VOLVO AB-B SHS	53,150	228.000	12,118,200.000	
	SKF AB-B SHARES	13,300	229.000	3,045,700.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	7,600	236.800	1,799,680.000	
	SWEDISH MATCH AB	61,300	77.240	4,734,812.000	
	TELE2 AB-B SHS	16,800	112.500	1,890,000.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	59,200	108.400	6,417,280.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	54,850	93.700	5,139,445.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,100	154.280	5,260,948.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	28,200	209.300	5,902,260.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	22,900	137.150	3,140,735.000	
	SKANSKA AB-B SHS	12,850	238.500	3,064,725.000	
	SANDVIK AB	42,000	225.200	9,458,400.000	
	INVESTOR AB-B SHS	67,600	194.750	13,165,100.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	25,000	509.800	12,745,000.000	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	235.000	1,880,000.000	
	SECURITAS AB-B SHS	10,950	134.600	1,473,870.000	
	TELIA CO AB	100,200	36.350	3,642,270.000	
	ALFA LAVAL AB	11,000	305.800	3,363,800.000	

	ATLAS COPCO AB-B SHS	14,100	434.000	6,119,400.000	
	ASSA ABLOY AB-B	37,050	256.100	9,488,505.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,900	346.000	1,349,400.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	3,600	551.400	1,985,040.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,600	536.600	1,395,160.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,200	274.100	1,425,320.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	44,800	90.140	4,038,272.000	
	LUNDIN ENERGY AB	7,550	296.400	2,237,820.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,000	289.100	6,649,300.000	
	EMBRACER GROUP AB	10,000	240.000	2,400,000.000	
	BOLIDEN AB	10,400	345.700	3,595,280.000	
	EPIROC AB-A	24,950	185.300	4,623,235.000	
	EPIROC AB-B	13,500	162.550	2,194,425.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	14,150	124.150	1,756,722.500	
	NORDEA BANK ABP	119,600	92.150	11,021,140.000	
	EQT AB	9,100	304.800	2,773,680.000	
	EVOLUTION AB	6,350	1,563.200	9,926,320.000	
	SINCH AB	1,800	1,571.500	2,828,700.000	
	KINNEVIK AB - B	8,300	314.800	2,612,840.000	
	HEXAGON AB-B SHS	71,400	121.700	8,689,380.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,700	331.300	1,888,410.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 200,455,998.500 (2,654,037,419)	
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	63,700	491.550	31,311,735.000	
	DANSKE BANK A/S	26,000	113.850	2,960,100.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	120	17,300.000	2,076,000.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	37,450	225.600	8,448,720.000	
	GN STORE NORD A/S	4,550	505.800	2,301,390.000	
	CARLSBERG AS-B	3,900	1,106.500	4,315,350.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,850	449.100	3,525,435.000	
	COLOPLAST-B	4,500	982.400	4,420,800.000	
	DSV PANALPINA A/S	7,660	1,471.500	11,271,690.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	300	3,129.000	938,700.000	
	DEMANT A/S	3,875	345.300	1,338,037.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	220	18,070.000	3,975,400.000	
	TRYG A/S	13,200	146.500	1,933,800.000	

	PANDORA A/S	3,800	818.800	3,111,440.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,750	544.800	2,043,000.000	
	GENMAB A/S	2,460	2,485.000	6,113,100.000	
	ORSTED A/S	7,050	874.600	6,165,930.000	
	AMBU A/S-B	6,300	230.400	1,451,520.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 97,702,147.500 (1,751,799,504)	
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	47,500	5.325	252,937.500	
	MERCURY NZ LTD	23,000	6.830	157,090.000	
	A2 MILK CO LTD	26,200	6.070	159,034.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	68,789	4.660	320,556.740	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	45,700	7.610	347,777.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	22,200	29.000	643,800.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	16,500	12.800	211,200.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 2,092,395.240 (165,236,453)	
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	50,700	55.240	2,800,668.000	
	DNB ASA	33,950	188.850	6,411,457.500	
	ORKLA ASA	26,950	87.300	2,352,735.000	
	TELENOR ASA	25,400	144.000	3,657,600.000	
	EQUINOR ASA	36,723	191.060	7,016,296.380	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,800	412.300	1,154,440.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,660	455.900	3,036,294.000	
	MOWI ASA	16,600	229.400	3,808,040.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	188.900	1,388,415.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,650	349.000	1,273,850.000	
	ADEVINTA ASA	10,600	159.150	1,686,990.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 34,586,785.880 (456,199,706)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	33,870	52.660	1,783,594.200	
	EVONIK INDUSTRIES AG	7,000	29.230	204,610.000	

DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	71,250	12.374	881,647.500	
COMMERZBANK AG	32,935	6.780	223,299.300	
VOLKSWAGEN AG	1,110	309.000	342,990.000	
VOLKSWAGEN AG-PREF	6,300	240.000	1,512,000.000	
SIEMENS AG-REG	26,350	136.000	3,583,600.000	
E.ON SE	76,100	10.062	765,718.200	
UNIPER SE	6,650	29.940	199,101.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,250	94.400	1,062,000.000	
GEA GROUP AG	5,050	35.200	177,760.000	
CONTINENTAL AG	3,710	128.680	477,402.800	
BASF SE	31,670	68.550	2,170,978.500	
ALLIANZ SE-REG	14,190	218.650	3,102,643.500	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,050	94.320	570,636.000	
RWE AG	21,800	30.890	673,402.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,650	10.728	103,525.200	
BRENNTAG SE	5,350	77.400	414,090.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	14,050	44.825	629,791.250	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	33.500	111,220.000	
SAP SE	35,892	114.800	4,120,401.600	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,760	237.700	1,131,452.000	
ZALANDO SE	5,750	95.500	549,125.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	4,900	75.820	371,518.000	
KION GROUP AG	2,400	90.800	217,920.000	
COVESTRO AG	6,700	58.160	389,672.000	
RATIONAL AG	190	721.800	137,142.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	387.500	468,875.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,300	99.740	528,622.000	
DELIVERY HERO SE	5,450	111.150	605,767.500	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,400	149.150	208,810.000	
BECHTLE AG	950	155.200	147,440.000	
NEMETSCHEK SE	2,000	59.960	119,920.000	
SCOUT24 AG	3,600	65.480	235,728.000	
AROUNDTOWN SA	32,500	6.880	223,600.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,950	46.870	419,486.500	
KNORR-BREMSE AG	2,500	102.700	256,750.000	
HELLOFRESH SE	5,700	80.160	456,912.000	
TEAMVIEWER AG	5,350	30.950	165,582.500	
SIEMENS ENERGY AG	13,125	25.390	333,243.750	

BEIERSDORF AG	3,290	100.350	330,151.500	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	2,350	41.160	96,726.000	
MERCK KGAA	4,400	146.400	644,160.000	
ADIDAS AG	6,640	296.600	1,969,424.000	
PUMA SE	3,310	92.560	306,373.600	
HENKEL AG & CO KGAA	3,400	81.850	278,290.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	114,900	17.282	1,985,701.800	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,220	67.640	488,360.800	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	29,550	79.540	2,350,407.000	
QIAGEN N.V.	7,698	38.620	297,296.760	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	44,300	33.380	1,478,734.000	
HANNOVER RUECK SE	2,000	143.500	287,000.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	34,200	56.650	1,937,430.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,410	134.850	864,388.500	
LANXESS AG	2,800	63.520	177,856.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,790	207.600	371,604.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	11,400	51.260	584,364.000	
SYMRISE AG	4,400	110.050	484,220.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.236	75,576.800	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,950	80.600	157,170.000	
VONOVIA SE	18,200	52.940	963,508.000	
LEG IMMOBILIEN SE	2,300	120.200	276,460.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	31,410	46.185	1,450,670.850	
NN GROUP NV	9,900	41.640	412,236.000	
ARCELORMITTAL	24,300	27.125	659,137.500	
HEINEKEN NV	8,800	97.560	858,528.000	
AEGON NV	58,244	3.860	224,821.840	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	37,383	24.095	900,743.380	
AKZO NOBEL N.V.	6,538	106.800	698,258.400	
KONINKLIJKE DSM NV	5,850	152.450	891,832.500	
WOLTERS KLUWER	9,300	79.360	738,048.000	
ING GROEP NV	134,150	11.342	1,521,529.300	
KONINKLIJKE KPN NV	121,150	2.719	329,406.850	
ASML HOLDING NV	14,410	558.100	8,042,221.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,050	11.096	144,802.800	

ADYEN NV	690	1,863.200	1,285,608.000	
JUST EAT TAKEAWAY	4,250	74.630	317,177.500	
PROSUS NV	16,500	87.020	1,435,830.000	
JDE PEET'S NV	2,600	31.810	82,706.000	
INPOST SA	7,000	15.826	110,782.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,600	266.300	426,080.000	
VOPAK	2,300	38.770	89,171.000	
RANDSTAD NV	4,000	64.280	257,120.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,950	83.000	327,850.000	
TOTALENERGIES SE	85,950	39.680	3,410,496.000	
MICHELIN (CGDE)	5,700	130.450	743,565.000	
AIR LIQUIDE SA	16,327	140.920	2,300,800.840	
KERING	2,580	735.700	1,898,106.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	18,550	130.640	2,423,372.000	
BOUYGUES SA	8,200	33.400	273,880.000	
BNP PARIBAS	38,800	57.110	2,215,868.000	
NATIXIS	29,550	4.004	118,318.200	
THALES SA	3,500	84.500	295,750.000	
DANONE	22,700	58.860	1,336,122.000	
CARREFOUR SA	21,200	17.325	367,290.000	
SUEZ	11,225	20.080	225,398.000	
VIVENDI	27,891	29.170	813,580.470	
L'OREAL	8,660	376.400	3,259,624.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	17,200	58.260	1,002,072.000	
LEGRAND SA	9,067	87.720	795,357.240	
PERNOD RICARD SA	7,087	179.650	1,273,179.550	
EURAZEO SE	1,254	72.350	90,726.900	
SOCIETE GENERALE SA	27,950	26.520	741,234.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,570	651.200	6,231,984.000	
ACCOR SA	6,150	34.010	209,161.500	
CAPGEMINI SE	5,470	150.750	824,602.500	
VALEO SA	7,700	28.180	216,986.000	
PUBLICIS GROUPE	7,500	55.740	418,050.000	
BUREAU VERITAS SA	9,700	25.650	248,805.000	
EIFFAGE	2,740	90.280	247,367.200	
SODEXO SA	2,950	79.380	234,171.000	
IPSEN	1,150	85.960	98,854.000	
ORPEA	1,800	105.600	190,080.000	

AMUNDI SA	1,950	73.050	142,447.500	
TELEPERFORMANCE	2,000	312.500	625,000.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	57.760	173,280.000	
FAURECIA	3,857	46.710	180,160.470	
EUROFINS SCIENTIFIC	4,400	84.280	370,832.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,000	344.600	344,600.000	
SEB SA	997	152.500	152,042.500	
ESSILORLUXOTTICA	9,850	143.740	1,415,839.000	
DASSAULT AVIATION SA	100	1,004.000	100,400.000	
WORLDLINE SA	8,064	76.010	612,944.640	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,500	47.240	165,340.000	
AXA SA	66,700	22.835	1,523,094.500	
EDENRED	8,300	45.000	373,500.000	
RENAULT SA	6,400	34.180	218,752.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,090	1,158.500	1,262,765.000	
STMICROELECTRONICS NV	23,600	30.550	720,980.000	
REMY COINTREAU	750	162.700	122,025.000	
ATOS SE	3,200	53.640	171,648.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	4,500	187.150	842,175.000	
WENDEL	930	114.800	106,764.000	
ORANGE	67,600	10.514	710,746.400	
ALSTOM	9,700	45.730	443,581.000	
CNP ASSURANCES	5,850	14.650	85,702.500	
SANOFI	38,975	86.080	3,354,968.000	
VINCI SA	18,350	93.450	1,714,807.500	
AIRBUS SE	20,200	109.920	2,220,384.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,300	25.700	470,310.000	
CREDIT AGRICOLE SA	39,100	12.368	483,588.800	
BIOMERIEUX	1,340	91.500	122,610.000	
ENGIE	61,823	12.310	761,041.130	
EDF	20,250	11.220	227,205.000	
SAFRAN SA	11,920	122.520	1,460,438.400	
ILIAD SA	490	131.800	64,582.000	
ARKEMA	2,220	108.900	241,758.000	
ADP	910	111.900	101,829.000	
SCOR SE	5,550	26.830	148,906.500	
GETLINK SE	14,200	12.950	183,890.000	
BOLLORE	28,600	4.378	125,210.800	
UCB SA	4,530	76.460	346,363.800	

KBC GROUP NV	8,650	67.700	585,605.000	
COLRUYT SA	1,600	50.660	81,056.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,800	93.640	355,832.000	
SOLVAY SA	2,450	114.300	280,035.000	
UMICORE	7,000	50.880	356,160.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	26,150	62.850	1,643,527.500	
AGEAS	6,290	49.740	312,864.600	
PROXIMUS	4,950	16.930	83,803.500	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	87.900	92,295.000	
SOFINA	550	342.400	188,320.000	
ARGENX SE	1,520	221.400	336,528.000	
PRYSMIAN SPA	8,850	29.470	260,809.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	37,243	17.085	636,296.650	
MEDIOBANCA SPA	20,665	10.015	206,959.970	
TENARIS SA	15,700	9.628	151,159.600	
UNICREDIT SPA	73,956	10.494	776,094.260	
TELECOM ITALIA SPA	343,982	0.446	153,587.960	
TELECOM ITALIA-RSP	203,950	0.476	97,182.170	
INTESA SANPAOLO	571,737	2.480	1,418,193.620	
ATLANTIA SPA	17,257	15.650	270,072.050	
POSTE ITALIANE SPA	17,700	11.800	208,860.000	
MONCLER SPA	6,600	58.300	384,780.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,450	46.120	159,114.000	
ENI SPA	87,800	10.380	911,364.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	10.700	208,650.000	
DIASORIN SPA	850	141.400	120,190.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	11,200	9.236	103,443.200	
NEXI SPA	14,650	16.500	241,725.000	
AMPLIFON SPA	4,300	39.220	168,646.000	
ENEL SPA	281,134	7.931	2,229,673.750	
SNAM SPA	70,100	4.900	343,490.000	
TERNA SPA	49,000	6.352	311,248.000	
EXOR NV	3,780	70.740	267,397.200	
CNH INDUSTRIAL NV	34,200	14.590	498,978.000	
FINECOBANK SPA	20,700	13.880	287,316.000	
STELLANTIS NV	69,300	17.166	1,189,603.800	
FERRARI NV	4,295	178.950	768,590.250	
TELEFONICA SA	167,227	3.820	638,807.140	

ENDESA SA	10,350	21.790	225,526.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	225,700	5.217	1,177,476.900	
IBERDROLA SA	207,434	10.610	2,200,874.740	
REPSOL SA	49,400	11.250	555,750.000	
GRIFOLS SA	9,800	21.820	213,836.000	
BANCO SANTANDER SA	599,750	3.442	2,064,639.370	
AMADEUS IT GROUP SA	15,050	61.700	928,585.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	21.450	201,630.000	
CAIXABANK SA	150,500	2.820	424,410.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	25.140	223,142.640	
AENA SME SA	2,600	140.550	365,430.000	
CELLNEX TELECOM SA	18,005	50.060	901,330.300	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	37,700	31.670	1,193,959.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	7,700	25.550	196,735.000	
ENAGAS SA	7,950	19.480	154,866.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	13,900	16.590	230,601.000	
FERROVIAL SA	16,270	24.400	396,988.000	
UPM-KYMMENE OYJ	18,050	31.910	575,975.500	
NOKIA OYJ	191,300	4.511	862,954.300	
WARTSILA OYJ ABP	14,700	11.550	169,785.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	19,700	14.940	294,318.000	
ELISA OYJ	4,600	48.970	225,262.000	
SAMPO OYJ-A SHS	17,300	38.740	670,202.000	
FORTUM OYJ	14,950	23.400	349,830.000	
KESKO OYJ-B SHS	9,200	29.200	268,640.000	
KONE OYJ-B	11,800	67.120	792,016.000	
NESTE OYJ	14,700	56.140	825,258.000	
ORION OYJ-CLASS B	3,600	35.270	126,972.000	
VERBUND AG	2,250	73.700	165,825.000	
OMV AG	5,300	50.920	269,876.000	
ERSTE GROUP BANK AG	9,450	34.010	321,394.500	
VOESTALPINE AG	4,250	37.480	159,290.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	4,400	20.260	89,144.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,600	43.560	374,616.000	
KINGSPAN GROUP PLC	5,400	80.340	433,836.000	

	JERONIMO MARTINS	8,500	15.960	135,660.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	92,100	4.479	412,515.900	
	GALP ENERGIA SGPS SA	16,750	9.836	164,753.000	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,000	18.600	204,600.000	
	KERRY GROUP PLC-A	5,300	109.800	581,940.000	
	CRH PLC	26,700	43.050	1,149,435.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	5,810	155.300	902,293.000	
ユーロ　小計				ユーロ 162,595,485.190 (21,677,230,085)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	52,500	47.600	2,499,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	83,000	63.700	5,287,100.000	
	MTR CORP	58,500	43.300	2,533,050.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	49,500	118.000	5,841,000.000	
	SINO LAND CO	126,000	12.120	1,527,120.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	102,169	60.100	6,140,356.900	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	18,500	57.900	1,071,150.000	
	CLP HOLDINGS LTD	62,000	78.250	4,851,500.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	55,507	37.300	2,070,411.100	
	HONG KONG & CHINA GAS	422,475	12.420	5,247,139.500	
	HANG SENG BANK LTD	28,800	159.300	4,587,840.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	58,500	40.900	2,392,650.000	
	WH GROUP LTD	361,000	6.805	2,456,605.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	44,500	478.400	21,288,800.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	19.400	1,513,200.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	45,240	15.800	714,792.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	62,000	29.150	1,807,300.000	
	SJM HOLDINGS LTD	71,000	8.920	633,320.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	38,200	22.800	870,960.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	50.950	4,645,060.550	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	23,500	47.950	1,126,825.000	
	AIA GROUP LTD	447,000	97.950	43,783,650.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,000	44.500	2,803,500.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	60,900	25.750	1,568,175.000	
	ESR CAYMAN LTD	75,000	24.500	1,837,500.000	

	SANDS CHINA LTD	86,800	34.350	2,981,580.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	14.820	1,215,240.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	52,000	135.600	7,051,200.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	132,000	28.150	3,715,800.000	
	WYNN MACAU LTD	54,000	13.320	719,280.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 144,781,105.050 (2,045,757,015)	
合計				199,282,719,518 [199,282,719,518]	

(2)　株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,887	1,034,822.250	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	11,557	1,528,644.390	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,250	631,417.500	
		VORNADO REALTY TRUST	5,397	261,376.710	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,800	1,188,374.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	12,700	1,001,776.000	
		EQUINIX INC	3,148	2,472,407.720	
		AMERICAN TOWER CORP	15,450	4,098,576.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	24,943	436,003.640	
		INVITATION HOMES INC	20,000	738,200.000	
		VICI PROPERTIES INC	18,900	600,831.000	
		VENTAS INC	13,250	752,070.000	
		WEYERHAEUSER CO	26,464	952,968.640	
		AGNC INVESTMENT CORP	18,100	337,565.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	14,750	2,901,472.500	
		IRON MOUNTAIN INC	10,260	468,574.200	
		VEREIT INC	8,150	398,127.500	
		SUN COMMUNITIES INC	3,720	636,975.600	
		PROLOGIS INC	25,252	3,090,592.280	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,650	856,018.500	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,450	445,671.000	
		DUKE REALTY CORP	13,150	633,567.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,310	704,942.700	
		WELLTOWER INC	14,750	1,127,637.500	

	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	19,000	640,110.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,050	670,396.500	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,150	450,241.500	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	47,600	449,820.000	
	REALTY INCOME CORP	13,150	926,023.000	
	PUBLIC STORAGE	5,550	1,602,340.500	
	REGENCY CENTERS CORP	5,700	375,003.000	
	UDR INC	10,550	517,266.500	
	WP CAREY INC	6,050	472,686.500	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8,300	308,428.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,900	1,536,282.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,650	716,890.500	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,350	429,385.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 36,393,484.630 (3,987,634,111)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	23,562	168,751.040	
	SEGRO PLC	40,600	430,563.000	
	BRITISH LAND CO PLC	29,550	151,887.000	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 751,201.040 (116,593,914)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	23,500	297,510.000	
	TRANSURBAN GROUP	91,500	1,305,705.000	
	SYDNEY AIRPORT	42,500	260,100.000	
	APA GROUP	38,100	352,425.000	
	SCENTRE GROUP	170,922	478,581.600	
	DEXUS	36,150	381,021.000	
	GPT GROUP	63,160	293,694.000	
	MIRVAC GROUP	136,100	396,051.000	
	STOCKLAND	78,000	369,720.000	
	GOODMAN GROUP	55,300	1,114,848.000	
	VICINITY CENTRES	123,273	201,551.350	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 5,451,206.950 (462,098,813)	

カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,900	162,951.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	101,003.000	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 263,954.000 (23,935,349)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	124,500	361,050.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	175,032	365,816.880	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	104,800	208,552.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	77,500	159,650.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 1,095,068.880 (90,616,950)	
ユーロ			ユーロ	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	330,740.000	
	GECINA SA	1,600	212,720.000	
	KLEPIERRE	7,150	172,744.000	
	COVIVIO	1,750	137,410.000	
ユーロ　小計			ユーロ 853,614.000 (113,803,819)	
香港・ドル			香港・ドル	
	LINK REIT	79,500	5,890,950.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92,000	722,200.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	138,000	1,435,200.000	
香港・ドル　小計			香港・ドル 8,048,350.000 (113,723,186)	
投資証券　合計			4,908,406,142 [4,908,406,142]	
合計			4,908,406,142 [4,908,406,142]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 601銘柄 投資証券 37銘柄	97.3%	2.7%	71.5%
イギリス・ポンド	株式 83銘柄 投資証券 3銘柄	98.8%	1.2%	4.7%
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 52銘柄 投資証券 11銘柄	90.1%	9.9%	2.3%
カナダ・ドル	株式 89銘柄 投資証券 2銘柄	99.7%	0.3%	3.6%
シンガポール・ドル	株式 15銘柄 投資証券 4銘柄	87.8%	12.2%	0.4%
スイス・フラン	株式 40銘柄	100%	-%	3.1%
スウェーデン・クローナ	株式 41銘柄	100%	-%	1.3%
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 11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 232銘柄 投資証券 4銘柄	99.5%	0.5%	10.7%
香港・ドル	株式 30銘柄 投資証券 3銘柄	94.7%	5.3%	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

	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	812,943,865	395,844,187
コール・ローン	1,430,530,889	861,235,429
国債証券	193,703,890,662	222,038,899,679
派生商品評価勘定	40,228,465	－
未収入金	1,151,268	160,203
未収利息	1,123,515,415	1,204,487,740
前払費用	62,119,399	29,102,452
流動資産合計	197,174,379,963	224,529,729,690
資産合計	197,174,379,963	224,529,729,690
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	－	2,740,056
未払金	225,601,881	63,767
未払解約金	97,730,682	167,320,850
その他未払費用	5,752	－
流動負債合計	323,338,315	170,124,673
負債合計	323,338,315	170,124,673
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	65,630,254,690	72,171,959,824
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	131,220,786,958	152,187,645,193
元本等合計	196,851,041,648	224,359,605,017
純資産合計	196,851,041,648	224,359,605,017
負債純資産合計	197,174,379,963	224,529,729,690

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年6月6日 至　2021年6月7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	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
1．※1　期首	2019年6月12日	2020年6月6日
期首元本額	62,648,457,290円	65,630,254,690円
期中追加設定元本額	10,631,945,618円	14,128,279,151円
期中一部解約元本額	7,650,148,218円	7,586,574,017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	622,267,469円	523,830,915円

ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	17,542,061円	10,805,026円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	106,646,210円	93,234,451円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	31,704,023円	26,042,029円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	355,714,969円	319,990,353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）	60,771,118円	147,412,708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）	458,724,525円	494,252,758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）	1,662,091,109円	2,104,774,269円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	634,121,149円	801,683,813円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	1,076,866円	946,948円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	899,682円	3,569,968円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	638,965,164円	1,262,673,100円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	816,339,611円	1,231,075,720円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	31,795,513円	151,520,118円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	46,840,325,430円	49,249,685,981円
ダイワ・ライフ・バランス３０	762,953,937円	888,433,073円
ダイワ・ライフ・バランス５０	407,450,283円	528,928,478円
ダイワ・ライフ・バランス７０	244,898,386円	333,789,552円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	392,918,790円	532,794,484円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	314,110,022円	398,386,255円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	98,246,948円	142,012,313円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	9,276,813円	－円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	20,253,456円	24,115,938円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	4,155,725円	7,428,392円
ダイワつみたてインデックス外国債券	122,118,491円	307,504,770円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	2,998,751円	3,543,248円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	818,378円	1,159,154円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	824,291円	1,225,356円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	189,344,850円	171,725,827円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	139,026,561円	138,299,284円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	4,342,555,265円	4,148,853,363円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	265,380,470円	245,616,231円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	145,424,954円	144,966,306円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	30,509,234円	36,510,395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）	18,798,389円	1,781,831,534円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,734,659,693円	5,798,708,777円
ダイワライフスタイル２５	32,333,560円	33,300,268円
ダイワライフスタイル５０	57,394,936円	63,771,059円
ダイワライフスタイル７５	14,817,608円	17,557,610円

計	65,630,254,690円	72,171,959,824円
2. 期末日における受益権の総数	65,630,254,690口	72,171,959,824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　2020年6月6日 至　2021年6月7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	2021年6月7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	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	4,546,616,505	△9,726,709,346
合計	4,546,616,505	△9,726,709,346

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年12月3日から2020年6月5日まで、及び2020年12月1日から2021年6月7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	2020年6月5日 現在				2021年6月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	1,273,473,895	－	1,313,702,360	40,228,465	778,958,665	－	776,218,609	△2,740,056
アメリカ・ドル	78,272,860	－	79,155,780	882,920	293,596,666	－	292,813,785	△782,881
イギリス・ポンド	69,482,595	－	72,124,500	2,641,905	－	－	－	－
オーストラリア・ドル	17,464,339	－	18,531,800	1,067,461	20,163,888	－	20,090,490	△73,398
カナダ・ドル	31,501,334	－	32,610,880	1,109,546	－	－	－	－
シンガポール・ドル	20,422,136	－	20,909,360	487,224	－	－	－	－
スウェーデン・クローナ	24,137,565	－	25,344,820	1,207,255	22,289,608	－	22,243,200	△46,408

デンマーク・クローネ	－	－	－	－	6,502,158	－	6,472,730	△29,428
ノルウェー・クローネ	10,795,217	－	11,471,610	676,393	－	－	－	－
メキシコ・ペソ	59,912,376	－	61,756,960	1,844,584	－	－	－	－
ユーロ	961,485,473	－	991,796,650	30,311,177	436,406,345	－	434,598,404	△1,807,941
合計	1,273,473,895	－	1,313,702,360	40,228,465	778,958,665	－	776,218,609	△2,740,056

（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）

	2020年6月5日現在	2021年6月7日現在
1口当たり純資産額	2.9994円	3.1087円
（1万口当たり純資産額）	(29,994円)	(31,087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	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,589,664.050	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,813,295.720	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,487,460.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,829,204.300	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,800,282.800	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,331,448.430	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,580,911.700	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,231,083.520	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	741,034.320	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,064,269.800	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	931,555.100	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	906,549.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	947,518.200	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	1,004,669.400	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,230,647.470	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,586,588.640	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,213,522.310	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	740,353.480	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	711,533.430	

		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,285,843.220	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,503,709.400	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,465,195.600	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,649,943.900	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,421,019.500	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,297,014.200	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,403,800.610	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,983,252.830	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,800,367.800	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,876,765.800	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,927,287.820	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,688,568.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,891,671.420	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,547,385.510	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,455,304.740	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,792,103.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,062,651.280	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,578,333.020	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,044,979.700	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,669,111.410	

		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,171,978.920	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,046,463.750	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,558,894.420	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,258,048.820	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,289,878.300	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	3,149,305.020	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	6,064,205.990	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,697,634.390	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,147,897.840	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,255,260.400	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	1,326,000.000	1,349,483.460	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,882,526.010	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220731	3,079,000.000	3,147,292.220	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	6,078,563.490	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,373,000.000	3,793,680.560	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,498,472.150	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,525,568.240	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,248,975.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	758,337.660	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,621,131.440	

		2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,463,036.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,148,549.120	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	5,070,128.700	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,629,711.630	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	3,312,640.400	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,032,229.020	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,712,705.480	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	8,050,526.400	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,127,877.200	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,971,856.790	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,573,025.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,075,330.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,582,250.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,491,275.200	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,845,024.200	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,464,008.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,573,887.500	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,609,255.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,585,150.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,500,000.000	1,691,070.000	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,607,777.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,629,275.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,901,898.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,611,539.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,091,000.900	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,416,955.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,786,918.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,906,688.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,309,440.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,148,110.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,049,500.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,566,219.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,053,370.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,522,712.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,320,788.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,959,798.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,167,550.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,450,000.000	3,808,041.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,260,224.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,096,940.000	

		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,558,475.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,643,350.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,566,200.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,890,995.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	3,862,985.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,717,245.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,388,608.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,979,032.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,629,850.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	7,000,875.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,442,560.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,792,842.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,926,746.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	4,392,990.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,024,381.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,132,667.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	4,970,238.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,217,535.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,623,425.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,071,741.000	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,875,996.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,628,600.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,627,625.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,262,830.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,063,521.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,444,571.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	4,883,299.600	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,734,950.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,806,136.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,921,588.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,752,225.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,186,300.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,754,975.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,255,760.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	4,181,555.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	5,599,150.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,293,190.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,131,780.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,806,110.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,653,400.000	

		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,223,370.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,238,560.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,720,400.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	5,450,496.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,705,750.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,489,981.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,678,025.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	5,273,007.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,197,960.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,697,820.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	3,018,092.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,559,920.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,196,860.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,652,425.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,949,716.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,073,720.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,743,375.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,633,975.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,785,916.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,558,765.000	

		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	4,604,094.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,876,440.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,113,880.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	3,053,670.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,599,000.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,110,730.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,949,938.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,036,910.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,118,110.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	6,011,518.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	4,626,540.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,077,420.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,110,250.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,068,760.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,613,950.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,613,650.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,088,400.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,755,777.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,297,722.500	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	5,021,250.000	

		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,299,616.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,110,776.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	302,682.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,321,056.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	4,200,000.000	4,227,888.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,499,580.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	3,200,000.000	3,207,104.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,567,360.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,237,776.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,499,020.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,685,015.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,330,232.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	4,393,368.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,203,700.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220531	500,000.000	500,290.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,391,570.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,964,360.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,510,945.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	5,500,000.000	5,502,970.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,402,725.000	

		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,387,475.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	999,250.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,351,890.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220731	3,500,000.000	3,501,890.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	800,000.000	799,216.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	9,241,400.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,793,550.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	5,430,082.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	5,023,560.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,376,240.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,000,000.000	3,001,620.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,997,420.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	6,394,830.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20220930	3,000,000.000	3,001,050.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,823,560.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,446,240.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,193,406.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	3,000,000.000	3,003,150.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	9,242,184.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20221031	3,500,000.000	3,501,365.000	

		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,929,680.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,845,600.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	5,875,880.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	4,460,868.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20221130	3,000,000.000	3,000,810.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	5,032,221.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,841,200.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,992,950.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,832,000.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	985,580.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	1,700,000.000	1,700,255.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,988,560.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,811,560.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	5,421,746.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	10,295,326.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,984,150.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,000,000.000	2,000,060.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,922,250.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,983,750.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	4,486,996.000	

		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,967,990.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,000,000.000	1,999,840.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,999,360.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,000,000.000	2,999,400.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,000,000.000	5,017,550.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	4,000,440.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	3,007,830.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	2,500,000.000	2,515,325.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	5,091,993.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,497,165.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230430	3,400,000.000	3,398,912.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	6,015,900.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	600,000.000	617,742.000	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 897,334,524.050 (98,320,943,799)	
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	1,741,667.240	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,409,868.680	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,549,164.250	
		0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,332,644.000	

		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,940,000.000	2,014,399.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	2,350,000.000	2,539,198.500	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	2,056,594.400	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,476,100.800	
		0.75% United Kingdom Gilt 20230722	3,000,000.000	3,043,920.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,611,360.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	770,000.000	908,369.000	
		1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,844,910.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,110,000.000	1,219,468.200	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	921,289.500	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	809,760.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	2,600,000.000	2,642,120.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	1,179,968.300	
		0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,302,392.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,206,114.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	750,000.000	575,527.500	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,485,690.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,553,872.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	913,220.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,300,000.000	1,210,105.000	

		0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,299,285.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	600,000.000	561,618.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	451,095.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	100,000.000	99,615.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	300,000.000	293,817.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,321,719.750	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,479,344.800	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,736,194.560	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,369,662.980	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	2,120,380.350	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,482,328.960	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	2,230,473.100	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,526,682.080	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	3,877,365.920	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,830,000.000	2,492,423.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,280,521.440	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,162,926.800	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	2,225,012.400	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	2,162,249.720	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,396,314.580	

	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,519,454.720	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,290,068.480	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	2,989,578.180	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,659,423.080	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,586,000.000	2,892,419.920	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,183,651.560	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,924,000.000	2,779,852.910	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 94,431,202.060 (14,656,666,872)	
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	2,595,320.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,933,974.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	2,999,606.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,195,440.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,423,717.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,928,430.000	
	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,016,930.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	3,046,992.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	1,962,594.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,547,445.000	
	0.75% Israel Government Bond - Fixed 20220731	1,000,000.000	1,007,950.000	

		1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,900,000.000	1,868,061.000	
		0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,100,000.000	1,102,431.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,605,395.000	
		0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	2,000,000.000	1,997,320.000	
	イスラエル・シュケル　小計			イスラエル・シュケル 29,231,605.000 (985,450,022)	
	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	1,162,000.000	1,235,542.980	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,268,000.000	2,499,177.240	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,424,312.540	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,973,000.000	2,125,335.330	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,640,291.840	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,498,000.000	2,766,435.080	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,628,694.860	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,748,000.000	3,214,060.800	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,357,782.090	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,429,701.160	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	907,236.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	2,955,419.040	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,264,547.660	

	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,360,999.120	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,800,000.000	1,994,688.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,850,000.000	1,909,570.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	2,104,440.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	3,370,000.000	3,657,326.200	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,471,523.500	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,806,374.400	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,300,000.000	1,238,263.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,395,344.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,500,000.000	3,319,645.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	1,152,886.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,900,000.000	1,869,315.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,336,200.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,179,408.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,100,000.000	1,098,064.000	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 56,342,582.840 (4,776,160,748)	
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	488,353.050	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,316,217.340	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,617,460.680	

		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,474,453.640	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,240,739.610	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,795,055.160	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,253,441.910	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,282,370.320	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,488,752.050	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,560,853.910	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,227,949.440	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	998,447.910	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,238,884.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,767,045.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	686,894.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,409,263.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,347,151.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,360,000.000	3,374,380.800	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,311,597.600	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,258,800.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,442,574.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,408,255.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	715,428.000	

		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,858,441.200	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220801	2,300,000.000	2,301,311.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20221101	700,000.000	700,063.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	1,700,000.000	1,556,435.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,040,318.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,191,768.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,499,715.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230501	1,100,000.000	1,098,724.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	300,636.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	600,000.000	598,782.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230801	100,000.000	99,732.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 50,950,292.620 (4,620,172,535)	
	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	876,374.400	
		3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	788,000.000	815,501.200	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	672,092.400	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	903,644.910	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	460,800.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	703,879.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	668,536.000	

	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	695,625.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	559,684.400	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	807,368.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	477,598.500	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	789,225.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	460,422.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	600,050.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	509,943.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	377,408.500	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	710,000.000	713,152.400	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	150,000.000	148,545.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 11,239,849.710 (930,097,563)	
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	6,736,855.650	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	8,785,146.300	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,374,890.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,392,778.800	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,569,443.200	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	5,254,525.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	2,300,000.000	2,733,021.000	

	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,686,158.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,886,400.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 59,419,217.950 (786,710,446)	
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	23,845,928.040	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,090,577.620	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,602,694.910	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,283,624.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,048,306.100	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	4,300,000.000	4,348,848.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,200,000.000	1,998,920.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	493,760.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 60,712,658.670 (1,088,577,969)	
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	8,439,782.960	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,343,935.050	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,546,707.400	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,420,724.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,551,223.000	

	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,657,570.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,952,756.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,766,112.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,413,025.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 42,091,835.910 (555,191,316)	
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	2,475,317.270	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,654,939.500	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,375,035.600	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	3,985,019.500	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	3,028,711.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	5,245,108.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,579,010.000	
	Poland Government Bond 20220725	1,600,000.000	1,598,544.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,990,060.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,855,370.000	
	Poland Government Bond 20230425	1,000,000.000	993,900.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	300,000.000	283,650.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,082,584.350	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,847,888.750	

	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,950,577.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	5,011,535.600	
ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 46,957,251.070 (1,404,007,720)	
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	2,453,515.890	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,285,492.500	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,637,542.400	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,379,469.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	891,406.250	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	771,248.860	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,027,326.300	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,431,523.590	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,975,339.820	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	800,000.000	866,344.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,116,445.680	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,837,224.900	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,190,802.870	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,261,516.600	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,352,231.160	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	982,582.200	

		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	692,861.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	791,265.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,255,818.900	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,250,000.000	1,349,150.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,263,624.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,700,000.000	1,754,791.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,295,424.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	653,208.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	686,458.500	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	2,007,734.700	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,288,632.000	
		3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	414,304.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,294,397.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,661,432.500	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,300,000.000	1,251,692.000	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,000,000.000	950,670.000	
	マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 40,071,474.620 (1,063,677,258)	
	メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
		5.75% Mexican Bonos 20260305	28,290,000.000	27,901,012.500	
		8% Mexican Bonos 20471107	19,300,000.000	20,507,794.000	
		8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	25,387,222.000	
		6.75% Mexican Bonos 20230309	17,200,000.000	17,714,452.000	
		8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	31,906,758.870	

	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	27,105,489.180	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	29,674,607.360	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,315,148.660	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	33,262,703.280	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	16,894,000.000	18,953,378.600	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	20,015,000.000	21,648,224.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	28,599,000.000	29,088,614.880	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	20,489,295.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	8,535,351.360	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 323,490,051.690 (1,776,413,269)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	391,667.640	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	296,331.480	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	851,460.790	
	Finland Government Bond 20230915	700,000.000	710,710.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	435,074.400	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	844,616.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	670,000.000	750,145.400	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	528,025.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	527,140.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	204,128.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	301,617.600	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	385,932.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	502,415.000	

		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	345,436.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	300,000.000	302,721.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,478,734.730	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,199,606.620	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	951,391.840	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	307,740.000	
		Austria Government Bond 20230715	900,000.000	912,168.000	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,348,147.200	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	870,328.800	
		Austria Government Bond 20220920	400,000.000	403,376.000	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	900,000.000	963,720.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,031,900.800	
		Austria Government Bond 20240715	800,000.000	815,104.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	986,595.400	
		Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,012,070.000	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	712,747.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	363,956.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	300,000.000	266,439.000	
		Austria Government Bond 20310220	700,000.000	698,747.000	
		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	490,272.000	

		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,792,512.960	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,943,949.200	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,295,584.480	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,863,000.000	2,001,439.530	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,457,532.600	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	886,227.200	
		0.2% Belgium Government Bond 20231022	940,000.000	959,411.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,177,451.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,089,532.500	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	800,713.200	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	459,492.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,600,811.300	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	731,087.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,624,905.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	719,160.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,234,835.200	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	632,438.400	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,223,952.000	
		Belgium Government Bond 20311022	500,000.000	493,685.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	500,000.000	410,395.000	

		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,151,277.740	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,678,251.030	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	3,054,538.460	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,307,912.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	3,080,843.610	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,403,843.520	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	3,784,810.000	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	5,787,305.440	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,320,300.250	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	3,272,189.350	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,774,000.000	4,558,930.300	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,280,083.080	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,264,341.120	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,688,979.840	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,462,875.000	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,895,167.340	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,694,796.090	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,665,399.680	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	4,145,645.340	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,698,677.980	

		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,263,582.440	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,291,479.420	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,354,915.660	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,495,516.800	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,495,068.400	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,395,468.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,447,016.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,370,000.000	2,948,659.200	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,025,970.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	3,100,000.000	3,254,473.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,309,472.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,085,110.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,050,000.000	1,851,765.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,796,812.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	1,900,000.000	1,892,381.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,062,280.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,500,000.000	1,536,135.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,234,752.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	918,756.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	100,000.000	98,688.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,000,000.000	1,029,050.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	1,003,761.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220610	100,000.000	100,672.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220916	100,000.000	100,856.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221215	100,000.000	101,029.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230310	1,000,000.000	1,011,960.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230616	1,000,000.000	1,013,810.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,119,299.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,804,547.300	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,932,186.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,958,150.400	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,739,661.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,462,016.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,365,067.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	102,957.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,264,900.000	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,329,993.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,899,467.000	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,812,567.980	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	4,778,795.820	

		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,263,520.370	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,314,185.560	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	3,760,154.860	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,580,323.090	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,864,000.000	6,685,956.480	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,367,740.970	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	4,359,266.980	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	4,499,000.000	5,387,237.570	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	3,694,000.000	3,844,456.620	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,011,400.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,047,000.000	4,239,596.730	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,521,921.060	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	6,237,679.400	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,298,121.530	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,636,219.600	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,444,858.410	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,920,000.000	5,612,834.400	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,787,000.000	3,965,443.440	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	3,869,000.000	4,321,866.450	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,287,000.000	1,605,159.270	

		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,800,000.000	3,933,152.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,108,209.400	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,671,830.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,850,000.000	3,639,393.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,428,776.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,700,256.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,416,337.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,290,065.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,458,446.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,950,000.000	3,396,689.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	3,950,000.000	4,140,706.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,130,000.000	3,193,977.200	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	4,215,372.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,427,264.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	2,614,741.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,063,450.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,500,000.000	1,464,075.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	3,500,000.000	3,481,800.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	680,000.000	518,704.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	101,616.000	

		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	500,000.000	474,990.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	1,800,000.000	1,771,434.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	900,000.000	916,362.000	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	621,119.640	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,589,816.200	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,490,301.400	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	848,260.490	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,479,000.000	2,522,626.770	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,484,778.140	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,511,707.360	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,457,504.750	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,579,000.000	2,519,247.130	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,640,994.320	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,855,207.350	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,638,000.000	1,725,338.160	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,361,414.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,425,942.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,456,366.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,248,768.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	942,003.000	

		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,420,300.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	820,840.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	850,000.000	747,192.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,000,000.000	1,007,240.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	865,872.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	1,108,699.380	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,531,955.400	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,320,048.160	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,980,652.180	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,971,085.980	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,641,790.880	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,218,532.750	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,058,845.160	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,539,569.600	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,921,551.100	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,390,814.190	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,917,199.560	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,634,068.080	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,129,506.120	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,585,371.000	

		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,147,050.960	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,737,165.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,681,249.100	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,379,781.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,502,698.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,983,743.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,726,078.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,687,984.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,603,641.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,320,395.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,943,871.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,377,519.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,810,043.500	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,341,636.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,721,213.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,615,325.700	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,812,475.000	
		1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,550,000.000	1,574,769.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,262,482.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,331,978.000	

		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,309,811.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,574,162.500	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	2,005,678.000	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	745,490.800	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,321,957.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,430,769.500	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,763,776.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,537,500.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,039,200.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,475,651.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	2,036,680.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,400,000.000	2,589,648.000	
		0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,317,771.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	1,700,000.000	1,763,767.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,734,221.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,300,000.000	1,349,946.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,300,000.000	2,318,492.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,107,612.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	900,000.000	867,375.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	662,270.000	

		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,878,226.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,000,000.000	1,949,240.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	675,962.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,094,731.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,509,360.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20221129	100,000.000	100,584.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	450,179.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	300,000.000	300,219.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,800,630.160	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,256,662.410	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,748,834.500	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,378,151.920	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,765,910.800	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,203,479.440	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,498,925.140	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,522,093.220	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,545,577.390	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,504,430.900	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,777,878.150	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,121,974.400	

		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,138,663.500	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,069,952.600	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,887,148.110	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,479,110.300	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,481,583.480	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,872,952.380	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,389,423.600	
		5% Belgium Government Bond 20350328	2,104,000.000	3,440,376.640	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,684,181.720	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,245,123.880	
		4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,401,553.160	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,107,810.600	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,418,453.940	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,392,458.970	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,654,521.750	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,007,038.170	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,261,861.520	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	674,412.960	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	674,261.670	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,166,413.750	
		2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	996,477.900	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,147,884.670	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	652,300.000	
		IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	352,947.000	

		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	860,160.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	841,065.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	842,280.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	1,038,008.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	692,370.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	349,776.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	823,008.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	500,000.000	505,510.000	
		IRISH TREASURY 20311018	500,000.000	490,860.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	390,532.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,163,357.250	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	2,191,184.430	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,102,237.500	
		3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	923,849.120	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	694,110.040	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	985,137.440	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,013,758.900	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	989,563.080	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,003,950.400	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	793,529.900	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	474,074.300	
		1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	321,135.360	
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	464,080.840	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	588,001.040	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	569,748.870	

		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,838,690.440	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,203,630.650	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,350,648.080	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,431,760.960	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,028,792.590	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,624,717.760	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,379,947.500	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,842,293.600	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,081,602.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	2,098,967.500	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,243,561.000	
		0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,623,312.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,623,944.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,697,839.000	
		0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,445,096.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,080,576.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,759,472.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,850,000.000	2,106,854.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,350,094.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,881,984.000	

		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,382,113.600	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,484,919.800	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,534,750.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,300,000.000	1,167,699.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,525,688.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,132,841.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	1,313,767.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	505,900.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	2,125,596.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	303,849.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	570,908.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	498,990.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	400,000.000	392,200.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	3,413,577.820	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,254,000.000	3,353,095.480	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,604,572.140	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,919,077.900	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	3,250,478.040	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,647,026.360	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,587,806.750	

		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,151,567.880	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,126,743.750	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,429,484.300	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,199,000.000	2,159,878.600	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,214,575.500	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,325,614.940	
	ユーロ　小計			ユーロ 683,129,539.170 (91,074,830,162)	
国債証券　合計				222,038,899,679 [222,038,899,679]	
合計				222,038,899,679 [222,038,899,679]	

（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	252銘柄	100%	44.2%
イギリス・ポンド	国債証券	51銘柄	100%	6.6%
イスラエル・シュケル	国債証券	15銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	28銘柄	100%	2.2%
カナダ・ドル	国債証券	34銘柄	100%	2.1%
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	9銘柄	100%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リンギット	国債証券	32銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	348銘柄	100%	41.0%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年6月30日

Ⅰ	資産総額	67,738,968円
Ⅱ	負債総額	33,127円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	67,705,841円
Ⅳ	発行済数量	60,684,936口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1157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6月30日

Ⅰ	資産総額	184,465,329,503円
Ⅱ	負債総額	5,100,504,252円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	179,364,825,251円
Ⅳ	発行済数量	136,675,909,573口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3123円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

純資産額計算書

2021年6月30日

Ⅰ	資産総額	31,871,264,376円
Ⅱ	負債総額	131,291,500円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	31,739,972,876円
Ⅳ	発行済数量	24,606,765,524口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2899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6月30日

Ⅰ	**資産総額**	**223,475,107,172円**
Ⅱ	**負債総額**	**186,307,130円**
Ⅲ	**純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）**	**223,288,800,042円**
Ⅳ	**発行済数量**	**58,969,372,308口**
Ⅴ	**１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）**	**3.7865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6月30日

Ⅰ	**資産総額**	**225,871,791,136円**
Ⅱ	**負債総額**	**573,034,705円**
Ⅲ	**純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）**	**225,298,756,431円**
Ⅳ	**発行済数量**	**72,541,954,676口**
Ⅴ	**１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）**	**3.1058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る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。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2021年6月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	47	106,733
追加型株式投資信託	747	21,024,994
株式投資信託　　合計	794	21,131,728
単位型公社債投資信託	66	193,167
追加型公社債投資信託	14	1,515,899
公社債投資信託　合計	80	1,709,066
総合計	874	22,840,794

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）	

（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【参考情報】

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

（提出年月日）	（書類名）
2020年8月28日	有価証券報告書、有価証券届出書
2021年2月26日	半期報告書、有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

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7月9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

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つみたてインデックスバランス３０の2020年6月6日から2021年6月7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、ダイワつみたてインデックスバランス３０の2021年6月7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。